

第2期末(2019年11月20日)

基準価額	10,701円
純資産総額	18百万円
騰落率	8.0%
分配金	0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)

【愛称】 ファンドパック7

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:2018年11月21日～2019年11月20日

第2期(決算日 2019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「ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券)」は、このたび第2期の決算を行いました。

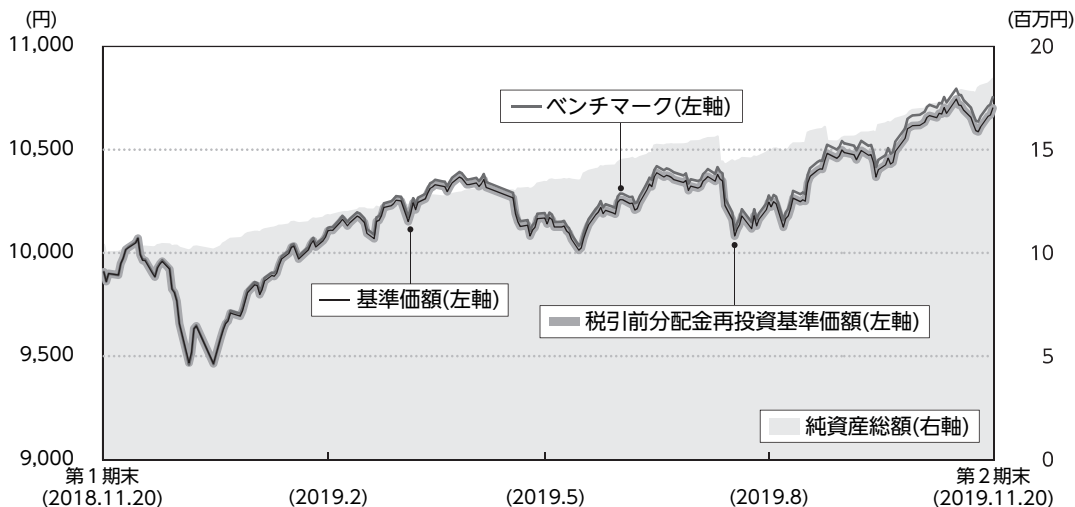
当ファンドは、投資対象の異なる7つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リート（不動産投資信託）および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2018年11月21日～2019年11月20日

基準価額等の推移



第2期首	9,908円	既払分配金	0円
第2期末	10,701円	騰落率 (分配金再投資ベース)	8.0%

- (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)、MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)、東証REIT指数 (配当込み)、S&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース) をそれぞれ10%ずつ、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) をそれぞれ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いて米ドルが対円で下落したことが下落要因となり、2018年末にかけて世界的な景気減速懸念を受けた国内株式市場の下落などから下落しましたが、期を通じて見ると国内株式市場や国内リート市場、主要な海外株式市場が上昇したことなどが上昇要因となり、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	10%	10.1%	6.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10	10.3	12.5
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	10	10.2	5.1
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	10	9.9	28.5
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	10	9.9	12.2
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	25	24.8	2.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25	24.8	4.3

（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 2 期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.351%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,207円です。
(投信会社)	(17)	(0.162)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(17)	(0.162)	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)	(0.026)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	1	0.010	
(株式)	(0)	(0.005)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
有価証券取引税	0	0.003	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	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	7	0.071	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)	(5)	(0.053)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.010)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(1)	(0.008)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	44	0.435	

(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。

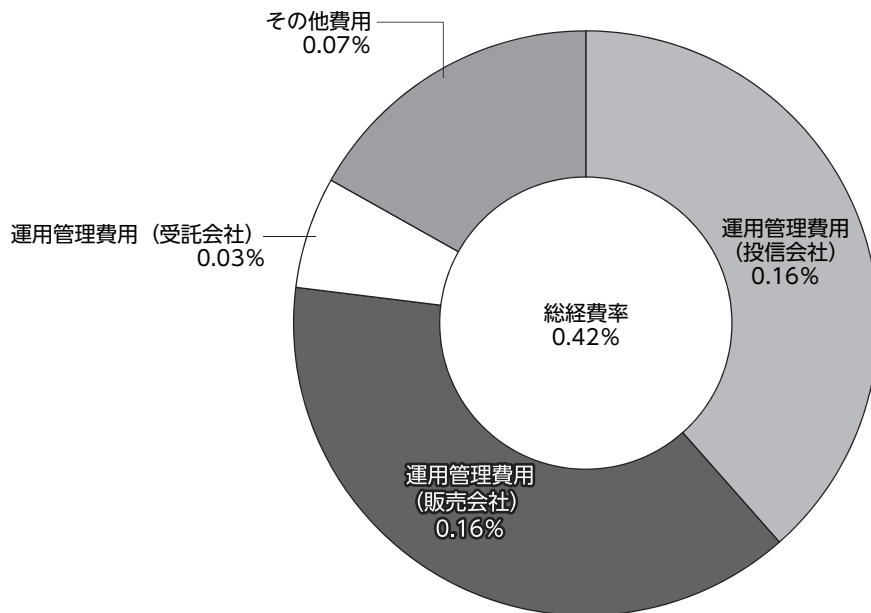
(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.42%**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。

期初より2018年末にかけて、米中貿易摩擦の深刻化や世界的な景気減速懸念、さらに米政権運営を巡る不透明感などを受けて国内株式市場は大幅に下落しました。2019年1月以降は、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを急がないとの見方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国内株式市場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との懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が高まったことから、国内株式市場は弱含みました。しかし、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国内株式市場は上昇傾向となり、米中貿易摩擦再燃への懸念から下落する場面もありましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■先進国株式市況

当期の海外株式市場は上昇しました。

期初以降、米中関係の悪化やグローバルマクロ経済の減速懸念、米金利の逆イールドや米政府閉鎖懸念などを背景に、海外株式市場は大幅に下落しましたが、2019年1月以降は、堅調な企業決算や米中通商協議の進展期待等から上昇基調が継続しました。5月になると米中間の緊張感が高まったことから一時下落する展開となりましたが、6月末の米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことや米国の利下げ期待から海外株式市場は上昇しました。8月になると米国による対中追加関税の発表や中国の報復措置等を受けて再び下落しましたが、10月以降は米中貿易交渉の進展期待や市場予想を上回る決算内容、また、FOMCにおける追加利下げ決定および今後の金利据え置き見通しを背景に上昇する展開となり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■新興国株式市況

当期の新興国株式市場は上昇しました。

期初以降、米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まりなどを背景に下落しましたが、2019年1月に入ると、FRBのハト派姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に上昇基調が継続しました。5月になると中国経済に予想以上の悪化兆候が見られたことを受けて、世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことから新興国株式市場は一時下落しましたが、6月末の米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことや米国の利下げ期待から上昇しました。8月は米中貿易摩擦を巡る緊張の高まりから下落しましたが、10月以降は米中貿易摩擦の緩和期待などを背景に上昇する流れとなり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■Ｊリート市況

当期のＪリート市場は、魅力的な配当利回り水準にあることや良好な不動産賃貸市況を背景とした着実な配当金成長を実現していることに加えて、活発な不動産売買市況を活用した物件入れ替えによる資産価値の顕在化やこれまで以上に収益性に連動した運用報酬体系への移行などのＪリート各社による投資主価値向上を目的とした取り組みが評価され、上昇基調で推移しました。期末付近に米中貿易協議の進展に対する期待の高まりを受けて金利が上昇するとともに株式市場で投資家のリスク選好姿勢が強まったことを背景に、これまで上昇基調を続けていたＪリート市場からの資金流出が生じたため一時的に下落する場面がありましたが、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■先進国リート市況

当期の先進国ＲＥＩＴ市場は米中通商協議の進展期待から上昇して始まりました。

12月に入ると米国における経済指標の後退や政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理が悪化したため2019年1月初めにかけて下落しましたが、その後、4月中旬にかけては米長期金利が低下基調であったことや米企業の1－3月期業績が良好であったことを好感して上昇しました。

期末にかけては米中貿易摩擦の動向により下落する場面もありましたが、欧州中央銀行（ＥＣＢ）による景気刺激策への期待感や良好な米主要株価指標を受けて株式市場が上昇したことから先進国ＲＥＩＴ市場もつられて堅調推移となり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■国内債券市況

当期の10年国債金利は期初以降、世界的な株式市場の下落により安全資産とされる国内債券が買われたことから低下基調となりました。年末年始に世界的な景気減速懸念が高まったことや株価下落の進行を受けて、金利は年明けにマイナス圏まで低下しました。2月末に日銀が国債買い入れオペ（公開市場操作）の実施回数削減を発表したことなどから、金利は3月上旬にかけて上昇する場面がありました。しかし、米連邦公開市場委員会（ＦＯＭＣ）において政策金利の引き上げに対し予想以上に慎重な姿勢が示されたことから海外金利が低下し、国内金利もその影響を受けて再び低下しました。

4月に日銀の超長期国債買い入れオペの減額などから金利は上昇しましたが、5月になると米中貿易摩擦に対する懸念などから低下しました。その後も中国政府が米国に対する報復関税を発表し、米中貿易摩擦の先行き不透明感が再び強まったため、金利はさらに低下しました。9月に入ると米中貿易協議の進展期待から金利は上昇基調となり、当期末にかけては上下しつつもおおむね上昇傾向となりましたが、結局、前期末と比較すると低下して当期末を迎えました。

■先進国債券市況

当期の米国10年国債金利は期初以降、株価の大幅下落等から低下し、その後も投資家のリスク回避姿勢などから低下を続けました。年明け後、リスク回避姿勢がやわらぎ金利は反発上昇しましたが、F R Bによる利上げ休止見通しなどから徐々に低下傾向となりました。5月になると米中貿易摩擦に対する警戒感などを背景に金利は低下し、その後も低下傾向となりました。9月に入り米中通商協議の進展期待などから金利は上昇に転じ、その後はおおむね上昇傾向となりましたが、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、欧州の景気減速懸念や米金利低下などを受けて低下傾向となりました。年明け以降も欧州景気の減速懸念が再燃し米金利が低下したことから低下傾向となり、5月になるとブレグジット（イギリスの欧州連合（E U）離脱）を巡る混迷や欧州中央銀行（E C B）による追加金融緩和観測等からさらに低下を続け、その後も低下傾向となりました。9月以降はE C Bによる金融緩和観測が後退したことや米中通商協議の進展期待などから金利は上昇傾向となりましたが、結局、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、米ドルは対円でおおむね横ばいとなりましたが、12月半ば以降は軟調な中国の経済指標を受けて世界景気の減速懸念が一段と高まったことなどから下落しました。1月になるとF R B議長が金融緩和姿勢に転じたとの見方などから株価が反発し、投資家のリスク回避姿勢がやわらいだことから米ドルは上昇基調となりました。5月に入ると米中貿易摩擦の激化懸念などから下落し、その後は米中通商協議の動向や米利下げへの見方などを背景に上下しました。8月以降は米中通商協議決裂への懸念などから米ドルは下落しましたが、その後は協議の進展期待などを背景に上昇基調となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、ユーロは対円で横ばい推移した後、12月半ば以降は世界的な株価下落を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから下落しました。1月以降は株価の反発などによりユーロは上昇に転じ、その後はおおむね上昇傾向となりました。5月になると世界の景気減速懸念やブレグジットを巡る混迷、E C Bによる追加金融緩和観測等からユーロは下落傾向となりましたが、9月以降はハードブレグジット（イギリスのE Uからの強硬離脱）リスクの後退やE C Bの金融緩和観測の後退などからユーロはおおむね上昇傾向となりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる7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、リート（不動産投資信託）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。

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークであるM S C I エマージング・マーケット・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J－R E I Tインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T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。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークであるS & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、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。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

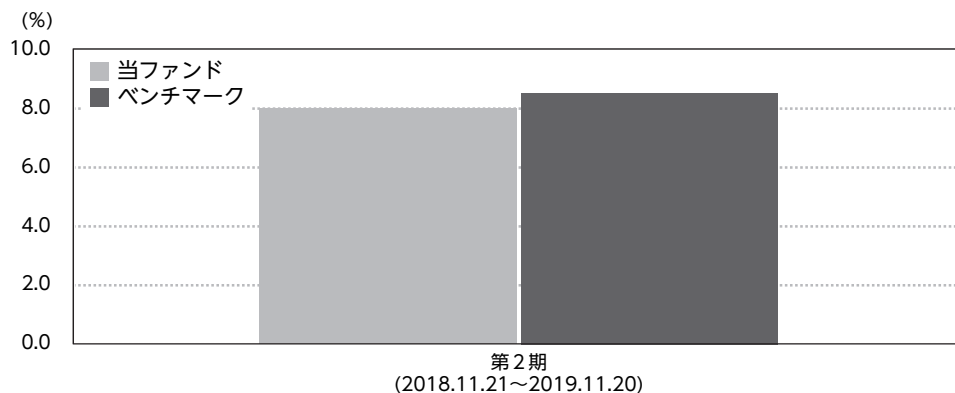
国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるN O M U R A－B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<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+8.0%となり、ベンチマーク騰落率（+8.5%）におおむね連動しました。

（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 2018年11月21日~2019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	701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7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、リート（不動産投資信託）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。

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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J-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリート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。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート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。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

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2期末 2019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	10.1%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	10.3
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	10.2
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド	9.9
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	9.9
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	24.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	24.8

（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

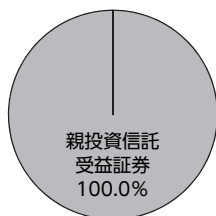
（注2）組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

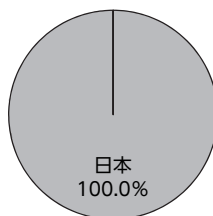
項目	第2期末 2019年11月20日
純資産総額	18,417,924円
受益権総口数	17,211,111口
1万口当たり基準価額	10,701円

（注）当期間中における追加設定元本額は10,576,235円、同解約元本額は3,849,753円です。

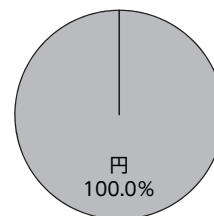
■資産別配分



■国別配分



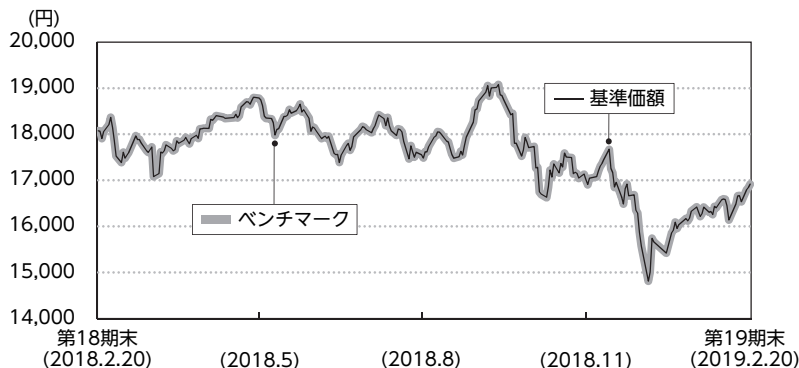
■通貨別配分



（注）資産別・国別・通貨別配分は、2019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T O P I X (東証株価指数) (配当込み) としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお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 (東証株価指数) の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。

■上位銘柄

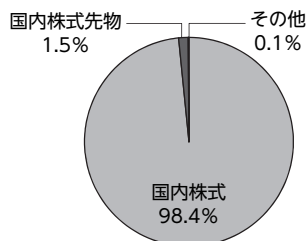
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.2%
ソフトバンクグループ	円	1.8
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
ソニー	円	1.5
日本電信電話	円	1.3
キーエンス	円	1.3
武田薬品工業	円	1.2
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.2
本田技研工業	円	1.1
みずほフィナンシャルグループ	円	1.0
組入銘柄数		1,840

■1万口当たりの費用明細

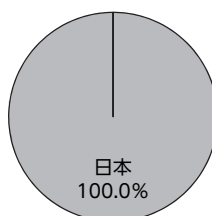
2018.2.21～2019.2.20

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

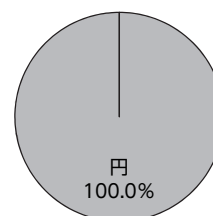
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



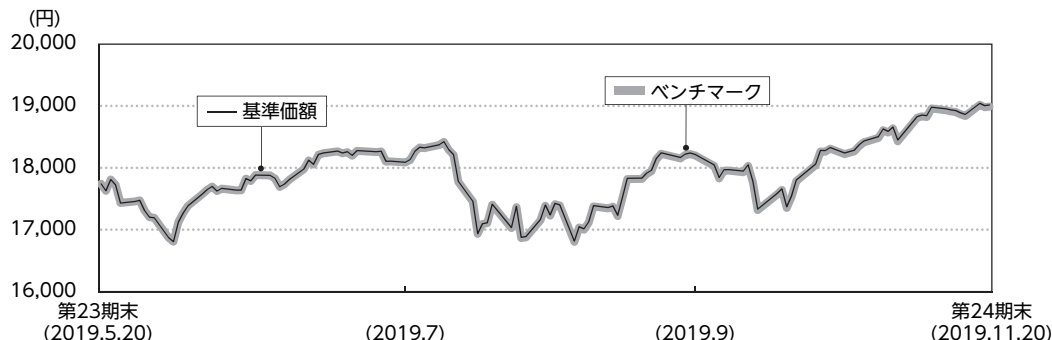
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2019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

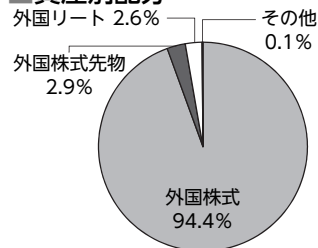
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	3.0%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.7
AMAZON.COM INC	米ドル	1.8
FACEBOOK INC-A	米ドル	1.2
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.0
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.0
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8
VISA INC-CLASS A SHARES	米ドル	0.8
組入銘柄数		1,318

■ 1万口当たりの費用明細

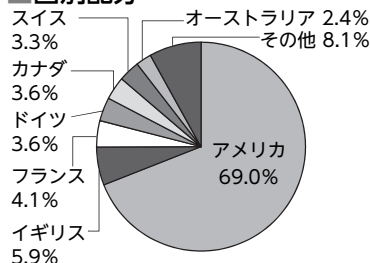
2019.5.21～2019.11.20

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

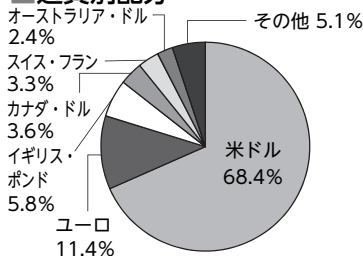
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



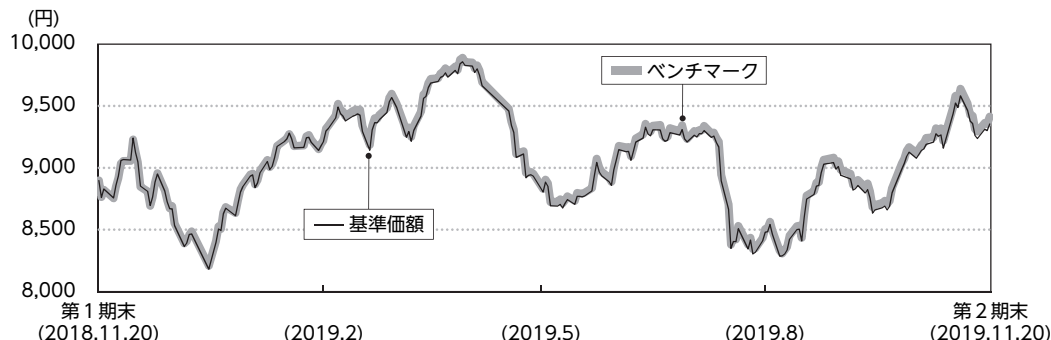
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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(2019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。

ニッセイ新興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

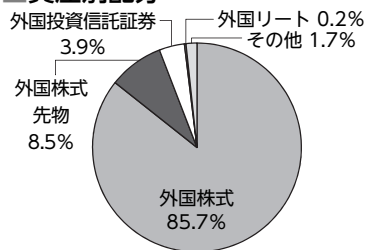
銘柄名	通貨	比率
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	米ドル	4.2%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	4.0%
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	3.9%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.5%
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	2.3%
NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ・ランド	1.5%
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	香港ドル	1.3%
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	香港ドル	1.0%
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	インド・ルピー	1.0%
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	米ドル	1.0%
組入銘柄数	927	

■ 1万口当たりの費用明細

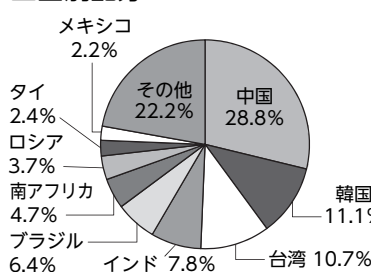
2018.11.21～2019.11.20

項目	金額
売買委託手数料	6円
(株式)	(4)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	37
(保管費用)	(31)
(その他)	(6)
合計	44

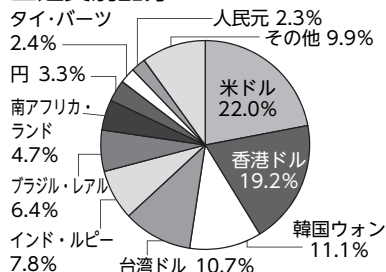
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



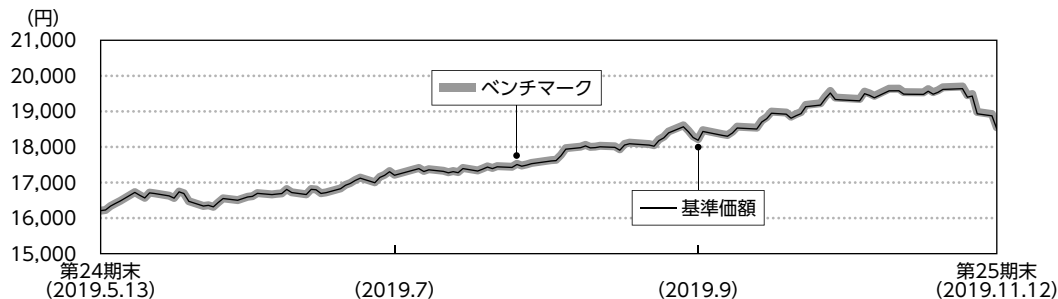
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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(2019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Ｊ－ＲＥＩＴ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

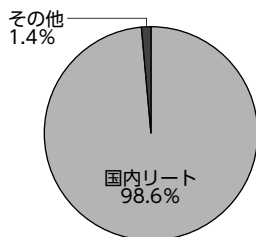
銘柄名	通貨	比率
日本ビルファンド投資法人	円	6.9%
ジャパンリアルエステイト投資法人	円	6.4
野村不動産マスターファンド投資法人	円	5.4
ユナイテッド・アーバン投資法人	円	4.3
オリックス不動産投資法人	円	4.2
日本リテールファンド投資法人	円	4.2
日本プロロジスリート投資法人	円	3.8
大和ハウスリート投資法人	円	3.6
G L P 投資法人	円	3.0
アドバンス・レジデンス投資法人	円	2.9
組入銘柄数		63

■1万口当たりの費用明細

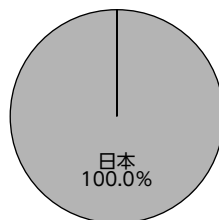
2019.5.14～2019.11.12

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

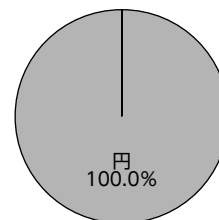
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



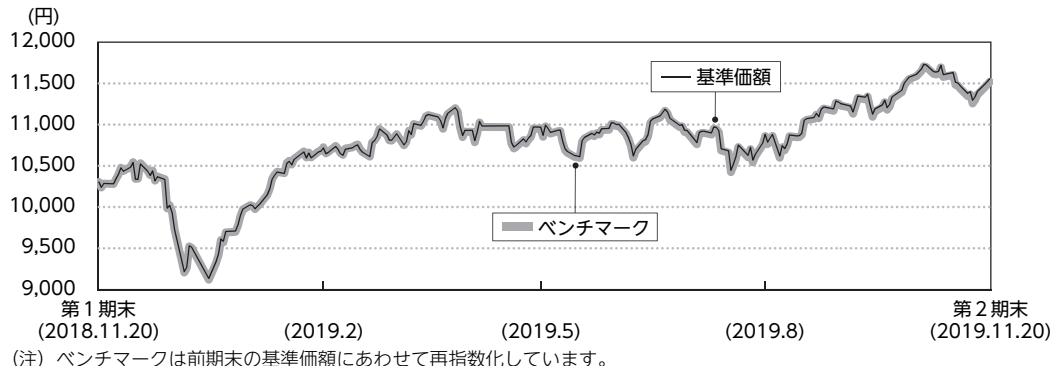
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2019年11月12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。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

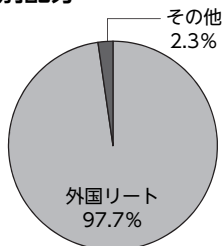
銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	米ドル	4.3%
EQUINIX INC	米ドル	3.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	3.4
WELLTOWER INC	米ドル	2.6
PUBLIC STORAGE	米ドル	2.3
EQUITY RESIDENTIAL	米ドル	2.3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	米ドル	2.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	米ドル	1.9
REALTY INCOME CORP	米ドル	1.8
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	ユーロ	1.7
組入銘柄数		284

■ 1万口当たりの費用明細

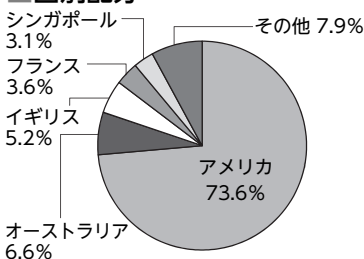
2018.11.21~2019.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	4円 (0)
(投資信託証券)	(4)
有価証券取引税 (株式)	1 (0)
(投資信託証券)	(1)
その他費用 (保管費用)	8 (7)
(その他)	(1)
合計	13

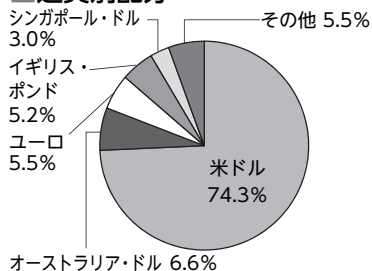
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



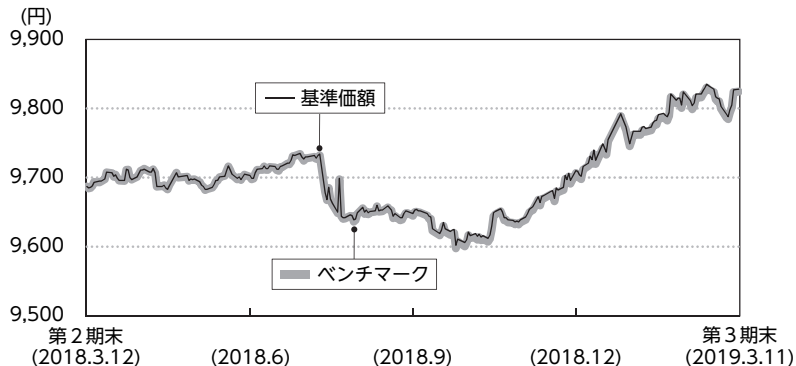
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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(2019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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

■基準価額の推移



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

■上位銘柄

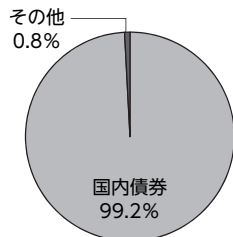
銘柄名	通貨	比率
第133回 住宅金融支援機構債券	円	1.1%
第350回 利付国債 (10年)	円	1.0
第344回 利付国債 (10年)	円	1.0
第347回 利付国債 (10年)	円	1.0
第349回 利付国債 (10年)	円	1.0
第340回 利付国債 (10年)	円	1.0
第343回 利付国債 (10年)	円	1.0
第342回 利付国債 (10年)	円	1.0
第312回 利付国債 (10年)	円	1.0
第341回 利付国債 (10年)	円	1.0
組入銘柄数		364

■1万口当たりの費用明細

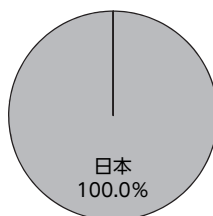
2018.3.13~2019.3.11

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

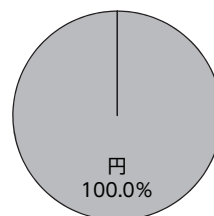
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



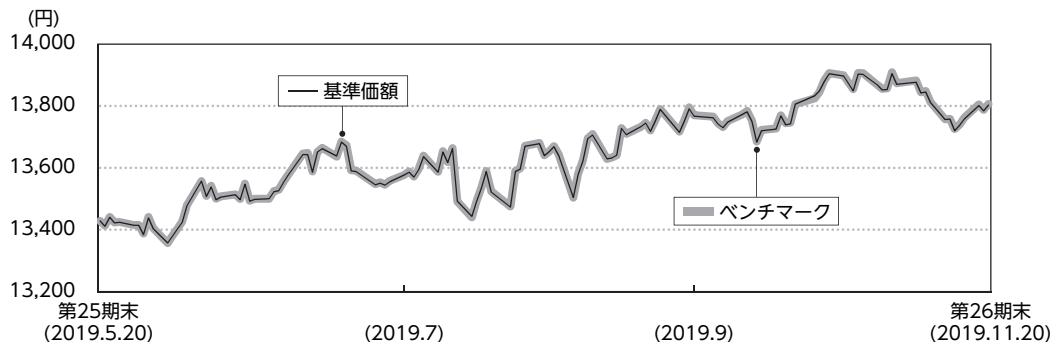
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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 (2019年3月11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

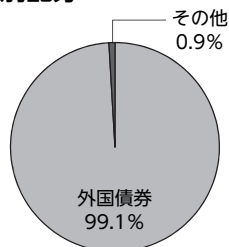
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.375% 2021/1/31	米ドル	0.9
US TREASURY 2.625% 2020/11/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.125% 2021/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.0% 2021/11/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.75% 2023/11/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.75% 2024/2/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.8
組入銘柄数		606

■ 1万口当たりの費用明細

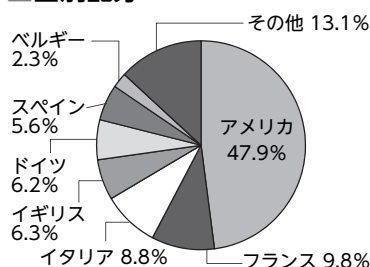
2019.5.21～2019.11.20

項目	金額
その他費用 (保管費用) (その他)	2円 (2) (0)
合計	2

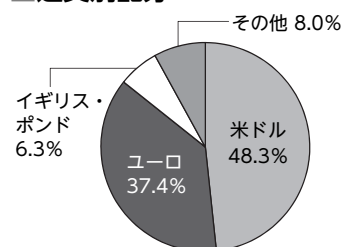
■ 資産別配分



■ 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(2019年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額＋ 累計分配金	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2017年11月17日	10,000	－	－	10,000	10,000	－	－	－	－	－	1
1期(2018年11月20日)	9,908	0	△0.9	9,908	9,963	△0.4	27.7	1.5	49.5	20.5	10
2期(2019年11月20日)	10,701	0	8.0	10,701	10,814	8.5	28.3	1.4	49.1	20.2	18

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 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6) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注7) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2018年11月20日	9,908	－	9,963	－	27.7	1.5	49.5	20.5
11月末	10,025	1.2	10,083	1.2	27.9	1.5	49.2	20.5
12月末	9,646	△2.6	9,703	△2.6	26.5	1.2	51.1	19.8
2019年1月末	9,942	0.3	10,011	0.5	28.9	1.6	47.6	21.0
2月末	10,131	2.3	10,206	2.4	28.1	1.8	49.1	20.1
3月末	10,245	3.4	10,325	3.6	27.6	1.4	49.7	20.5
4月末	10,317	4.1	10,401	4.4	28.2	1.5	49.2	20.0
5月末	10,067	1.6	10,147	1.8	26.4	1.4	50.7	20.7
6月末	10,244	3.4	10,332	3.7	28.4	1.6	49.0	20.1
7月末	10,358	4.5	10,453	4.9	27.6	1.7	49.5	20.4
8月末	10,265	3.6	10,359	4.0	27.1	1.2	50.0	20.8
9月末	10,473	5.7	10,577	6.2	28.5	1.6	48.4	20.7
10月末	10,704	8.0	10,815	8.6	28.8	1.6	48.4	20.4
(期末)2019年11月20日	10,701	8.0	10,814	8.5	28.3	1.4	49.1	20.2

(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

2018年11月21日～2019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	770	1,288	342	581
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	761	1,332	368	660
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,500	1,348	671	616
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	647	1,104	411	705
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	1,122	1,211	561	612
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	3,317	3,289	1,414	1,401
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,216	3,002	864	1,170

(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	ニッセイ 新興国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 先進国リート インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	16,099,583千円	46,149,416千円	394,911千円	16千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	57,945,432千円	164,761,245千円	1,653,956千円	16千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.27	0.28	0.23	0.99

(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

2018年11月21日～2019年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2019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	598	1,026	1,863
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	602	995	1,892
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,176	2,005	1,875
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	702	938	1,819
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	1,023	1,584	1,830
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,688	4,591	4,564
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,959	3,312	4,571

(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37,206,074千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが110,982,930千口、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドが2,309,692千口、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンドが16,398,065千口、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドが2,138,126千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが80,458,265千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが18,019,497千口です。

投資信託財産の構成

2019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	1,863	10.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,892	10.2
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,875	10.1
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	1,819	9.8
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	1,830	9.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4,564	24.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4,571	24.7
コール・ローン等、その他	75	0.4
投資信託財産総額	18,493	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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1台湾ドル3.56円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シェケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1トルコ・リラ19.03円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1メキシコ・ペソ5.61円、1フィリピン・ペソ2.13円、100チリ・ペソ13.79円、100コロンビア・ペソ3.16円、1インド・ルピー1.52円、100インドネシア・ルピア0.77円、1ブラジル・レアル25.86円、1チェコ・コルナ4.71円、100韓国ウォン9.29円、1人民元15.44円、1マレーシア・リンギット26.10円、1南アフリカ・ランド7.35円、1タイ・バーツ3.58円、1ポーランド・ズロチ28.01円、100ハンガリー・フォリント36.15円、1ユーロ120.32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(207,877,451千円)の投資信託財産総額(212,007,217千円)に対する比率は98.1%です。
ニッセイ新興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(2,088,262千円)の投資信託財産総額(2,175,258千円)に対する比率は96.0%です。
ニッセイ先進国リート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(2,428,992千円)の投資信託財産総額(2,527,803千円)に対する比率は96.1%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(24,831,126千円)の投資信託財産総額(24,990,767千円)に対する比率は99.4%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

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	18,493,384円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	26,631
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,863,440
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,892,200
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,875,668
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド(評価額)	1,819,144
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド(評価額)	1,830,736
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	4,564,932
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,571,987
未 収 入 金	48,646
(B)負債	75,460
未 払 解 約 金	47,385
未 払 信 託 報 酬	27,309
そ の 他 未 払 費 用	766
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	18,417,924
元 本	17,211,111
次 期 繰 越 損 益 金	1,206,813
(D)受 益 権 総 口 数	17,211,111口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,701円

(注) 期首元本額	10,484,629円
期中追加設定元本額	10,576,235円
期中一部解約元本額	3,849,753円

損益の状況

当期 (2018年11月21日～2019年11月20日)

項目	当期
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	1,075,389円
売 買 益	1,198,634
売 買 損	△ 123,245
(B)信 託 報 酬 等	△ 48,696
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	1,026,693
(D)前 期 繰 越 損 益 金	△ 135,172
(繰 越 欠 損 金)	(△ 135,172)
(E)追 加 信 託 差 損 益 金 *	315,292
(売 買 損 益 相 当 額)	(315,292)
(F)合 計 (C+D+E)	1,206,813
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	1,206,813
追 加 信 託 差 損 益 金	315,292
(売 買 損 益 相 当 額)	(315,292)
分 配 準 備 積 立 金	891,521

- (注1) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (B)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
- (注3) (D)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) (E)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	891,521円
(c) 信託約款に定める収益調整金	315,292円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額（a + b + c + d）	1,206,813円
(f) 分配対象額（1万口当たり）	701.18円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金（1万口当たり）	0円

お知らせ

■自社による当ファンドの設定解約状況

当期における自社による当ファンドの設定解約はありません。なお当期末現在、自社による当ファンドの保有残高は1百万円（元本1百万円、ファンド全体の5.8%）です。当社は当該保有分を解約することがあります。

■自社および関連会社の実質保有比率

2019年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、当社は、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以下（※1）の通り保有しています。

また、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以下（※2）の通り保有しています。

当該実質保有分は、当社および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。

（※1）当社による他のベビーファンドを通じた主要投資対象マザーファンド受益証券の実質保有比率

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた 実質保有比率（%）
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	35.1

（注）実質保有比率が5%超のマザーファンドを記載しています。

（※2）日本生命保険相互会社による他のベビーファンドを通じた主要投資対象マザーファンド受益証券の実質保有比率

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた 実質保有比率（%）
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10.4
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	87.9

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	無期限
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、リート（不動産投資信託）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	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券)			「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」「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド」「ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「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
	ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド			新興国の株式等（ＤＲ（預託証券）を含みます）
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴ インデックスマザーファンド			国内の金融商品取引所に上場しているＪリート
	ニッセイ先進国リート インデックスマザーファンド			各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド			国内の公社債
	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

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）

運用方法	ニッセイ・インデックスパッケージ （内外・株式／リート／債券）	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の通りとします。 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド…10% ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド…10% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド…25% ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド…25%
	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。
	ニッセイ新興国株式 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Ｊ－ＲＥＩＴ 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。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ先進国リート 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。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%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。
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	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 19 期

(計算期間：2018年2月21日～2019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。



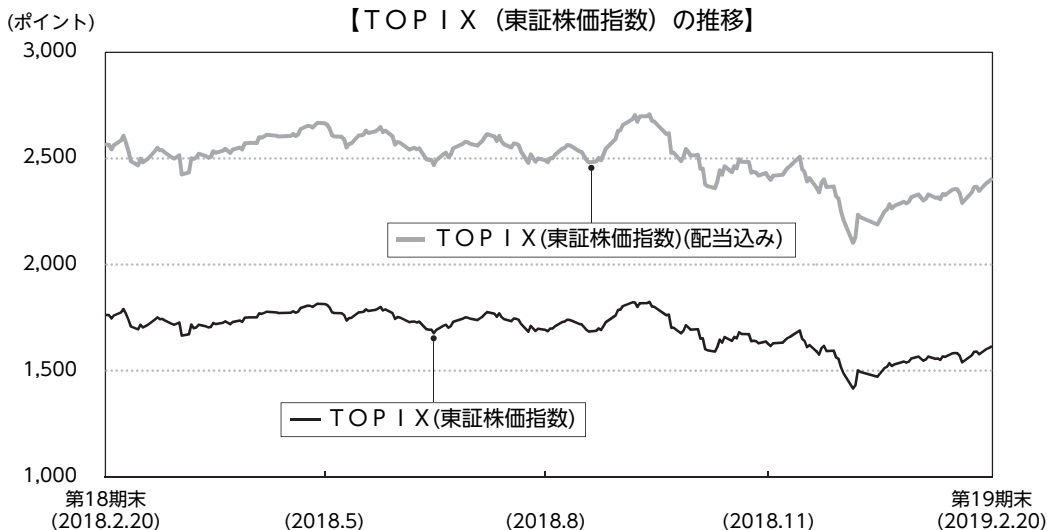
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年2月21日～2019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。

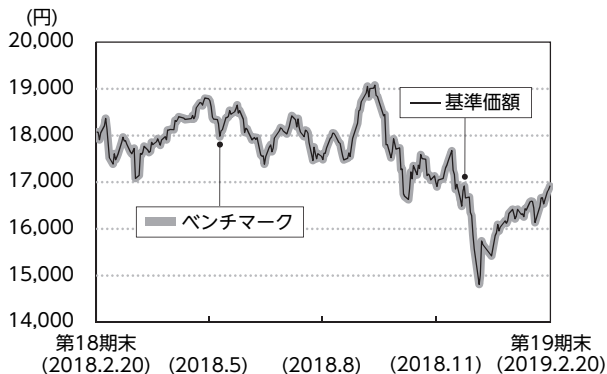
当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、米国における政権運営や保護主義政策に対する先行き不透明感の強まりなどから、国内株式市場は下落基調で推移しました。

4月に入り、米中貿易摩擦への警戒感がやわらいだことや、シリアや北朝鮮に対する地政学リスク懸念の後退もあり、国内株式市場は上昇しましたが、5月下旬になると、米国の保護主義政策やイタリアの政局混迷などから下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国不安等を背景に国内株式市場は上下する展開となりましたが、9月になると同貿易摩擦への警戒感が一服し、為替市場における円安進行などもあったことから、国内株式市場は上昇しました。

しかし10月以降は、米株急落を受けた世界同時株安や消費増税に対する懸念等、景気の先行き不透明感などを背景に国内株式市場は下落に転じ、12月になると、世界景気の減速懸念が強まったことからさらに下落しました。年明け以降は、米中関係好転への期待などから国内株式市場は上昇しましたが、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



世界景気の減速懸念が強まったことからさらに下落しました。年明け以降は、米中関係好転への期待などによる株価の上昇を受けて基準価額も上昇しましたが、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

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

■基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、米国の保護主義政策に対する懸念などを背景とした株価下落を受けて下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国不安などにより基準価額は上下する展開となりました。9月になると、同貿易摩擦に対する警戒感の一服や為替市場における円安進行等もあり、株価が上昇したことから基準価額は上昇しました。

しかし10月以降は、米株の急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念等、景気の先行き不透明感などを背景に基準価額は下落に転じ、12月になると、

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	%		%	%	%	百万円
15期(2015年 2月20日)	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3	42,826
16期(2016年 2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年 2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998
18期(2018年 2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868
19期(2019年 2月20日)	16,916	△ 6.4	17,088	△ 6.4	98.4	1.5	58,316

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

(注 2) 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)2018年 2月20日	18,076	—	18,261	—	98.2	1.9
2 月末	18,140	0.4	18,326	0.4	97.6	2.4
3 月末	17,769	△ 1.7	17,951	△ 1.7	97.0	3.0
4 月末	18,403	1.8	18,589	1.8	97.4	2.5
5 月末	18,102	0.1	18,278	0.1	96.0	3.9
6 月末	17,953	△ 0.7	18,140	△ 0.7	97.1	3.1
7 月末	18,185	0.6	18,376	0.6	98.4	1.8
8 月末	18,005	△ 0.4	18,193	△ 0.4	96.8	3.2
9 月末	19,007	5.2	19,203	5.2	98.1	1.8
10月末	17,222	△ 4.7	17,395	△ 4.7	96.8	3.1
11月末	17,449	△ 3.5	17,621	△ 3.5	96.6	3.4
12月末	15,663	△13.3	15,822	△13.4	97.7	2.3
2019年 1 月末	16,433	△ 9.1	16,601	△ 9.1	98.3	1.7
(期末)2019年 2月20日	16,916	△ 6.4	17,088	△ 6.4	98.4	1.5

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2018年2月21日～2019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)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	1	0.003	

(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（17,601円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年2月21日～2019年2月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		7,166 (△1,277)	13,709,968	1,003	1,677,661

(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	百万円	百万円	百万円
		20,510	20,478	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年2月21日～2019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
トヨタ自動車	55	382,948	6,962	トヨタ自動車	18	118,422	6,436
武田薬品工業	84	381,949	4,504	ソフトバンクグループ	6	51,652	8,467
ソフトバンク	194	268,384	1,382	三井住友フィナンシャルグループ	8	36,528	4,198
三菱UFJフィナンシャル・グループ	337	216,038	639	ブリヂストン	7	33,165	4,422
ソニー	35	202,735	5,726	ファーストリテイリング	0.700	32,937	47,052
ソフトバンクグループ	20	182,227	9,021	本田技研工業	9	27,688	3,009
日本電信電話	32	158,267	4,899	日本たばこ産業	8	26,413	3,107
キーエンス	2	154,275	59,336	リクルートホールディングス	9	24,653	2,709
三井住友フィナンシャルグループ	33	144,508	4,262	エヌ・ティ・ティ都市開発	14	24,528	1,680
本田技研工業	40	134,481	3,288	日本電信電話	4	22,559	4,799

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

組入有望証券明細表

2019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	0.900	1	3,289
日本水産	25	33	24,611
マルハニチロ	4	4	18,130
カネコ種苗	0.900	1	1,593
サカタのタネ	3	4	15,272
ホクト	2	2	5,451
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	7	6	646
日鉄鉱業	0.600	0.800	3,644
三井松島ホールディングス	1	1	2,165
国際石油開発帝石	107	135	155,262
日本海洋掘削	0.800	—	—
石油資源開発	3	4	11,363
K&Oエナジーグループ	1	1	2,433

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
建設業(2.9%)			
ヒノキヤグループ	—	0.800	1,841
ショーボンドホールディングス	2	2	18,984
ミライト・ホールディングス	6	9	16,074
タマホーム	1	1	1,806
ファーストコーポレーション	—	2	1,472
ベステラ	0.800	—	—
TATERU	1	—	—
スペースバリューホールディングス	—	4	3,620
ダイセキ環境ソリューション	1	0.500	319
安藤・間	17	21	16,567
東急建設	8	9	9,652
コムシスホールディングス	7	12	35,136
ミサワホーム	1	2	1,989
高松コンストラクショングループ	1	2	5,672

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
東建コーポレーション	0.800	1	6,720
ソネック	1	2	1,503
ヤマウラ	1	1	1,471
大成建設	22	27	139,834
大林組	66	83	88,783
清水建設	67	85	80,608
飛島建設	20	2	3,564
長谷工コーポレーション	25	34	47,010
松井建設	2	3	2,284
銭高組	0.300	0.300	1,599
鹿島建設	98	65	104,247
不動テトラ	16	1	3,009
大末建設	0.700	1	1,502
鉄建建設	1	1	4,601
西松建設	5	6	15,048
三井住友建設	16	20	14,070
大豊建設	8	1	5,909
前田建設工業	15	19	23,064
佐田建設	2	3	1,391
ナカノフドー建設	2	3	1,542
奥村組	3	4	15,663
東鉄工業	2	3	10,032
浅沼組	8	1	2,661
戸田建設	26	32	22,874
熊谷組	3	4	13,060
青木あすなろ建設	1	1	1,546
北野建設	5	0.600	1,848
植木組	0.500	0.700	1,643
三井ホーム	3	—	—
矢作建設工業	3	3	2,865
ピーエス三菱	2	2	1,812
日本ハウスホールディングス	4	5	2,316
大東建託	8	9	155,281
新日本建設	2	3	3,237
N I P P O	5	7	15,599
東亜道路工業	0.400	0.500	1,540
前田道路	7	8	18,513
日本道路	0.600	0.800	5,248
東亜建設工業	1	2	3,885
若築建設	1	1	2,095
東洋建設	7	10	4,273

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
五洋建設	26	33	18,060
世紀東急工業	3	4	2,595
福田組	0.700	0.900	3,901
住友林業	14	19	28,393
日本基礎技術	3	4	1,591
日成ビルド工業	3	—	—
巴コーポレーション	2	3	1,417
大和ハウス工業	65	77	261,630
ライト工業	4	5	8,154
積水ハウス	72	85	138,988
日特建設	2	2	1,466
北陸電気工事	1	1	1,500
ユアテック	3	4	3,987
四電工	0.500	0.600	1,614
中電工	2	3	8,406
関電工	8	12	13,220
きんでん	14	18	33,503
東京エネシス	2	2	2,830
トーエネック	0.600	0.800	2,592
住友電設	1	1	3,528
日本電設工業	3	4	11,107
協和エクシオ	8	10	31,806
新日本空調	1	2	4,363
N D S	0.300	—	—
九電工	4	5	21,175
三機工業	4	6	7,478
日揮	19	24	40,824
中外炉工業	0.700	0.800	1,417
ヤマト	1	3	1,419
太平電業	1	1	4,837
高砂熱学工業	6	7	12,600
三晃金属工業	0.300	0.500	1,490
朝日工業社	0.500	0.600	1,764
明星工業	4	5	3,670
大気社	2	3	12,141
ダイダン	1	1	4,772
日比谷総合設備	2	2	5,046
東芝プラントシステム	4	6	12,330
〇 S J Bホールディングス	9	12	3,444
東洋エンジニアリング	2	3	2,537
千代田化工建設	14	20	6,210

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
新興プラントック	4	5	6,195
食料品(4.3%)			
日本製粉	6	8	15,869
日清製粉グループ本社	24	28	66,890
昭和産業	1	2	6,969
鳥越製粉	1	2	1,727
中部飼料	2	3	3,261
フィード・ワン	13	16	3,040
東洋精糖	1	1	1,432
日本甜菜製糖	1	1	2,555
三井製糖	1	2	5,758
塩水港精糖	5	6	1,507
日新製糖	0.900	1	2,482
森永製菓	4	6	31,122
中村屋	0.500	0.600	2,553
江崎グリコ	5	7	42,450
名糖産業	1	1	1,694
井村屋グループ	0.800	1	2,763
不二家	1	1	3,152
山崎製パン	16	20	39,127
モロゾフ	0.300	0.400	2,012
亀田製菓	1	1	8,352
寿スピリッツ	1	2	11,375
カルビー	9	11	35,340
森永乳業	4	5	17,275
六甲バター	1	1	3,587
ヤクルト本社	11	18	137,270
明治ホールディングス	13	17	154,521
雪印メグミルク	4	6	16,302
プリマハム	14	3	7,563
日本ハム	17	10	46,170
丸大食品	11	2	5,213
S Foods	1	2	9,097
伊藤ハム米久ホールディングス	12	16	10,770
サッポロホールディングス	7	9	22,349
アサヒグループホールディングス	41	52	252,556
キリンホールディングス	95	113	292,218
宝ホールディングス	14	18	23,244
オエノンホールディングス	5	7	2,712
養命酒製造	0.600	0.800	1,686
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14	19	57,032

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サントリー食品インターナショナル	15	16	83,333
ダイドーグループホールディングス	1	1	7,602
伊藤園	6	7	39,140
キーコーヒー	2	2	5,115
日清オイリオグループ	2	3	10,880
不二製油グループ本社	5	6	23,942
かどや製油	0.200	0.300	1,512
J-オイルミルズ	1	1	5,271
キッコーマン	15	16	92,235
味の素	45	55	92,294
キューピー	11	13	35,639
ハウス食品グループ本社	7	9	42,180
カゴメ	8	10	29,630
焼津水産化学工業	1	—	—
アリアケジャパン	1	2	13,547
ピエトロ	0.800	0.900	1,476
エバラ食品工業	0.700	0.700	1,485
ニチレイ	9	13	35,945
東洋水産	10	12	54,051
イートアンド	—	0.900	1,524
大冷	—	0.900	1,565
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	3	1,872
日清食品ホールディングス	8	10	82,044
永谷園ホールディングス	2	1	3,120
一正蒲鉾	1	—	—
フジッコ	2	2	6,231
ロック・フィールド	2	2	4,363
日本たばこ産業	123	144	407,936
ケンコーマヨネーズ	1	1	3,103
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,180
なとり	1	1	2,367
ビックスコーポレーション	0.800	0.700	1,325
北の達人コーポレーション	5	9	4,331
ユーグレナ	7	10	6,943
ミヨシ油脂	1	1	1,491
理研ビタミン	0.800	1	4,326
繊維製品(0.6%)			
片倉工業	2	3	3,699
グンゼ	1	1	8,128
東洋紡	7	10	16,778
ユニチカ	6	7	3,528

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
富士紡ホールディングス	1	1	3,727
倉敷紡績	21	2	5,175
シキボウ	1	1	1,446
日本毛織	5	8	7,000
ダイドーリミテッド	3	—	—
帝国繊維	2	2	6,679
帝人	17	19	37,193
東レ	150	189	148,651
サカイオーベックス	0.500	0.800	1,461
住江織物	0.500	0.700	1,853
日本フェルト	2	3	1,511
イチカワ	4	1	1,542
アツギ	1	2	1,920
セーレン	4	6	11,460
ソトー	1	1	1,468
東海染工	0.900	1	1,560
小松マテーレ	3	4	3,264
ワコールホールディングス	5	7	19,865
ホギメディカル	1	3	11,671
クラウドディアホールディングス	2	3	1,466
T S I ホールディングス	7	9	6,273
マツオカコーポレーション	0.400	0.800	2,696
ワールド	—	2	4,864
三陽商会	1	1	2,514
オンワードホールディングス	12	14	9,738
ゴールドウイン	0.600	2	30,118
デサント	4	5	14,224
キング	0.100	—	—
ヤマトインターナショナル	2	3	1,498
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	1	1	6,392
王子ホールディングス	87	109	72,687
日本製紙	9	11	23,996
三菱製紙	3	4	2,276
北越コーポレーション	11	16	10,319
中越パルプ工業	0.800	—	—
大王製紙	8	11	15,553
阿波製紙	2	3	1,444
レンゴー	20	25	23,158
トーモク	1	1	2,470
ザ・パックス	1	1	6,146

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
化学(7.3%)			
クラレ	34	41	63,129
旭化成	129	173	210,420
共和レザー	1	1	1,483
昭和電工	13	16	63,504
住友化学	153	191	108,039
住友精化	0.900	1	5,274
日産化学	12	15	86,250
ラサ工業	0.700	1	1,684
クレハ	1	2	15,893
多木化学	0.300	0.700	3,941
ティカ	1	2	4,274
石原産業	3	4	5,724
片倉コープアグリ	1	1	1,484
日東エフシー	0.100	2	1,548
日本曹達	14	3	11,263
東ソー	30	37	62,657
トクヤマ	6	7	19,880
セントラル硝子	4	5	13,573
東亜合成	12	15	19,293
大阪ソーダ	1	2	7,217
関東電化工業	5	5	5,162
デンカ	7	9	32,976
信越化学工業	34	43	412,628
日本カーバイド工業	0.700	0.900	1,373
堺化学工業	1	1	3,907
第一稀元素化学工業	—	2	1,814
エア・ウォーター	17	20	36,640
太陽日酸	16	20	31,717
日本化学工業	0.800	0.800	1,897
日本パーカライジング	10	13	19,431
高圧ガス工業	3	3	3,139
四国化成工業	3	4	5,362
戸田工業	0.400	0.700	1,577
ステラ ケミファ	1	1	4,417
保土谷化学工業	0.700	0.800	2,225
日本触媒	3	4	31,160
大日精化工業	1	2	6,340
カネカ	28	6	29,087
三菱瓦斯化学	17	25	44,979
三井化学	18	22	62,786

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
J S R	20	24	45,080
東京応化工業	3	4	14,364
大阪有機化学工業	1	2	2,792
三菱ケミカルホールディングス	139	163	135,974
K Hネオケム	3	3	11,026
ダイセル	28	37	43,547
住友ベークライト	17	4	18,312
積水化学工業	43	53	93,221
日本ゼオン	17	22	25,564
アイカ工業	5	7	28,178
宇部興産	10	12	31,672
積水樹脂	3	4	8,492
タキロンシーアイ	4	5	3,211
旭有機材	1	1	2,883
日立化成	10	11	23,458
ニチバン	1	1	2,915
リケンテクノス	4	6	3,154
大倉工業	5	1	2,122
積水化成成品工業	2	3	3,484
群栄化学工業	0.500	0.600	1,663
タイガースポリマー	—	2	1,542
ミライアル	0.700	1	1,549
ダイキョーニシカワ	4	5	6,461
竹本容器	—	1	1,452
森六ホールディングス	0.800	1	3,333
日本化薬	13	15	20,181
カーリットホールディングス	1	2	2,176
日本精化	1	2	2,430
扶桑化学工業	1	2	5,442
トリケミカル研究所	—	0.500	2,515
A D E K A	8	12	20,724
日油	8	9	35,955
新日本理化	5	7	1,432
ハリマ化成グループ	1	2	2,174
花王	48	60	503,011
第一工業製薬	4	0.900	2,781
石原ケミカル	—	0.900	1,660
日華化学	—	0.900	852
ニイタカ	0.500	1	1,483
三洋化成工業	1	1	8,800
有機合成薬品工業	4	6	1,352

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大日本塗料	2	2	3,236
日本ペイントホールディングス	16	20	83,415
関西ペイント	21	27	58,142
中国塗料	5	8	8,048
日本特殊塗料	1	1	2,453
藤倉化成	2	3	2,036
太陽ホールディングス	1	2	7,490
D I C	8	11	39,105
サカティンクス	4	5	6,545
東洋インキSCホールディングス	21	5	13,759
T & K T O K A	1	1	1,976
富士フイルムホールディングス	41	51	260,309
資生堂	36	49	357,142
ライオン	27	34	77,415
高砂香料工業	1	1	6,222
マンダム	3	5	15,545
ミルボン	2	3	15,298
ファンケル	4	11	27,949
コーセー	3	4	76,440
コタ	0.900	1	1,806
シーズ・ホールディングス	2	—	—
シーボン	0.400	0.600	1,602
ポーラ・オルビスホールディングス	8	10	33,496
ノエビアホールディングス	1	1	8,560
アジバンコスメジャパン	1	1	1,468
エステー	1	1	3,456
アグロ カネショウ	0.800	1	2,086
コニシ	3	4	7,466
長谷川香料	2	3	5,199
星光PMC	1	1	1,565
小林製薬	5	7	62,510
荒川化学工業	1	2	3,110
メック	1	1	1,963
日本高純度化学	0.600	0.700	1,665
タカラバイオ	5	6	15,398
J C U	1	3	5,987
新田ゼラチン	—	2	1,575
デクセリアルズ	5	6	5,216
アース製薬	1	1	9,490
北興化学工業	2	2	1,482
大成ラミック	0.600	0.800	2,299

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クミアイ化学工業	9	10	7,333
日本農薬	5	6	2,958
アキレス	1	1	3,688
有沢製作所	3	3	3,182
日東電工	15	18	113,946
レック	1	2	4,446
藤森工業	1	2	6,809
前澤化成工業	1	1	1,705
未来工業	—	1	3,129
J S P	1	1	3,687
エフピコ	1	2	13,755
天馬	1	1	3,447
信越ポリマー	4	4	3,757
東リ	4	6	1,689
ニフコ	3	10	27,890
バルカー	1	2	4,612
ユニ・チャーム	42	52	186,912
医薬品(5.4%)			
協和発酵キリン	24	31	66,924
武田薬品工業	73	157	708,837
アステラス製薬	203	229	391,756
大日本住友製薬	14	18	51,300
塩野義製薬	28	32	228,069
田辺三菱製薬	24	26	41,730
わかもと製薬	5	5	1,478
あすか製薬	2	3	3,744
日本新薬	5	6	44,460
ビオフェルミン製薬	0.500	—	—
中外製薬	20	26	190,060
科研製薬	3	4	23,805
エーザイ	23	29	265,488
ロート製薬	10	12	38,528
小野薬品工業	46	58	134,093
久光製薬	5	7	41,218
持田製薬	1	1	21,831
参天製薬	37	47	74,056
扶桑薬品工業	0.700	0.900	2,317
ツムラ	7	7	27,296
日医工	5	6	10,195
キッセイ薬品工業	3	4	12,848
生化学工業	3	4	6,585

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
栄研化学	1	4	11,308
日水製薬	—	1	1,301
鳥居薬品	1	1	3,038
J C R ファーマ	1	1	10,260
東和薬品	1	1	10,560
富士製薬工業	0.700	1	3,134
沢井製薬	4	5	30,651
ゼリア新薬工業	4	4	9,305
第一三共	56	71	277,964
キョーリン製薬ホールディングス	5	5	12,347
大幸薬品	1	1	2,018
ダイト	1	1	4,252
大塚ホールディングス	41	47	214,864
大正製薬ホールディングス	4	5	63,504
ペプチドリーム	8	12	62,744
石油・石炭製品(0.7%)			
日本コークス工業	16	21	2,121
昭和シェル石油	18	23	40,319
ニチレキ	2	3	3,616
ユシロ化学工業	1	1	1,708
ビーピー・カストロール	0.800	1	1,635
富士石油	4	6	1,752
M O R E S C O	0.700	0.700	1,132
出光興産	16	19	80,288
J X T Gホールディングス	316	418	237,989
コスモエネルギーホールディングス	5	7	17,560
ゴム製品(0.8%)			
横浜ゴム	11	14	33,321
T O Y O T I R E	11	12	18,201
ブリヂストン	70	76	336,370
住友ゴム工業	20	22	31,920
藤倉ゴム工業	1	1	697
オカモト	7	1	9,911
フコク	0.900	1	1,484
ニッタ	2	2	10,934
住友理工	3	4	4,900
三ツ星ベルト	5	3	7,174
バンドー化学	3	4	5,564
ガラス・土石製品(0.9%)			
日東紡績	2	3	7,259
A G C	20	24	96,309

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本板硝子	10	11	11,578
石塚硝子	—	0.700	1,215
日本山村硝子	8	1	1,491
日本電気硝子	8	10	32,724
オハラ	0.800	1	1,742
住友大阪セメント	39	5	23,575
太平洋セメント	12	15	58,090
日本ヒューム	2	2	2,037
日本コンクリート工業	4	5	1,618
三谷セキサン	1	1	3,396
アジアパイルホールディングス	2	3	2,194
東海カーボン	18	22	34,239
日本カーボン	1	1	6,180
東洋炭素	1	1	3,235
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	7,950
TOTO	15	19	83,232
日本碍子	24	30	51,315
日本特殊陶業	17	21	49,959
MARUWA	0.700	0.900	5,688
品川リフラクトリーズ	0.500	0.700	2,411
黒崎播磨	0.400	0.500	2,850
ヨータイ	0.500	2	1,315
東京窯業	3	—	—
ニッカトー	1	1	1,454
フジミインコーポレーテッド	1	2	5,132
エーアンドエーマテリアル	1	1	1,662
ニチアス	11	6	14,144
ニチハ	3	3	10,972
鉄鋼(1.0%)			
新日鐵住金	87	114	232,232
神戸製鋼所	35	45	40,093
中山製鋼所	2	3	1,689
合同製鐵	1	1	2,088
ジェイエフイーホールディングス	52	66	128,644
日新製鋼	5	—	—
東京製鐵	10	13	11,616
共英製鋼	2	2	4,804
大和工業	4	5	15,808
東京鐵鋼	0.800	1	1,574
大阪製鐵	1	1	2,985

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
淀川製鋼所	2	3	7,434
東洋鋼鈑	5	—	—
丸一鋼管	6	8	28,927
モリ工業	0.600	0.700	1,806
大同特殊鋼	3	4	18,920
日本高周波鋼業	1	2	1,523
日本冶金工業	16	20	4,977
山陽特殊製鋼	2	3	7,768
愛知製鋼	1	1	4,956
日立金属	21	26	30,077
日本金属	0.500	0.600	778
大平洋金属	1	1	5,001
新日本電工	11	14	3,469
栗本鐵工所	1	1	1,810
三菱製鋼	1	1	2,959
日亜鋼業	3	5	1,770
日本精線	0.300	0.400	1,354
シンニッタン	0.700	4	1,597
新家工業	0.600	—	—
非鉄金属(0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	3	4	2,516
日本軽金属ホールディングス	57	67	16,439
三井金属鉱業	5	6	17,989
東邦亜鉛	1	1	4,438
三菱マテリアル	12	16	50,204
住友金属鉱山	25	33	107,907
DOWAホールディングス	5	5	20,064
古河機械金属	3	4	5,990
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	5,202
東邦チタニウム	3	4	4,338
UACJ	3	3	8,210
CKサンエツ	—	0.600	2,094
古河電気工業	6	7	25,098
住友電気工業	73	92	142,692
フジクラ	23	29	14,642
昭和電線ホールディングス	2	2	2,070
東京特殊電線	0.300	—	—
タツタ電線	3	4	2,562
カナレ電気	0.600	0.800	1,469
平河ヒューテック	1	1	2,163

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
リョービ	2	3	8,259
アーレスティ	2	3	2,103
アサヒホールディングス	3	4	9,982
金属製品(0.6%)			
稲葉製作所	1	1	1,800
宮地エンジニアリンググループ	0.600	0.700	1,472
トーカロ	1	6	6,035
アルファ	0.700	1	1,654
SUMCO	18	27	42,432
川田テクノロジーズ	0.400	0.500	3,420
RS Technologies	0.300	0.600	1,917
東洋製罐グループホールディングス	13	15	36,062
ホッカンホールディングス	5	1	2,114
コロナ	1	1	1,460
横河ブリッジホールディングス	3	4	9,011
高田機工	0.300	—	—
三和ホールディングス	18	25	33,045
文化シャッター	5	7	6,110
三協立山	2	3	4,970
アルインコ	1	2	1,992
LIXILグループ	28	36	58,188
日本フィルコン	2	2	1,609
ノーリツ	4	5	9,036
長府製作所	2	2	5,527
リンナイ	3	4	32,428
ダイニチ工業	1	2	1,462
日東精工	2	3	1,880
三洋工業	0.500	—	—
岡部	4	5	4,860
ジーテクト	2	2	4,625
東プレ	3	4	11,316
高周波熱錬	3	4	4,150
東京製網	1	1	1,555
サンコール	1	1	1,188
モリテックスチール	1	3	1,598
パイオラックス	2	3	9,258
エイチワン	1	2	2,697
日本発条	19	24	25,774
アドバネクス	—	1	1,762
立川プラインド工業	1	1	1,803
三益半導体工業	1	2	3,264

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械(4.9%)			
日本ドライケミカル	0.600	—	—
日本製鋼所	6	7	15,585
三浦工業	8	10	27,274
タクマ	6	9	13,203
ツガミ	5	5	4,202
オークマ	2	3	18,693
東芝機械	11	2	6,482
アマダホールディングス	30	38	43,776
アイダエンジニアリング	5	6	5,596
滝澤鉄工所	0.600	1	1,723
F U J I	5	7	11,677
牧野フライス製作所	10	2	13,267
オーエスジー	9	12	27,152
ダイジェット工業	0.700	—	—
旭ダイヤモンド工業	5	6	5,265
DMG森精機	10	15	23,618
ソディック	4	5	4,509
ディスコ	2	3	53,889
日東工器	1	1	3,082
日進工具	0.500	0.700	1,750
パンチ工業	1	2	1,725
豊和工業	1	1	1,698
OKK	1	1	1,549
石川製作所	0.500	1	1,437
東洋機械金属	1	2	1,522
津田駒工業	5	—	—
島精機製作所	2	3	13,107
オプトラン	1	2	5,500
NCホールディングス	1	1	833
フリーユー	1	2	2,078
ヤマシンフィルタ	2	4	3,057
日阪製作所	2	3	2,697
やまびこ	3	4	5,011
平田機工	0.500	1	8,172
ペガサスミシン製造	1	2	1,603
ナブテスコ	10	13	40,567
三井海洋開発	2	2	7,917
レオン自動機	1	2	3,828
SMC	6	7	287,693
新川	1	3	2,075

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
ホソカワミクロン	0.700	0.900	4,347
ユニオンツール	0.900	1	3,327
オイレス工業	2	3	6,602
日精エー・エス・ビー機械	0.700	0.700	2,831
サトーホールディングス	2	3	8,130
技研製作所	1	1	5,797
日本エアータック	1	2	1,490
カワタ	－	1	1,393
日精樹脂工業	1	2	1,957
オカダアイヨン	0.800	1	1,481
小松製作所	95	112	308,009
住友重機械工業	11	14	54,812
日立建機	9	10	28,930
日工	0.500	0.700	1,502
巴工業	0.800	1	2,624
井関農機	2	2	4,140
TOWA	1	－	－
丸山製作所	0.800	1	1,430
北川鉄工所	0.900	1	2,698
ローツェ	1	1	1,897
タカキタ	1	2	1,421
クボタ	106	133	205,035
荏原実業	0.700	0.700	1,557
三菱化工機	0.700	1	1,554
月島機械	3	4	6,869
帝国電機製作所	1	1	2,048
新東工業	4	5	5,970
澁谷工業	1	2	7,359
アイチコーポレーション	3	4	3,065
小森コーポレーション	5	6	8,080
鶴見製作所	1	1	3,414
酒井重工業	0.400	－	－
荏原製作所	8	11	35,035
石井鐵工所	0.700	0.800	1,457
西島製作所	2	2	2,365
北越工業	2	2	3,047
ダイキン工業	27	34	419,900
オルガノ	0.700	0.900	2,839
トーヨーカネツ	0.800	0.900	2,101
栗田工業	10	13	40,054
椿本チエイン	12	3	13,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
木村化工機	2	4	1,553
アネスト岩田	3	3	3,872
ダイフク	10	13	77,268
サムコ	1	1	1,438
加藤製作所	0.900	1	3,547
油研工業	0.500	0.800	1,517
タダノ	9	12	14,220
フジテック	6	9	10,989
C K D	5	6	7,383
キトー	1	1	3,448
平和	6	6	15,207
理想科学工業	2	2	4,285
SANKYO	5	6	25,141
日本金銭機械	1	2	3,040
マースグループホールディングス	1	1	3,515
福島工業	1	1	5,880
ダイコク電機	0.900	1	1,645
竹内製作所	3	4	8,517
アマノ	6	7	16,890
JUK I	2	3	4,658
サンデンホールディングス	2	3	2,538
蛇の目ミシン工業	1	3	1,455
マックス	3	3	5,749
グローリー	5	6	18,216
新晃工業	2	2	3,565
大和冷機工業	3	3	4,554
セガサミーホールディングス	19	24	31,838
日本ピストンリング	0.700	0.900	1,521
リケン	0.900	1	6,252
T P R	2	3	8,180
ツバキ・ナカシマ	2	3	7,619
ホシザキ	6	7	54,093
大豊工業	1	2	2,128
日本精工	40	51	53,910
NTN	45	53	18,992
ジェイテクト	21	23	34,392
不二越	18	2	10,327
日本トムソン	6	7	4,173
T H K	12	15	43,849
ユースイン精機	0.900	1	1,981
前澤給装工業	0.800	1	1,856

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イーグル工業	2	3	4,030
日本ピラー工業	2	2	3,507
キッツ	8	10	8,605
マキタ	25	30	123,018
日立造船	15	19	6,954
三菱重工業	33	41	181,395
I H I	15	19	62,361
スター精密	3	4	7,219
電気機器(13.0%)			
日清紡ホールディングス	12	13	13,248
イビデン	12	15	23,970
コニカミノルタ	46	54	59,132
ブラザー工業	24	32	68,396
ミネベアミツミ	36	46	82,882
日立製作所	476	112	390,332
三菱電機	198	248	357,544
富士電機	60	16	56,538
東洋電機製造	0.800	1	1,488
安川電機	23	28	92,480
シンフォニア テクノロジー	13	3	4,858
明電舎	17	4	7,918
オリジン電気	0.800	—	—
山洋電気	1	1	4,872
デンヨー	1	2	3,295
東芝テック	14	3	9,225
芝浦メカトロニクス	3	0.400	1,412
マブチモーター	5	6	26,565
日本電産	23	30	402,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.700	1	2,369
トレックス・セミコンダクター	—	1	1,376
東光高岳	1	1	1,842
ダブル・スコープ	2	3	4,820
ダイヘン	11	2	7,565
ヤーマン	2	3	4,813
JVCケンウッド	14	19	5,168
ミマキエンジニアリング	1	2	1,694
第一精工	0.900	1	1,270
日新電機	4	5	5,875
大崎電気工業	4	5	3,515
オムロン	21	26	131,175
日東工業	3	4	8,932

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
I D E C	2	3	6,930
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36	9	20,673
サクサホールディングス	—	0.800	1,492
メルコホールディングス	1	1	3,990
日本電気	25	32	120,911
富士通	204	24	180,432
沖電気工業	8	10	14,115
岩崎通信機	1	—	—
電気興業	1	1	3,458
サンケン電気	12	2	6,609
アイホン	1	1	2,461
ルネサスエレクトロニクス	10	25	17,802
セイコーエプソン	29	30	51,912
ワコム	15	18	8,561
アルバック	4	5	16,200
E I Z O	1	2	10,810
ジャパンディスプレイ	40	58	4,240
日本信号	5	6	6,180
京三製作所	5	5	2,120
能美防災	2	3	6,586
ホーチキ	1	1	1,846
星和電機	—	3	1,698
エレコム	1	2	7,693
パナソニック	226	284	296,771
シャープ	13	24	33,641
アンリツ	14	16	34,320
富士通ゼネラル	6	7	11,384
ソニー	132	167	880,758
T D K	10	13	114,140
帝国通信工業	1	1	1,441
タムラ製作所	7	9	5,702
アルプスアルパイン	17	25	59,777
池上通信機	9	1	1,414
パイオニア	33	41	2,739
日本電波工業	2	3	1,446
鈴木	1	2	1,615
日本トリム	0.400	0.500	2,785
ローランド ディー. ジー.	1	1	2,906
フォスター電機	2	2	4,564
クラリオン	10	2	5,500
S M K	6	0.700	1,841

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
ヨコオ	1	1	2,970
ホシデン	5	7	6,774
ヒロセ電機	3	3	42,012
日本航空電子工業	5	5	8,561
ＴＯＡ	2	2	2,808
マクセルホールディングス	3	5	9,012
古野電気	2	3	3,132
ユニデンホールディングス	5	0.700	1,611
アルパイン	4	－	－
スミダコーポレーション	2	2	3,181
アイコム	1	1	3,144
リオン	0.800	1	2,125
本多通信工業	1	－	－
船井電機	2	2	1,915
横河電機	19	24	53,236
新電元工業	0.700	0.900	4,014
アズビル	5	16	38,784
東亜ディーケーケー	1	2	1,694
日本光電工業	8	11	37,565
チノー	0.800	－	－
共和電業	3	4	1,496
日本電子材料	2	2	1,424
堀場製作所	3	4	28,616
アドバンテスト	11	17	45,968
小野測器	1	2	1,414
エスパック	1	2	4,543
キーエンス	9	12	763,354
日置電機	1	1	5,798
シスメックス	15	19	129,572
日本マイクロニクス	3	4	3,272
メガチップス	1	2	4,528
OBARA GROUP	1	1	5,880
澤藤電機	0.700	0.500	798
コーセル	2	3	3,750
イリソ電子工業	1	2	11,109
新日本無線	1	－	－
オプテックスグループ	1	4	9,402
千代田インテグレ	1	1	2,144
アイ・オー・データ機器	1	1	1,575
レーザーテック	4	5	21,114
スタンレー電気	15	17	56,672

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
岩崎電気	0.900	－	－
ウシオ電機	12	15	19,811
岡谷電機産業	－	4	1,548
ハリオス テクノ ホールディング	1	2	1,626
日本セラミック	2	2	6,962
遠藤照明	1	2	1,495
古河電池	1	2	1,522
双信電機	－	4	1,816
山一電機	1	1	2,176
図研	1	1	2,558
日本電子	7	4	9,290
カシオ計算機	15	22	33,286
ファナック	18	23	460,017
日本シイエムケイ	3	6	4,246
エンプラス	0.900	1	3,355
大真空	1	－	－
ローム	8	12	90,720
浜松ホトニクス	14	17	71,331
三井ハイテック	2	2	2,737
新光電気工業	7	8	7,014
京セラ	32	37	236,496
太陽誘電	8	11	26,262
村田製作所	20	26	456,097
ユーシン	3	3	3,833
双葉電子工業	3	4	7,199
北陸電気工業	0.800	1	1,590
ニチコン	6	7	7,807
日本ケミコン	1	1	3,871
KOA	2	3	6,023
市光工業	3	3	2,534
小糸製作所	11	14	102,214
ミツバ	3	4	3,270
SCREENホールディングス	3	4	20,016
キャノン電子	1	2	4,236
キャノン	106	134	432,016
リコー	59	74	84,673
象印マホービン	－	4	5,612
MUTOHホールディングス	0.600	0.800	1,498
東京エレクトロン	13	16	260,039
輸送用機器(8.1%)			
トヨタ紡織	5	8	16,025

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
芦森工業	0.600	1	1,713
ユニプレス	3	4	9,566
豊田自動織機	16	20	112,962
モリタホールディングス	3	4	8,223
三櫻工業	2	3	1,782
デンソー	44	54	264,848
東海理化電機製作所	5	6	13,332
三井E&Sホールディングス	7	9	11,412
川崎重工業	15	19	55,348
名村造船所	5	7	3,240
日本車輛製造	7	0.900	2,370
三菱ロジスネクスト	2	3	4,116
近畿車輛	0.500	0.700	1,466
日産自動車	233	293	278,332
いすゞ自動車	57	78	127,415
トヨタ自動車	240	277	1,883,546
日野自動車	28	31	32,188
三菱自動車工業	73	92	58,115
エフテック	1	1	1,708
レシップホールディングス	0.900	—	—
武蔵精密工業	2	6	9,444
日産車体	7	4	4,924
新明和工業	8	11	14,772
極東開発工業	3	5	7,490
日信工業	4	4	7,208
トピー工業	1	2	4,746
ティラド	0.700	0.900	2,081
曙ブレーキ工業	9	13	2,356
タチエス	3	4	7,056
NOK	10	13	24,213
フタバ産業	6	6	4,222
KYB	2	2	7,943
大同メタル工業	2	4	3,204
プレス工業	10	12	7,822
ミクニ	2	3	1,584
太平洋工業	4	5	8,788
ケーヒン	4	5	11,058
河西工業	2	3	2,706
アイシン精機	16	20	89,585
マツダ	62	78	100,749
今仙電機製作所	1	2	2,496

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
本田技研工業	178	210	636,930
スズキ	39	45	262,899
S U B A R U	61	77	218,217
安永	1	1	1,885
ヤマハ発動機	28	35	79,059
ショーワ	5	5	9,363
T B K	2	3	1,537
エクセディ	2	3	9,193
豊田合成	7	8	19,928
愛三工業	3	3	2,928
盟和産業	1	1	1,471
日本プラスト	—	2	1,654
ヨロズ	2	2	3,769
エフ・シー・シー	3	4	11,871
シマノ	8	10	171,500
テイ・エス テック	4	5	18,763
ジャムコ	1	1	3,122
精密機器(2.0%)			
テルモ	30	35	236,368
クリエートメディック	1	1	1,495
日機装	6	7	8,427
島津製作所	23	32	89,216
J M S	0.100	—	—
長野計器	1	2	1,578
ブイ・テクノロジー	0.500	0.600	8,838
東京計器	1	1	1,785
インターアクション	—	1	2,131
オーバル	4	6	1,575
東京精密	3	4	13,590
マニー	2	3	15,360
ニコン	34	43	76,080
トプコン	10	13	20,743
オリンパス	29	37	177,709
理研計器	1	2	4,941
タムロン	1	2	4,329
H O Y A	40	50	339,177
シード	0.300	1	1,466
ノーリツ鋼機	2	2	4,340
エー・アンド・デイ	2	2	1,697
朝日インテック	—	10	58,194
シチズン時計	23	27	17,244

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
リズム時計工業	0.800	0.800	1,325
大研医器	1	2	1,470
メニコン	2	3	9,788
シンシア	－	3	1,437
松風	1	1	1,815
セイコーホールディングス	3	3	9,811
ニプロ	13	17	25,707
その他製品(2.0%)			
スノーピーク	1	1	1,807
パラマウントベッドホールディングス	2	2	14,529
トランザクション	－	2	1,514
S H O - B I	3	4	1,528
ニホンフラッシュ	0.900	1	2,266
前田工織	2	2	7,427
永大産業	3	3	1,489
アートネイチャー	2	2	1,706
パンダイナムコホールディングス	20	25	123,360
共立印刷	－	7	1,627
S H O E I	0.900	1	4,848
フランスベッドホールディングス	2	3	3,031
パイロットコーポレーション	3	4	23,100
萩原工業	1	1	2,311
トッパン・フォームズ	4	5	5,008
フジシールインターナショナル	4	5	23,324
タカラトミー	8	10	11,752
廣済堂	2	2	1,626
アーク	11	16	1,588
タカノ	1	－	－
プロネクサス	1	2	2,538
ホクシン	7	10	1,417
ウッドワン	1	－	－
大建工業	1	1	3,646
凸版印刷	56	35	61,284
大日本印刷	25	35	89,961
図書印刷	1	2	2,159
共同印刷	0.600	0.800	1,988
N I S S H A	4	5	7,007
宝印刷	1	1	1,988
アシックス	19	24	36,728
ツツミ	0.700	0.800	1,592
小松ウオール工業	0.700	0.800	1,549

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマハ	13	14	80,956
河合楽器製作所	0.700	0.800	2,684
クリナップ	1	2	1,524
ピジョン	12	15	70,200
キングジム	1	2	1,732
リンテック	4	5	14,850
イトーキ	4	4	2,654
任天堂	12	15	454,027
三菱鉛筆	3	4	9,393
タカラスタンダード	4	5	8,787
コクヨ	9	11	20,158
ナカバヤシ	－	2	1,474
グローブライド	0.900	1	3,406
オカムラ	6	8	11,397
美津濃	2	2	6,515
電気・ガス業(2.0%)			
東京電力ホールディングス	158	198	133,129
中部電力	60	76	135,216
関西電力	80	101	168,554
中国電力	27	34	50,602
北陸電力	19	24	22,643
東北電力	46	58	86,750
四国電力	17	22	32,300
九州電力	43	51	68,588
北海道電力	19	23	19,036
沖縄電力	3	4	9,494
電源開発	15	19	55,974
エフオン	1	1	1,342
イーレックス	3	4	3,685
レノバ	－	3	3,225
東京瓦斯	42	48	149,328
大阪瓦斯	38	48	109,061
東邦瓦斯	9	12	60,946
北海道瓦斯	5	1	1,896
広島ガス	4	5	1,759
西部瓦斯	2	2	7,005
静岡ガス	5	7	6,968
メタウォーター	1	1	3,726
陸運業(4.8%)			
S B S ホールディングス	2	2	4,867
東武鉄道	21	26	82,319

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
相鉄ホールディングス	6	8	28,347
東京急行電鉄	53	67	127,493
京浜急行電鉄	27	34	63,426
小田急電鉄	29	39	101,346
京王電鉄	11	13	89,238
京成電鉄	13	18	70,592
富士急行	2	3	13,498
新京成電鉄	0.300	0.200	415
東日本旅客鉄道	35	44	470,466
西日本旅客鉄道	17	22	184,019
東海旅客鉄道	17	22	553,820
西武ホールディングス	25	31	63,907
鴻池運輸	2	4	7,056
西日本鉄道	5	6	18,830
ハマキョウレックス	1	1	8,075
サカイ引越センター	1	1	8,567
近鉄グループホールディングス	18	23	117,056
阪急阪神ホールディングス	25	31	129,525
南海電気鉄道	8	10	31,458
京阪ホールディングス	8	10	48,037
神戸電鉄	0.400	0.600	2,379
名古屋鉄道	14	18	57,267
山陽電気鉄道	1	1	3,940
日本通運	7	9	65,472
ヤマトホールディングス	32	41	123,383
山九	4	6	36,234
丸運	4	—	—
丸全昭和運輸	7	1	5,415
センコーグループホールディングス	11	13	12,181
トナミホールディングス	0.500	0.600	3,894
ニッコンホールディングス	7	9	25,857
日本石油輸送	—	0.500	1,486
福山通運	2	3	13,500
セイノーホールディングス	14	17	27,647
神奈川中央交通	0.500	0.600	2,247
日立物流	4	5	16,978
丸和運輸機関	1	1	4,260
C&Fロジホールディングス	2	2	3,108
九州旅客鉄道	15	19	73,260
S Gホールディングス	13	22	71,025

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
海運業(0.2%)			
日本郵船	15	19	35,521
商船三井	11	14	37,086
川崎汽船	8	7	11,753
N S ユナイテッド海運	0.900	1	3,428
飯野海運	9	11	4,446
乾汽船	1	2	1,588
空運業(0.6%)			
日本航空	34	43	175,824
ANAホールディングス	36	43	178,821
パスコ	2	0.300	276
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.500	0.700	4,767
日新	1	2	3,914
三菱倉庫	6	8	22,664
三井倉庫ホールディングス	11	2	5,759
住友倉庫	13	8	12,869
湊澤倉庫	1	1	2,152
東陽倉庫	4	5	1,690
日本トランスシティ	5	5	2,303
ケイヒン	0.800	1	1,675
中央倉庫	1	1	1,582
安田倉庫	1	1	1,717
東洋埠頭	0.800	1	1,491
宇徳	3	2	1,531
上組	11	14	36,554
キムラユニティ	1	—	—
キューソー流通システム	0.500	0.600	1,234
近鉄エキスポレス	3	4	8,275
エーアイティー	1	1	1,611
日本コンセプト	0.300	1	1,573
情報・通信業(8.3%)			
NECネットエスアイ	2	2	6,860
システナ	1	8	9,996
デジタルアーツ	1	1	10,816
新日鉄住金ソリューションズ	3	3	11,070
コア	1	1	1,749
ソフトクリエイトホールディングス	0.900	1	1,702
T I S	6	8	42,606
電算システム	0.700	0.900	2,263

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
グリー	10	16	7,812
コーエーテクモホールディングス	3	5	9,265
三菱総合研究所	0.800	1	3,315
ボルテージ	1	2	1,502
電算	0.600	0.700	1,553
A G S	—	2	1,548
ファインデックス	2	2	1,929
ヒト・コミュニケーションズ	0.700	1	1,626
ブレインパッド	—	0.500	2,575
K L a b	3	4	3,555
ポルトウイン・ビットクルーホールディングス	1	3	2,819
ネクソン	21	62	101,883
アイスタイル	4	6	4,247
エムアップ	1	0.800	1,714
エイチーム	1	1	2,839
テクノスジャパン	1	2	1,562
コロプラ	6	7	4,942
モバイルクリエイト	3	—	—
ブロードリーフ	4	12	6,945
デジタルハーツホールディングス	1	1	1,452
メディアドゥホールディングス	0.700	0.800	1,912
じげん	—	2	1,726
サイバーリンクス	1	1	1,516
フィックスターズ	0.400	2	2,967
CARTA HOLDINGS	1	1	1,472
オプティム	0.600	0.500	1,970
セレス	—	0.900	1,696
ティーガイア	1	2	4,852
セック	—	0.400	1,488
豆蔵ホールディングス	1	1	1,785
テクマトリックス	1	1	3,077
プロシップ	—	1	1,492
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52	58	17,846
GMOペイメントゲートウェイ	1	4	25,440
ザッパラス	3	4	1,584
インターネットイニシアティブ	3	4	10,116
さくらインターネット	2	3	1,624
GMOクラウド	0.600	0.500	1,715
S R Aホールディングス	1	1	3,460
MINOR Iソリューションズ	—	0.900	1,473
朝日ネット	2	2	1,496

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドソル日進	—	1	1,756
フリービット	1	1	1,756
コムチュア	1	1	4,319
サイバーコム	1	—	—
メディカル・データ・ビジョン	0.700	2	2,503
g u m i	2	3	1,822
モバイルファクトリー	1	0.600	868
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	1	1,654
P C Iホールディングス	0.400	0.600	1,371
パイプドHD	1	1	1,345
ランドコンピュータ	—	1	1,711
オープンドア	0.800	1	3,780
マイネット	—	0.800	896
アカツキ	0.400	0.900	5,121
L I N E	5	7	29,933
シンクロ・フード	0.300	2	1,792
オークネット	—	1	1,598
AOI TYO HOLDINGS	1	2	2,108
マクロミル	1	4	5,955
ビーグリー	—	1	1,659
野村総合研究所	13	15	68,665
サイバネットシステム	1	2	1,552
C Eホールディングス	1	2	1,537
日本システム技術	—	1	1,383
インテージホールディングス	2	3	2,641
東邦システムサイエンス	1	1	1,457
ソースネクスト	2	9	5,025
インフォコム	—	1	4,005
F I G	—	4	1,543
アルテリア・ネットワークス	—	2	2,558
フォーカスシステムズ	1	1	1,662
クレスコ	0.400	0.700	2,401
フジ・メディア・ホールディングス	20	25	41,517
オービック	6	8	87,805
ジャストシステム	3	3	9,411
T D Cソフト	1	2	1,988
ヤフー	140	159	49,223
トレンドマイクロ	9	13	68,510
インフォメーション・ディベロップメント	—	1	1,524
日本オラクル	3	4	40,670
アルファシステムズ	0.600	0.800	2,145

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
フューチャー	2	3	5,817
CAC Holdings	1	1	2,040
ソフトバンク・テクノロジー	0.800	1	2,108
トーセ	0.700	1	1,461
オービックビジネスコンサルタント	1	2	10,962
伊藤忠テクノソリューションズ	4	11	29,115
アイティフォー	2	3	2,520
東計電算	0.400	—	—
エックスネット	1	1	1,438
大塚商会	5	13	53,658
サイボウズ	2	2	1,879
電通国際情報サービス	1	1	5,587
デジタルガレージ	3	4	13,963
イーエムシステムズ	0.700	2	2,524
ウェザーニューズ	0.700	0.800	2,504
C I J	2	1	1,540
東洋ビジネスエンジニアリング	0.800	0.800	1,580
日本エンタープライズ	6	8	1,459
WOWOW	0.900	1	3,624
スカラ	1	2	1,776
IMAGICA GROUP	1	2	1,416
ネットワンシステムズ	7	8	21,878
システムソフト	—	14	1,440
アルゴグラフィックス	0.900	1	4,975
マーベラス	3	3	3,355
エイベックス	3	4	5,959
日本ユニシス	5	7	21,796
兼松エレクトロニクス	1	1	4,283
東京放送ホールディングス	11	16	31,282
日本テレビホールディングス	17	22	40,252
朝日放送グループホールディングス	1	2	1,855
テレビ朝日ホールディングス	5	6	13,386
スカパーJ SATホールディングス	14	18	9,262
テレビ東京ホールディングス	1	2	4,988
日本BS放送	1	1	1,492
ビジョン	0.500	0.800	3,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,411
ワイヤレスゲート	1	3	1,287
コネクシオ	1	1	2,453
日本通信	17	21	2,743
日本電信電話	139	167	785,035

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
KDDI	175	215	585,293
ソフトバンク	—	194	262,170
光通信	2	2	58,841
NTTドコモ	143	175	457,355
エムティーアイ	2	2	1,764
GMOインターネット	7	8	16,242
カドカワ	5	7	7,952
学研ホールディングス	0.700	0.800	4,296
ゼンリン	2	4	15,312
昭文社	1	3	1,519
インプレスホールディングス	6	10	1,560
アイネット	1	1	1,978
松竹	1	1	18,288
東宝	12	16	65,124
東映	0.700	1	13,500
エヌ・ティ・ティ・データ	60	65	79,105
ビジネスブレイン太田昭和	0.800	0.800	1,724
D T S	2	2	11,043
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9	11	36,138
シーイーシー	1	2	6,013
カプコン	4	10	23,509
アイ・エス・ビー	1	0.800	1,765
ジャストテック	1	1	1,566
S C S K	4	6	31,104
日本システムウエア	0.600	0.900	1,780
アイネス	2	3	4,057
T K C	1	2	7,948
富士ソフト	2	3	16,254
N S D	3	4	9,924
コナミホールディングス	7	10	44,550
福井コンピュータホールディングス	0.600	0.900	1,741
J B C Cホールディングス	1	1	3,110
ミロク情報サービス	1	2	6,763
ソフトバンクグループ	88	102	1,061,840
卸売業(5.1%)			
高千穂交易	1	1	1,518
伊藤忠食品	0.500	0.600	2,928
エレマテック	0.900	1	2,049
J A L U X	0.600	0.700	1,764
あらた	1	1	6,209
トーマンデバイス	0.500	0.600	1,474

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
東京エレクトロ ン デバイス	0.700	0.900	1,667
フィールズ	1	2	1,516
双日	115	135	57,545
アルフレッサ ホールディングス	21	27	87,448
横浜冷凍	4	6	5,939
ラサ商事	1	1	1,560
アルコニックス	2	2	3,304
神戸物産	1	3	13,542
あい ホールディングス	3	3	6,849
ディーブイエックス	1	1	1,515
ダイワボウホールディングス	1	2	14,102
マクニカ・富士エレホールディングス	3	6	10,873
ラクト・ジャパン	－	0.500	4,245
パタルケーエスケー・ホールディングス	3	4	5,023
八洲電機	1	1	1,577
UKCホールディングス	1	1	3,286
ジュテックホールディングス	1	0.900	931
大光	1	2	1,655
OCHIホールディングス	1	1	1,613
TOKAIホールディングス	10	13	12,025
Cominix	－	1	1,519
三洋貿易	1	1	2,506
ビューティガレージ	0.600	0.900	1,349
ウイン・パートナーズ	1	1	1,838
シップヘルスケアホールディングス	4	5	22,006
明治電機工業	－	0.900	1,639
コメダホールディングス	3	5	12,180
富士興産	2	2	1,538
協栄産業	0.700	1	1,599
小野建	1	2	3,528
佐島電機	1	1	1,794
エコートレーディング	1	2	1,497
伯東	1	1	2,097
コンドーテック	1	1	1,976
ナガイレーベン	2	3	8,232
三菱食品	2	2	7,797
松田産業	1	1	2,647
第一興商	2	3	19,944
メディバルホールディングス	19	26	70,225
SPK	－	0.600	1,386
萩原電気ホールディングス	0.700	0.900	2,749

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アズワン	1	1	14,994
尾家産業	1	－	－
シモジマ	1	1	1,704
ドウシシャ	2	2	3,972
小津産業	0.600	0.800	1,496
高速	1	1	1,776
丸文	1	2	1,564
ハピネット	1	2	2,944
橋本総業ホールディングス	0.800	－	－
日本ライフライン	5	7	13,544
エクセル	0.800	0.900	2,097
マルカキカイ	0.700	0.800	1,702
IDOM	5	8	3,012
日本エム・ディ・エム	1	1	1,611
進和	1	1	3,082
ダイトロン	0.900	1	1,867
シークス	1	3	5,421
田中商事	1	2	1,647
オーハシテクニカ	1	1	2,010
白銅	0.700	0.900	1,512
伊藤忠商事	143	171	348,230
丸紅	160	241	198,566
長瀬産業	11	13	22,921
蝶理	1	1	2,536
豊田通商	21	27	99,051
三共生興	3	4	1,843
兼松	8	9	12,838
三井物産	165	202	364,206
日本紙パルプ商事	1	1	5,915
日立ハイテクノロジーズ	6	7	32,250
カメイ	2	3	3,977
東都水産	0.700	－	－
OUGホールディングス	0.500	0.600	1,503
スターゼン	0.800	0.900	3,618
山善	7	9	11,491
椿本興業	0.400	0.600	2,169
住友商事	123	145	239,975
内田洋行	0.900	1	2,588
三菱商事	136	172	560,013
第一実業	0.900	1	3,839
キャノンマーケティングジャパン	5	7	14,784

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
西華産業	1	1	2,151
佐藤商事	1	2	2,116
菱洋エレクトロ	1	2	3,877
東京産業	2	2	1,474
ユアサ商事	1	2	8,537
神鋼商事	0.400	0.600	1,510
小林産業	4	5	1,571
阪和興業	3	4	14,211
正栄食品工業	1	1	3,984
カナデン	1	2	2,987
菱電商事	1	1	2,813
フルサト工業	1	1	2,338
岩谷産業	4	5	19,737
すてきナイスグループ	1	1	1,514
昭光通商	12	2	1,435
極東貿易	3	—	—
イワキ	3	3	1,508
三菱石油	5	6	6,514
稲畑産業	4	5	9,316
明和産業	2	—	—
ワキタ	4	5	6,323
東邦ホールディングス	5	7	19,826
サンゲツ	6	7	15,466
ミツロコグループホールディングス	2	3	2,944
シナネンホールディングス	0.900	1	2,216
伊藤忠エネクス	4	5	5,119
サンリオ	5	7	17,822
サンワ テクノス	1	1	1,465
リョーサン	2	2	8,397
新光商事	2	2	4,370
トーホー	0.900	1	2,305
三信電気	1	2	3,750
東陽テクニカ	2	2	2,497
モスフードサービス	2	3	8,828
加賀電子	1	2	5,112
ソーダニッカ	2	2	1,624
立花エレテック	1	1	3,038
PAL TAC	2	4	25,080
三谷産業	3	5	1,489
西本Wismettacホールディングス	0.400	0.600	2,646
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.900	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
国際紙パルプ商事	—	5	1,573
ヤマタネ	1	1	1,998
丸紅建材リース	6	0.800	1,628
日鉄住金物産	1	1	8,083
泉州電業	0.600	0.800	2,150
トラスコ中山	4	5	15,861
オートバックスセブン	7	9	17,983
モリト	1	2	1,576
加藤産業	3	3	13,965
イノテック	1	1	1,581
イエローハット	1	2	6,752
J Kホールディングス	2	2	1,625
日伝	1	2	3,114
北沢産業	5	5	1,482
杉本商事	1	1	2,307
因幡電機産業	2	3	15,820
バイテックホールディングス	0.900	1	2,237
東テク	0.600	0.800	1,824
ミスミグループ本社	22	30	84,609
タキヒヨー	0.600	0.800	1,452
蔵王産業	0.800	1	1,456
スズケン	8	11	67,312
ジェコス	1	1	1,815
ルネサスイーストン	1	3	1,564
小売業(4.9%)			
ローソン	4	6	42,098
サンエー	1	1	8,445
カワチ薬品	1	1	3,950
エービーシー・マート	3	3	24,282
ハードオフコーポレーション	1	1	1,465
アスクル	1	2	6,151
ゲオホールディングス	3	3	6,071
アダストリア	3	3	6,667
ジーフット	1	2	1,504
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1	—	—
くらコーポレーション	1	1	7,882
キャンドウ	0.900	1	1,893
パルグループホールディングス	1	1	4,017
エディオン	7	10	10,160
サーラコーポレーション	3	5	2,920
ハローズ	0.700	0.900	1,930

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
あみやき亭	0.400	0.500	1,842
ひらまつ	2	4	1,715
大黒天物産	0.500	0.600	2,460
ハニーズホールディングス	1	2	2,101
ファーマライズホールディングス	2	—	—
アルペン	1	1	3,127
クオールホールディングス	2	3	5,313
ジンズ	1	1	9,197
ビックカメラ	11	13	16,309
DCMホールディングス	10	13	14,731
ペッパーフードサービス	1	1	5,179
MonotaRO	6	15	38,533
DDホールディングス	0.400	0.700	1,504
きちりホールディングス	1	2	1,597
アークランドサービスホールディングス	1	1	3,673
J. フロント リテイリング	23	31	38,716
ドトール・日レスホールディングス	3	4	9,421
マツモトキヨシホールディングス	8	10	39,087
ブロンコビリー	1	1	3,510
ZOZO	19	26	45,871
物語コーポレーション	0.600	0.600	5,712
ココカラファイン	2	2	13,944
三越伊勢丹ホールディングス	36	45	50,535
Hamee	0.700	1	1,313
ウエルシアホールディングス	5	6	26,357
クリエイトSDホールディングス	2	3	10,418
ミサワ	—	3	1,465
ティーライフ	—	1	1,640
チムニー	0.600	0.700	1,859
シュッピン	1	2	1,619
ネクステージ	2	3	3,841
ジョイフル本田	2	7	10,447
鳥貴族	0.700	0.800	1,453
キリン堂ホールディングス	0.700	1	1,711
ホットランド	1	1	1,773
すかいらーくホールディングス	12	22	38,896
綿半ホールディングス	0.700	0.900	2,083
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6	7	8,335
ブックオフコーポレーション	1	—	—
あさひ	1	2	3,018
日本調剤	0.700	0.900	3,541

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモス薬品	1	1	23,199
セブン&アイ・ホールディングス	81	102	511,532
薬王堂	0.800	1	2,883
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5	6	8,494
ツルハホールディングス	4	5	52,258
サンマルクホールディングス	1	1	4,881
フェリシモ	1	1	1,475
トリドールホールディングス	2	3	6,774
TOKYO BASE	0.400	2	1,982
ジャパンミート	—	0.900	1,593
サツドラホールディングス	0.700	0.800	1,518
パロックジャパンリミテッド	1	2	1,830
クスリのアオキホールディングス	1	2	18,480
スシローグローバルホールディングス	1	2	19,440
LIXILビバ	1	2	3,066
メディカルシステムネットワーク	2	—	—
総合メディカル	0.800	—	—
ノジマ	3	4	8,958
カッパ・クリエイト	2	3	4,800
ライトオン	1	2	1,701
良品計画	2	3	93,450
三城ホールディングス	0.800	3	1,450
アドヴァン	2	3	3,737
アルビス	0.400	0.900	2,112
コナカ	2	3	1,445
ハウス オブ ローゼ	0.800	—	—
G-7ホールディングス	0.600	0.700	1,580
イオン北海道	2	2	1,967
コジマ	4	3	2,358
ヒマラヤ	1	1	1,590
コーナン商事	2	3	9,174
エコス	1	0.900	1,532
ワタミ	2	3	5,171
マルシェ	1	1	1,468
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	12	14	100,401
西松屋チェーン	4	5	4,919
ゼンショーホールディングス	10	11	29,092
幸楽苑ホールディングス	1	1	3,718
サイゼリヤ	2	4	8,244
V Tホールディングス	6	8	3,494
魚力	1	1	1,462

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニテッドアローズ	2	2	10,010
ハイデイ日高	2	3	7,427
京都きもの友禅	1	2	924
コロワイド	6	8	19,140
ピーシーデポコーポレーション	2	3	1,511
壱番屋	1	1	8,228
トップカルチャー	2	5	1,495
P L A N T	1	1	1,408
スギホールディングス	4	5	25,704
ヴィア・ホールディングス	—	3	1,998
スクロール	3	3	1,501
ヨンドシーホールディングス	2	2	5,826
ユニ・ファミリーマートホールディングス	6	6	88,113
木曽路	2	3	7,740
S R Sホールディングス	2	2	2,946
千趣会	3	—	—
タカキュー	6	—	—
ケーヨー	3	4	2,448
上新電機	2	2	6,730
日本瓦斯	3	4	16,140
ロイヤルホールディングス	3	4	11,567
東天紅	0.700	—	—
いなげや	2	2	3,653
島忠	4	5	16,749
チヨダ	2	2	4,916
ライフコーポレーション	1	1	4,647
リンガーハット	2	3	7,140
MrMaxHD	2	3	1,727
テンアライド	2	3	1,531
AOKIホールディングス	3	4	6,203
オークワ	3	3	3,944
コメリ	3	3	10,590
青山商事	3	4	11,932
しまむら	2	2	26,593
はせがわ	2	3	1,446
高島屋	31	19	28,627
松屋	3	4	5,331
エイチ・ツー・オー リテイリング	9	12	19,656
近鉄百貨店	0.700	0.900	3,105
パルコ	1	2	2,757
丸井グループ	18	20	41,772

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アクシアル リテイリング	1	2	7,000
イオン	75	94	225,377
イズミ	3	5	27,000
平和堂	4	5	12,605
フジ	2	3	5,604
ヤオコー	2	2	16,744
ゼビオホールディングス	2	3	3,903
ケーズホールディングス	8	25	25,551
Olympicグループ	2	2	1,687
Genky DrugStores	0.800	1	3,134
総合メディカルホールディングス	—	2	4,023
アインホールディングス	2	3	24,618
元気寿司	0.500	0.700	2,709
ヤマダ電機	65	74	39,815
アークランドサカモト	3	4	6,064
ニトリホールディングス	7	10	148,930
グルメ杵屋	1	1	2,004
愛眼	2	5	1,560
吉野家ホールディングス	6	8	15,944
松屋フーズホールディングス	0.900	1	4,422
サガミホールディングス	2	3	4,511
関西スーパーマーケット	1	1	1,911
王将フードサービス	1	1	13,284
プレナス	2	2	4,870
ミニストップ	1	1	3,450
アークス	3	4	11,799
パローホールディングス	4	5	14,506
藤久	0.800	2	1,490
ベルク	0.900	1	6,084
大 庄	1	1	2,031
ファーストリテイリング	3	3	166,122
サンドラッグ	8	9	32,108
サックスパー ホールディングス	1	2	2,343
やまや	—	0.700	1,680
ペルーナ	4	6	5,454
銀行業(6.4%)			
島根銀行	1	2	1,472
じもとホールディングス	13	16	2,041
めぶきフィナンシャルグループ	101	127	39,045
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2	3	5,385
九州フィナンシャルグループ	32	40	18,538

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
ゆうちょ銀行	55	69	87,696
富山第一銀行	5	5	2,289
コンソルディア・フィナンシャルグループ	118	156	71,474
西日本フィナンシャルホールディングス	13	15	15,684
関西みらいフィナンシャルグループ	—	11	9,523
三十三フィナンシャルグループ	—	2	3,357
第四北越フィナンシャルグループ	—	4	15,157
新生銀行	16	18	27,486
あおぞら銀行	11	13	44,643
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,380	1,709	1,003,711
りそなホールディングス	214	269	137,259
三井住友トラスト・ホールディングス	38	48	203,343
三井住友フィナンシャルグループ	147	173	699,497
第四銀行	2	—	—
北越銀行	2	—	—
千葉銀行	70	87	59,073
群馬銀行	39	49	23,518
武蔵野銀行	3	3	8,835
千葉興業銀行	5	6	2,251
筑波銀行	8	10	2,101
七十七銀行	6	7	14,260
青森銀行	1	2	5,722
秋田銀行	1	1	3,486
山形銀行	2	2	5,446
岩手銀行	1	1	5,985
東邦銀行	17	22	6,798
東北銀行	1	—	—
みちのく銀行	1	1	2,571
ふくおかフィナンシャルグループ	79	19	49,212
静岡銀行	52	61	54,754
十六銀行	2	3	7,626
スルガ銀行	20	25	13,554
八十二銀行	35	44	21,045
山梨中央銀行	12	3	4,263
大垣共立銀行	3	3	8,868
福井銀行	1	2	3,334
北國銀行	2	2	9,274
清水銀行	0.700	1	1,762
富山銀行	0.400	0.500	1,577
滋賀銀行	18	4	12,730

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
南都銀行	2	2	6,478
百五銀行	18	22	8,574
京都銀行	7	8	41,184
紀陽銀行	7	8	13,563
三重銀行	0.900	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	13	16	20,260
広島銀行	28	36	23,349
山陰合同銀行	11	14	11,957
中国銀行	13	15	16,669
鳥取銀行	0.800	1	1,537
伊予銀行	27	32	20,247
百十四銀行	21	2	6,380
四国銀行	3	3	3,605
阿波銀行	16	4	12,260
大分銀行	1	1	5,360
宮崎銀行	1	1	4,584
佐賀銀行	1	1	2,709
十八銀行	12	1	4,388
沖縄銀行	1	2	7,808
琉球銀行	3	5	6,629
セブン銀行	73	82	28,351
みずほフィナンシャルグループ	2,655	3,336	587,856
山口フィナンシャルグループ	19	30	32,374
長野銀行	0.700	0.900	1,398
名古屋銀行	1	2	6,940
北洋銀行	29	37	11,322
愛知銀行	0.700	0.900	3,087
第三銀行	1	—	—
中京銀行	0.900	1	2,159
大光銀行	0.700	0.900	1,502
愛媛銀行	2	3	3,699
みなと銀行	1	—	—
京葉銀行	17	10	7,635
関西アーバン銀行	2	—	—
栃木銀行	10	12	3,035
北日本銀行	0.600	0.800	1,679
東和銀行	3	4	3,040
福島銀行	1	—	—
トモニホールディングス	16	19	7,657
フィデアホールディングス	19	23	3,141

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
池田泉州ホールディングス	20	26	7,803
証券・商品先物取引業(0.8%)			
F P G	6	7	8,131
S B I ホールディングス	22	29	67,595
ジャフコ	2	4	15,800
大和証券グループ本社	167	197	114,240
野村ホールディングス	336	432	191,289
岡三証券グループ	17	20	10,220
丸三証券	6	7	5,964
東洋証券	7	8	1,434
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21	29	14,620
光世証券	1	1	1,436
水戸証券	6	7	1,881
いちよし証券	4	5	4,544
松井証券	9	12	14,340
だいち証券ビジネス	2	0.200	86
マネックスグループ	20	22	9,984
カブドットコム証券	12	18	10,248
極東証券	2	3	3,940
岩井コスモホールディングス	2	2	3,165
藍澤証券	3	4	3,215
マネーパートナーズグループ	1	5	1,470
保険業(2.3%)			
かんぽ生命保険	7	9	23,045
S O M P O ホールディングス	38	43	182,812
アニコム ホールディングス	1	2	5,980
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	51	64	215,776
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	20	42,864
第一生命ホールディングス	110	138	236,824
東京海上ホールディングス	73	89	495,730
T & D ホールディングス	60	75	104,324
アドバンスクリエイト	0.700	0.500	865
その他金融業(1.2%)			
全国保証	5	7	28,420
日本モーゲージサービス	—	1	1,442
アルヒ	1	2	5,346
プレミアグループ	—	0.500	1,620
クレディセゾン	14	17	27,382
アクリーティブ	4	—	—
芙蓉総合リース	2	2	15,652
興銀リース	3	4	12,433

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京センチュリー	3	4	25,431
日本証券金融	8	10	6,739
アイフル	32	37	11,475
リコーリース	1	1	6,536
イオンフィナンシャルサービス	13	15	34,555
アコム	39	49	19,128
ジャックス	2	2	5,148
オリエントコーポレーション	42	66	7,768
日立キャピタル	5	5	14,743
アプラスフィナンシャル	13	18	1,565
オリックス	130	163	268,468
三菱UFJリース	49	55	31,910
日本取引所グループ	57	66	132,533
イー・ギャランティ	0.500	2	2,461
アサックス	—	2	1,463
NECキャピタルソリューション	0.800	1	1,649
不動産業(2.4%)			
いちご	27	31	11,949
日本駐車場開発	23	29	4,588
ヒューリック	40	51	52,480
三栄建築設計	0.800	1	1,648
スター・マイカ	0.700	1	1,519
野村不動産ホールディングス	13	16	33,838
三重交通グループホールディングス	4	5	3,055
サムティ	1	3	5,208
ディア・ライフ	—	3	1,445
日本商業開発	1	1	2,316
プレサンスコーポレーション	2	3	5,385
ユニゾホールディングス	2	3	7,884
T H E グローバル社	1	2	1,341
日本管理センター	1	1	1,319
サンセイランディック	1	1	1,357
エストラスト	—	1	1,502
フージャースホールディングス	4	5	3,619
オープンハウス	3	4	15,620
東急不動産ホールディングス	47	66	40,986
飯田グループホールディングス	16	20	41,389
イーブランド	—	2	1,493
ムゲンエステート	1	1	802
ハウスドゥ	0.500	1	2,188
シーアールイー	0.900	—	—

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ケイアイスター不動産	0.700	—	—
アグレ都市デザイン	—	2	1,516
テンポイノベーション	—	1	1,800
パーク24	10	14	38,095
パラカ	0.600	0.900	1,711
三井不動産	97	130	349,204
三菱地所	145	172	329,208
平和不動産	3	4	9,324
東京建物	21	26	34,330
ダイビル	5	7	7,905
京阪神ビルディング	3	4	4,039
住友不動産	47	55	234,710
大京	3	—	—
テーオーシー	6	5	4,401
東京楽天地	0.300	0.400	1,854
レオパレス21	23	30	6,211
スタートコーポレーション	2	3	7,986
フジ住宅	2	3	2,709
空港施設	2	2	1,580
明和地所	1	2	1,530
ゴールドクレスト	1	1	3,057
日本エスリード	0.800	1	1,611
日神不動産	2	3	1,688
日本エスコン	3	4	3,361
タカラレーベン	9	11	4,105
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,508
イオンモール	12	12	23,136
ファースト住建	0.800	1	1,605
カチタス	2	2	9,976
トーセイ	2	3	3,570
穴吹興産	—	0.500	1,425
エヌ・ティ・ティ都市開発	12	—	—
サンフロンティア不動産	2	3	4,168
エフ・ジェー・ネクスト	1	2	1,862
ランドビジネス	4	—	—
グランディハウス	2	3	1,543
日本空港ビルデング	5	7	33,813
サービス業(4.9%)			
日本工営	1	1	4,123
L I F U L L	6	9	5,713
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	4,675

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M&Aセンター	6	17	51,418
メンバーズ	1	—	—
タケエイ	2	2	2,037
トラスト・テック	0.800	1	4,706
コシダカホールディングス	1	6	10,368
パソナグループ	1	2	4,242
C D S	1	1	1,654
リンクアンドモチベーション	3	4	4,158
G C A	2	2	2,157
エス・エム・エス	3	8	16,938
パーソルホールディングス	17	23	46,267
リニカル	1	1	2,251
クックパッド	5	7	2,182
アイ・ケイ・ケイ	1	2	1,492
学情	0.900	1	1,582
スタジオアリス	1	1	2,839
シミツホールディングス	1	1	2,099
N J S	0.900	1	1,510
総合警備保障	7	9	45,980
カカクコム	14	17	38,413
アイロムグループ	0.600	—	—
セントケア・ホールディング	1	2	1,590
ルネサンス	0.900	1	2,607
ディップ	2	3	7,622
オプトホールディング	1	1	2,553
新日本科学	2	3	2,384
ツクイ	4	5	4,149
ベネフィット・ワン	—	3	13,711
エムスリー	19	50	87,324
ツカダ・グローバルホールディング	2	2	1,488
アウトソーシング	5	12	16,850
ウエルネット	1	2	2,424
ワールドホールディングス	0.600	0.700	1,509
ディー・エヌ・エー	10	12	21,580
博報堂D Yホールディングス	26	33	59,116
ぐるなび	3	3	2,488
エスアールジータカミヤ	2	2	1,720
ジャパンバストレスキューシステム	2	1	2,395
ファンコミュニケーションズ	5	6	3,458
ライク	0.700	1	1,297
ビジネス・ブレークスルー	3	4	1,642

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
WDBホールディングス	0.900	1	3,076
バリューコマース	1	1	3,416
インフォマート	9	13	16,276
J Pホールディングス	5	6	1,931
E P Sホールディングス	2	3	6,480
プレステージ・インターナショナル	3	4	5,808
アミューズ	1	1	3,512
ドリームインキュベータ	0.600	0.900	1,354
クイック	1	1	2,370
T A C	4	6	1,459
ケネディクス	25	20	11,724
電通	23	29	142,245
テイクアンドギヴ・ニーズ	1	0.900	1,620
ぴあ	0.600	0.700	2,824
イオンファンタジー	0.600	0.800	2,259
シーティーエス	1	2	1,944
ネクシーズグループ	0.800	0.800	1,383
みらかホールディングス	5	6	20,130
アルプス技研	1	2	4,162
日本空調サービス	2	2	1,790
オリエンタルランド	22	28	345,208
ダスキン	5	6	17,344
明光ネットワークジャパン	2	3	2,829
ファルコホールディングス	1	1	1,856
秀英予備校	2	3	1,485
ラウンドワン	5	7	10,434
リゾートトラスト	8	10	16,008
ビー・エム・エル	2	3	10,431
ワタベウエディング	2	—	—
りらいあコミュニケーションズ	3	4	4,201
リソー教育	3	12	5,916
早稲田アカデミー	0.800	—	—
ユー・エス・エス	23	29	58,665
サイバーエージェント	12	14	49,318
楽天	97	110	88,720
クリーク・アンド・リバー社	1	1	1,639
テー・オー・ダブリュー	1	2	1,680
セントラルスポーツ	0.700	0.900	3,141
フルキャストホールディングス	1	2	5,448
エン・ジャパン	—	2	10,192
リソルホールディングス	—	0.400	1,704

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テクノプロ・ホールディングス	3	4	28,656
インターワークス	1	2	1,535
K e e P e r 技研	1	1	1,822
ファーストロジック	1	—	—
G u n o s y	0.900	1	4,212
イー・ガーディアン	1	1	2,328
リブセンス	2	5	1,484
ジャパนมテリアル	1	6	9,379
ベクトル	2	2	4,251
ウチヤマホールディングス	2	3	1,455
キャリアリンク	2	4	1,685
I B J	1	0.800	730
アサンテ	0.500	1	2,211
N・フィールド	1	1	1,473
M&Aキャピタルパートナーズ	0.400	0.600	3,366
ライオンエクスプレスホールディングス	—	1	1,453
E R I ホールディングス	1	1	1,575
アビスト	0.300	0.500	1,660
シグマクシス	—	1	1,684
ウィルグループ	0.900	1	1,872
エスロー・エージェント・ジャパン	2	5	1,517
日本ビューホテル	0.900	1	1,470
リクルートホールディングス	146	170	515,460
エラン	—	1	2,420
土木管理総合試験所	2	—	—
日本郵政	107	195	264,420
ベルシステム24ホールディングス	3	4	6,060
鎌倉新書	—	1	3,029
一蔵	1	2	1,565
エボラブルアジア	—	0.700	1,831
ストライク	—	0.700	1,477
ソラスト	1	5	6,449
セラク	—	2	1,342
インソース	—	0.800	1,895
バイカレント・コンサルティング	—	1	4,283
M S - J a p a n	—	1	1,944
グレイステクノロジー	—	0.800	1,922
ジャパリエバーターサービスホールディングス	—	1	2,837
フルテック	—	1	1,441
日総工産	—	0.700	1,857
キュービーネットホールディングス	—	1	2,278

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
スプリックス	－	0.700	1,910
リログループ	10	13	38,649
東祥	1	1	5,250
エイチ・アイ・エス	3	4	18,039
ラックランド	0.700	0.700	1,343
共立メンテナンス	3	3	19,260
イチネンホールディングス	2	2	3,352
建設技術研究所	1	1	2,412
スペース	1	1	2,017
燦ホールディングス	0.500	0.600	1,518
東京テアトル	1	1	1,552
ナガワ	0.400	0.700	3,885
よみうりランド	0.400	0.500	2,135
東京都競馬	1	1	5,712
常磐興産	0.800	1	1,602
カナモト	2	3	10,479
東京ドーム	7	8	8,757
西尾レントオール	1	2	8,148
トランス・コスモス	2	2	5,678
乃村工藝社	4	5	18,284
藤田観光	0.800	0.900	2,406
KNT-CTホールディングス	1	1	1,690
日本管財	2	2	4,772
トーカイ	1	2	6,529
白洋舎	0.400	0.500	1,447
セコム	20	25	239,878
セントラル警備保障	0.900	1	4,796
丹青社	3	4	5,692

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メイテック	2	3	15,000
応用地質	2	2	3,021
船井総研ホールディングス	3	4	12,318
進学会ホールディングス	2	2	1,367
いであ	1	1	1,477
学究社	0.900	1	1,496
ベネッセホールディングス	6	8	26,926
イオンディライト	2	2	11,875
ナック	1	1	1,572
ニチイ学館	3	3	4,284
ダイセキ	3	4	10,608
ステップ	0.800	1	1,718
合計	株数・金額	23,939	28,825 57,384,775
	銘柄数<比率>	1,820	1,840 <98.4%>

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	855	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2019年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	57,384,775	98.1
コール・ローン等、その他	1,115,528	1.9
投資信託財産総額	58,500,303	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

(2019年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	58,463,038,974円
コール・ローン等	958,221,458
株式(評価額)	57,384,775,610
未収入金	41,476,380
未収配当金	91,185,526
差入委託証拠金	△ 12,620,000
(B)負債	146,632,061
未払解約金	146,631,400
その他未払費用	661
(C)純資産総額(A-B)	58,316,406,913
元本	34,475,094,643
次期繰越損益金	23,841,312,270
(D)受益権総口数	34,475,094,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,916円

(注1) 期首元本額 28,140,482,546円
期中追加設定元本額 15,227,365,012円
期中一部解約元本額 8,892,752,915円

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

ニッセイTOPIXオープン	7,001,913,903円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,024,057,407円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,812円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,844円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,570,755円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,301,785,562円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,932,098,974円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,600,088円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,132,565円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,055,008円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,434,319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	13,107,204,121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)	473,776,130円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,130,458円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,740,453円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,118,045円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25,983,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,039,005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)	21,997,831円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,360,716円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,998,804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)	705,242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)	1,334,030円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,608,114円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,261円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,456円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,945円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,148円

損益の状況

当期 (2018年2月21日～2019年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,169,874,563円
受取配当金	1,167,820,086
受取利息	15,860
その他の収益	3,255,653
支払利息	△ 1,217,036
(B)有価証券売買損益	△ 4,584,656,585
売却益	2,231,455,208
売却損	△ 6,816,111,793
(C)先物取引等損益	△ 127,796,540
取引益	219,356,860
取引損	△ 347,153,400
(D)信託報酬等	△ 431,025
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,543,009,587
(F)前期繰越損益金	22,727,568,381
(G)追加信託差損益金	11,357,388,355
(H)解約差損益金	△ 6,700,634,879
(I)合計(E+F+G+H)	23,841,312,270
次期繰越損益金(I)	23,841,312,270

(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。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 24 期

(計算期間：2019年5月21日～2019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

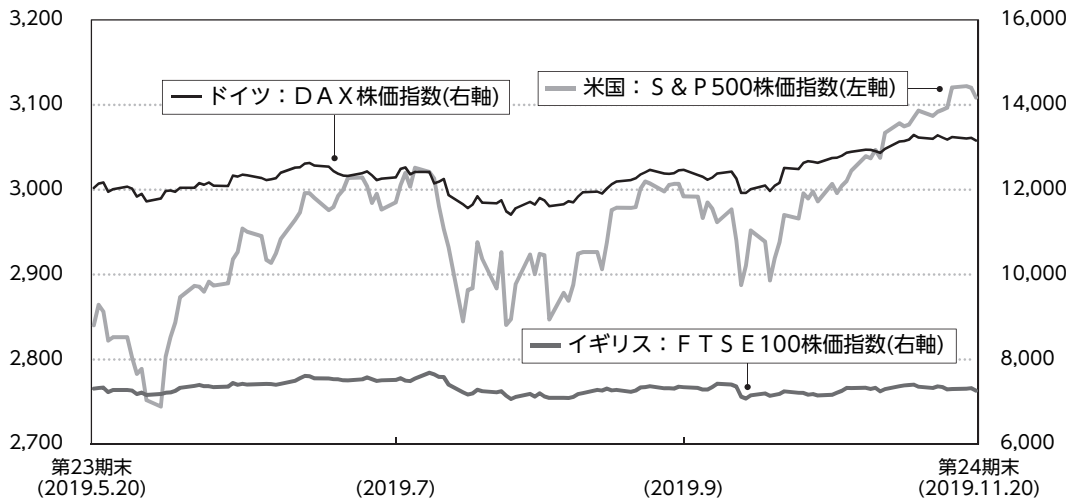
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年5月21日～2019年11月20日

海外株式市況

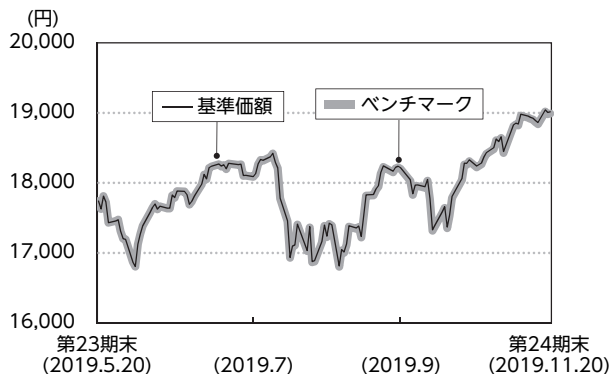
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は期初以降、米連邦準備制度理事会（F R B）議長ら高官による利下げの可能性を示唆する発言や米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことを背景に、7月にかけて上昇基調で推移しました。8月になると米国による対中追加関税の発表や中国の報復措置等を受けて下落しましたが、10月以降は米中貿易交渉の進展期待や市場予想を上回る決算内容、また、米連邦公開市場委員会（F O M C）における追加利下げ決定および今後の金利据え置き見通しを背景に上昇する展開となり、結局、前期末と比較すると米国、ドイツは上昇、イギリスは若干の下落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7月にかけて、F R B 高官による利下げの可能性を示唆する発言や米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことを受けて海外株式市場が上昇基調となったこと
- ・ 10月以降、F O M C における追加利下げ決定および金利の据え置き見通しなど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>

- ・ 8月の米国による対中追加関税発表や中国の報復措置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+7.2%となり、ベンチマーク騰落率（+7.1%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	%	百万円
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613
21期(2018年5月21日)	17,317	4.5	17,031	4.4	95.6	1.9	2.2	131,686
22期(2018年11月20日)	16,899	△2.4	16,598	△2.5	94.2	3.3	2.4	149,718
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

(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	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2019年5月20日	17,740	－	17,404	－	94.7	2.5	2.5
5月末	17,193	△3.1	16,867	△3.1	94.9	2.3	2.6
6月末	17,811	0.4	17,470	0.4	94.8	2.3	2.6
7月末	18,295	3.1	17,944	3.1	94.0	3.3	2.5
8月末	17,388	△2.0	17,046	△2.1	94.9	2.2	2.8
9月末	17,947	1.2	17,590	1.1	94.0	3.2	2.7
10月末	18,660	5.2	18,287	5.1	94.7	2.6	2.7
(期末)2019年11月20日	19,016	7.2	18,631	7.1	94.4	2.9	2.6

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2019年5月21日～2019年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	0円	0.002%	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.006	
(株式)	(1)	(0.006)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.021	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.019)	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)	(0.001)	・ 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	0.029	

(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（17,892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5月21日～2019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 21,054 (△ 516)	千米ドル 162,926 (△ 1,520)	百株 1,710 千米ドル 8,896
	カナダ	2,981 (203)	千カナダ・ドル 13,237	939 千カナダ・ドル 1,109
	オーストラリア	5,376 (△ 1)	千オーストラリア・ドル 8,848 (△ 35)	681 千オーストラリア・ドル 1,075
	香港	6,416 (449)	千香港ドル 23,796	860 千香港ドル 2,032
	シンガポール	2,825	千シンガポール・ドル 1,397	37 千シンガポール・ドル 73
	ニュージーランド	432	千ニュージーランド・ドル 339	0.20 千ニュージーランド・ドル 0.096
	イギリス	20,763 (39,133)	千イギリス・ポンド 12,804 (△ 62)	50,223 千イギリス・ポンド 567
	イスラエル	817	千イスラエル・シェケル 1,878	899 千イスラエル・シェケル 225
	スイス	1,124	千スイス・フラン 8,075 (△ 40)	6 千スイス・フラン 52
	デンマーク	289	千デンマーク・クローネ 12,108	63 千デンマーク・クローネ 1,667
	ノルウェー	365	千ノルウェー・クローネ 4,993	77 千ノルウェー・クローネ 1,180
	スウェーデン	1,657 (228)	千スウェーデン・クローナ 21,612	193 千スウェーデン・クローナ 1,107

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	171	362	22	25
		オランダ	1,308	3,560	27	146
		ベルギー	118	754	8	35
		ルクセンブルグ	68	89	0.18	0.785
		フランス	1,707	7,925	206	319
			(20)	(△ 6)		
		ドイツ	1,823	7,111	227	644
			(31)	(△ 21)		
		ポルトガル	213	120	—	—
		スペイン	3,367	2,553	221	174
			(123)	(1)		
		イタリア	3,423	1,683	839	107
		フィンランド	621	835	19	11
			(19)			
		オーストリア	54	172	—	—
				(△ 17)		
		その他	13	82	—	—

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.983	127	—	—
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	367	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.952	139	—	—
PROLOGIS INC	4	333	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	13	116	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.910	189	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.747	79	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1	62	—	—
DUKE REALTY CORP	2	75	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	195	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.397	122	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.501	65	—	—
HCP INC	3	113	—	—
WELLTOWER INC	3	326	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	76	—	—
KIMCO REALTY CORP	2	49	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.963	49	—	—
MACERICH CO/THE	1	36	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.789	96	—	—
PUBLIC STORAGE	1	251	—	—
REGENCY CENTERS CORP	1	107	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	304	—	—
SL GREEN REALTY CORP	0.490	39	0.009	0.795
SUN COMMUNITIES INC	4	570	—	—
UDR INC	2	111	—	—
VENTAS INC	2	166	—	—
VORNADO REALTY TRUST	1	64	—	—
WP CAREY INC	1	127	—	—
REALTY INCOME CORP	2	207	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4	506	—	—
	(4)			
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.861	98	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	173	—	—
IRON MOUNTAIN INC	2	74	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	4	70	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	2	629	—	—

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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
EQUINIX INC	0.693	373	—	—
VEREIT	5	52	0.110	0.956
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.725	176	—	—
INVITATION HOMES INC	8	238	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	—	5	100
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.633	20	0.008	0.253
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	0.972	22	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.922	24	0.052	1
(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	11	149	—	—
GPT GROUP	20	124	—	—
GOODMAN GROUP	10	158	—	—
STOCKLAND	13	58	0.273	1
MIRVAC GROUP	39	125	—	—
VICINITY CENTRES	24	63	—	—
SCENTRE GROUP	37	145	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	13	1,248	—	—
(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	14	43	3	10
		(△ 1)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	17	35	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	17	44	—	—
SUNTEC REIT	12	22	8	15
		(△0.407)		
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	—	—	19	4
	(19)			
(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	26	—	—
HAMMERSON PLC	—	—	31	85
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	30	1	8
SEGRO PLC	7	57	—	—

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	1	33	0.029	0.804
外国 GECINA SA	0.294	40	—	—
COVIVIO	0.372	35	—	—
ICADE	0.180	14	0.123	9
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.909	117	—	—

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	33,343	31,677	—	—

(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

2019年5月21日～2019年11月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP	45	665,041	14,471	RED HAT INC	7	160,013	20,641
APPLE INC	26	570,630	21,912	WALT DISNEY CO	5	85,704	14,521
AMAZON.COM INC	2	544,378	195,187	APPLE INC	2	58,054	22,132
FACEBOOK INC-A	15	304,894	19,873	AMCOR PLC-CDI	52	57,165	1,091
ALPHABET INC-CL C	1	244,092	123,904	ORACLE CORP	8	46,717	5,673
ALPHABET INC-CL A	1	237,555	124,114	NEWMONT GOLDCORP CORP	11	39,924	3,459
JOHNSON & JOHNSON	15	228,777	14,453	INNOGY SE	6	34,820	5,244
NESTLE SA	19	222,407	11,370	ELI LILLY & CO	2	29,193	12,627
PROCTER & GAMBLE CO	16	207,174	12,398	PFIZER INC	5	26,543	4,587
JPMORGAN CHASE & CO	17	206,136	11,865	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	4	23,551	4,938

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

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

組入有価証券明細表

2019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	239	274	4,682	508,559	資本財
ABBOTT LABORATORIES	724	840	7,085	769,538	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	620	704	6,271	681,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	17	21	395	42,925	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	262	303	6,016	653,403	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	298	364	1,943	211,117	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	16	18	240	26,135	資本財
ADOBE INC	201	232	6,982	758,416	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	30	34	552	59,973	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	391	489	2,021	219,592	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	51	59	351	38,224	資本財
AES CORP	273	316	584	63,499	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	20	23	197	21,417	各種金融
AFLAC INC	313	355	1,920	208,549	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	130	149	1,187	128,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	90	105	2,534	275,322	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	66	77	688	74,770	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	43	50	334	36,300	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	91	106	1,178	128,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	31	36	980	106,459	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	64	74	149	16,183	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	6	6	540	58,751	保険
ALLEGION PLC	39	44	533	57,991	資本財
ALLERGAN PLC	139	156	2,893	314,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	20	20	216	23,469	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	96	112	590	64,114	公益事業
ALLSTATE CORP	141	158	1,756	190,821	保険
ALLY FINANCIAL INC	168	188	580	63,077	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	37	52	517	56,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	123	142	18,687	2,029,632	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	129	149	19,666	2,135,938	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	136	71	192	20,934	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	775	891	4,183	454,327	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	171	199	34,934	3,794,274	小売
AMCOR PLC	－	780	791	85,924	素材
AMERCO	4	4	175	19,015	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMEREN CORPORATION	100	116	876	95,180	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	49	52	153	16,650	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	203	235	2,132	231,607	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	299	338	4,056	440,626	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	30	36	391	42,540	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	364	414	2,214	240,474	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	74	86	1,027	111,570	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	56	62	1,000	108,646	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	65	75	661	71,890	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	116	131	534	58,029	各種金融
AMETEK INC	95	107	1,070	116,315	資本財
AMGEN INC	262	290	6,523	708,470	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	124	142	1,470	159,668	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	208	－	－	－	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	153	176	1,973	214,289	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	34	39	960	104,290	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	106	122	3,584	389,296	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	99	114	2,283	248,005	保険
APACHE CORP	156	179	401	43,635	エネルギー
APPLE INC	1,957	2,191	58,355	6,337,942	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	404	444	2,711	294,452	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	108	122	1,120	121,675	自動車・自動車部品
ARAMARK	100	117	529	57,526	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	165	191	795	86,396	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	230	265	1,143	124,183	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	178	188	584	63,517	資本財
ARISTA NETWORKS INC	21	25	493	53,645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	35	39	314	34,145	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	76	88	818	88,903	保険
ASSURANT INC	21	29	387	42,123	保険
AT&T INC	3,005	3,480	13,224	1,436,262	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	63	74	329	35,740	保険
ATMOS ENERGY CORP	47	55	601	65,286	公益事業
AUTODESK INC	90	104	1,724	187,344	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	36	39	320	34,785	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	180	207	3,549	385,559	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	10	11	1,378	149,692	小売
AVERY DENNISON CORP	35	40	528	57,360	素材
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	96	138	328	35,713	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	90	101	297	32,262	素材
BAKER HUGHES COMPANY	211	245	541	58,789	エネルギー
BALL CORP	133	152	1,025	111,357	素材
BANK OF AMERICA CORP	3,843	4,299	14,162	1,538,184	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	407	410	1,996	216,869	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	208	230	1,885	204,741	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	318	364	1,995	216,722	銀行
BECTON DICKINSON & CO	110	128	3,160	343,233	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	13	17	353	38,356	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	533	619	13,559	1,472,743	各種金融
BEST BUY CO INC	101	114	860	93,462	小売
BIOGEN INC	82	92	2,627	285,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	73	85	663	72,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	48	54	2,708	294,162	各種金融
BOEING CO	222	254	9,346	1,015,111	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	19	20	3,801	412,861	小売
BORGWARNER INC	85	98	426	46,372	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	570	662	2,824	306,763	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	42	47	192	20,952	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	673	779	4,400	477,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	170	188	5,996	651,254	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	48	55	677	73,622	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	109	146	969	105,309	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	58	67	376	40,889	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	27	31	649	70,593	小売
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	59	68	522	56,723	運輸
CABOT OIL & GAS CORP	178	201	340	36,967	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	115	133	911	99,039	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	75	79	382	41,568	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	194	222	2,163	234,956	各種金融
CAPRI HOLDINGS LIMITED	61	71	260	28,324	耐久消費財・アパレル
CARDINAL HEALTH INC	123	142	792	86,030	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	72	79	795	86,398	小売
CARNIVAL CORP	172	199	887	96,423	消費者サービス
CATERPILLAR INC	243	272	3,897	423,354	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	46	53	655	71,140	各種金融
CBRE GROUP INC	131	150	840	91,330	不動産
CBS CORP-CL B	141	160	633	68,852	メディア・娯楽
CDK GLOBAL INC	50	58	304	33,085	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CDW CORP/DE	62	69	961	104,376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	55	60	758	82,338	素材
CELGENE CORP	288	335	3,630	394,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	169	196	1,169	126,987	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	208	240	609	66,214	公益事業
CENTURYLINK INC	405	474	715	77,744	電気通信サービス
CERNER CORP	121	154	1,052	114,347	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	95	106	486	52,811	素材
CHARLES SCHWAB CORP	501	571	2,538	275,743	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	66	75	3,610	392,185	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	51	57	677	73,579	ソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO/THE - W/I	70	－	－	－	素材
CHENIERE ENERGY INC	91	112	670	72,859	エネルギー
CHEVRON CORP	787	907	10,563	1,147,292	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	12	960	104,349	消費者サービス
CHUBB LTD	190	218	3,335	362,220	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	102	117	810	88,070	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	156	180	3,615	392,729	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	41	47	213	23,161	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	63	73	795	86,392	保険
CINTAS CORP	37	42	1,090	118,400	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,853	2,037	9,266	1,006,445	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	43	44	200	21,788	銀行
CITIGROUP INC	1,005	1,100	8,230	893,898	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	192	217	826	89,729	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	55	62	706	76,708	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	52	60	892	96,906	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	147	170	3,520	382,364	各種金融
CMS ENERGY CORP	117	136	836	90,812	公益事業
COCA-COLA CO	1,670	1,931	10,252	1,113,519	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	90	113	577	62,773	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	70	81	409	44,517	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	238	270	1,729	187,811	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	340	388	2,609	283,439	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	1,876	2,160	9,679	1,051,309	メディア・娯楽
COMERICA INC	66	72	504	54,829	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	78	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	200	231	679	73,821	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	82	95	675	73,367	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CONOCOPHILLIPS	474	537	3,070	333,535	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	127	155	1,353	147,041	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	68	79	1,440	156,426	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	38	43	129	14,060	エネルギー
COOPER COS INC/THE	20	23	728	79,119	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	86	98	847	92,025	商業・専門サービス
CORNING INC	329	372	1,079	117,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	－	359	923	100,265	素材
COSTAR GROUP INC	15	17	1,027	111,631	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	180	209	6,326	687,119	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	203	145	174	18,902	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	55	64	481	52,288	素材
CSX CORP	333	369	2,625	285,188	運輸
CUMMINS INC	62	71	1,299	141,145	資本財
CVS HEALTH CORP	533	618	4,663	506,501	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	－	18	211	22,961	ソフトウェア・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	146	168	100	10,929	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	259	306	4,404	478,419	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	51	58	664	72,218	消費者サービス
DAVITA INC	54	49	357	38,850	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	126	143	2,492	270,737	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	64	74	420	45,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	72	78	446	48,483	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	93	112	631	68,612	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	191	194	418	45,501	エネルギー
DEXCOM INC	36	43	946	102,843	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	64	74	552	60,006	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	138	154	1,292	140,411	各種金融
DISCOVERY INC-A	64	75	237	25,805	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	129	173	508	55,226	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP	95	110	396	43,074	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	－	49	332	36,064	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	109	123	1,948	211,664	小売
DOLLAR TREE INC	98	113	1,212	131,672	小売
DOMINION ENERGY INC	311	383	3,163	343,581	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	16	18	532	57,785	消費者サービス
DOVER CORP	60	69	753	81,796	資本財
DOW INC	315	357	1,910	207,500	素材
DR HORTON INC	147	169	916	99,533	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル 千円	
DROPBOX INC-CLASS A	—	—	91	174 18,961	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	75	75	87	1,082 117,624	公益事業
DUKE ENERGY CORP	294	294	347	3,020 328,099	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	946	946	357	2,360 256,426	素材
DXC TECHNOLOGY CO	115	115	127	471 51,172	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	103	103	114	515 56,005	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	58	58	66	296 32,248	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	57	57	65	512 55,654	素材
EATON CORP PLC	178	178	201	1,815 197,198	資本財
EATON VANCE CORP	46	46	52	251 27,298	各種金融
EBAY INC	376	376	393	1,379 149,862	小売
ECOLAB INC	107	107	123	2,343 254,479	素材
EDISON INTERNATIONAL	134	134	168	1,162 126,258	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	86	86	99	2,417 262,599	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	—	169	445 48,418	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	124	124	141	1,367 148,543	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	393	393	416	4,792 520,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	257	257	291	2,137 232,106	資本財
ENTERGY CORP	75	75	91	1,061 115,240	公益事業
EOG RESOURCES INC	238	238	275	1,941 210,850	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	—	—	25	542 58,874	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	49	49	57	815 88,544	商業・専門サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	—	12	216 23,472	保険
ESTEE LAUDER COS INC	90	90	104	2,046 222,227	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	16	16	19	519 56,436	保険
EVERGY INC	109	109	117	760 82,565	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	130	130	151	1,243 135,076	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	—	—	61	516 56,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	398	398	461	2,095 227,582	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	50	50	66	632 68,682	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	73	73	86	652 70,875	運輸
EXXON MOBIL CORP	1,745	1,745	2,014	13,661 1,483,822	エネルギー
F5 NETWORKS INC	24	24	27	400 43,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	990	990	1,144	22,805 2,476,959	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	—	18	471 51,157	各種金融
FASTENAL CO	118	118	271	969 105,273	資本財
FEDEX CORP	103	103	118	1,849 200,884	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	113	113	130	628 68,280	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	135	135	292	4,027 437,413	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FIFTH THIRD BANCORP	269	348	1,041	113,072	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	222	－	－	－	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	68	80	873	94,847	銀行
FIRSTENERGY CORP	212	254	1,180	128,252	公益事業
FISERV INC	164	274	3,182	345,614	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	36	41	1,241	134,871	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	216	244	292	31,739	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	57	64	343	37,281	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWERVE CORP	53	62	299	32,517	資本財
FLUOR CORP	57	67	117	12,762	資本財
FMC CORP	55	62	611	66,467	素材
FORD MOTOR CO	1,535	1,871	1,665	180,901	自動車・自動車部品
FORTINET INC	60	69	727	79,002	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	123	143	1,016	110,427	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	57	66	410	44,622	資本財
FOX CORP - CLASS A	140	165	600	65,228	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	58	87	309	33,585	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	124	141	392	42,661	各種金融
FREPORT-MCMORAN INC	565	687	775	84,277	素材
GAP INC	93	106	179	19,485	小売
GARMIN LTD	46	63	613	66,579	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	37	43	692	75,223	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	103	116	2,161	234,721	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	3,590	4,157	4,781	519,274	資本財
GENERAL MILLS INC	246	285	1,511	164,190	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	524	608	2,213	240,460	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	60	69	727	79,024	小売
GILEAD SCIENCES INC	533	605	3,934	427,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	65	139	2,543	276,273	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	41	48	482	52,386	保険
GODADDY INC - CLASS A	69	84	574	62,420	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	137	156	3,445	374,203	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	95	－	－	－	自動車・自動車部品
GRUBHUB INC	37	43	173	18,874	小売
H&R BLOCK INC	84	96	238	25,921	消費者サービス
HALLIBURTON CO	360	413	823	89,386	エネルギー
HANESBRANDS INC	149	172	258	28,103	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	66	75	279	30,369	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	48	－	－	－	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	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	147	171	1,064	115,575	保険
HASBRO INC	49	57	544	59,142	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	113	130	1,809	196,532	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	72	80	321	34,911	資本財
HEICO CORP	－	20	273	29,667	資本財
HEICO CORP-CLASS A	－	36	369	40,150	資本財
HELMERICH & PAYNE	45	51	199	21,663	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	62	70	491	53,329	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	58	70	1,046	113,643	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	109	129	859	93,369	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	605	634	1,107	120,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	115	131	1,318	143,165	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	67	76	402	43,681	エネルギー
HOLOGIC INC	119	127	603	65,507	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	465	523	11,832	1,285,160	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	305	346	6,241	677,910	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	481	563	305	33,203	不動産
HORMEL FOODS CORP	121	140	598	65,001	食品・飲料・タバコ
HP INC	651	715	1,439	156,360	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	56	64	2,159	234,557	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	439	499	738	80,178	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	17	19	504	54,830	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	32	37	848	92,102	メディア・娯楽
IDEX CORP	31	35	583	63,401	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	35	40	1,083	117,711	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	163	181	1,308	142,061	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	123	155	2,705	293,885	資本財
ILLUMINA INC	60	69	2,174	236,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	74	86	764	83,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	101	115	1,498	162,739	資本財
INGREDION INC	28	31	261	28,449	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,882	2,131	12,440	1,351,119	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	235	268	2,527	274,491	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	374	422	5,681	617,120	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	35	48	666	72,340	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	158	179	824	89,565	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	160	188	422	45,877	メディア・娯楽
INTUIT INC	101	123	3,353	364,215	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	46	54	3,168	344,147	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	
INVESCO LTD	168	188	330	35,887	各種金融
IONIS PHARMACEUTICALS INC	－	63	370	40,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPG PHOTONICS CORP	15	17	241	26,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	66	80	1,145	124,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	31	36	552	59,986	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	52	64	611	66,464	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	93	107	599	65,102	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	93	107	345	37,501	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	26	372	40,475	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	38	43	507	55,072	運輸
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	119	116	237	25,749	各種金融
JM SMUCKER CO	46	54	564	61,343	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,106	1,264	17,048	1,851,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	381	379	1,629	177,008	資本財
JONES LANG LASALLE INC	18	24	396	43,102	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,370	1,544	20,167	2,190,356	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	141	162	424	46,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	44	50	774	84,084	運輸
KELLOGG CO	107	122	797	86,665	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	425	479	915	99,443	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	77	89	969	105,331	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	143	164	2,184	237,211	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	824	975	1,952	212,014	エネルギー
KKR & CO INC -A	199	233	680	73,874	各種金融
KLA CORPORATION	67	76	1,354	147,084	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	57	66	244	26,542	運輸
KOHL'S CORP	68	77	365	39,649	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	252	320	1,004	109,089	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	327	383	1,029	111,854	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	96	111	191	20,829	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	32	－	－	－	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	－	105	2,144	232,864	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	41	46	803	87,244	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	63	71	1,969	213,869	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	60	69	585	63,599	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	160	164	1,020	110,818	消費者サービス
LEAR CORP	26	28	338	36,792	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	54	63	332	36,135	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	59	65	603	65,580	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LENNAR CORP-CL A	120	136	812	88,236	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	14	16	427	46,432	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	45	52	619	67,243	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	71	84	191	20,846	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	220	242	529	57,497	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	36	30	145	15,804	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	71	91	430	46,807	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	85	98	443	48,133	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	85	93	539	58,567	保険
LINDE PLC	227	258	5,369	583,230	素材
LIVE NATION INC	61	71	489	53,206	メディア・娯楽
LKQ CORP	130	147	520	56,544	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	105	121	4,744	515,292	資本財
LOEWS CORP	109	129	651	70,779	保険
LOWE'S COS INC	332	378	4,293	466,322	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	40	52	1,142	124,113	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	133	127	1,183	128,533	素材
M&T BANK CORP	55	61	1,006	109,291	銀行
MACY'S INC	126	146	220	23,940	小売
MANPOWER GROUP	24	27	257	27,943	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	340	385	442	48,015	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	284	315	1,952	212,112	エネルギー
MARKEL CORP	5	6	739	80,348	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	－	17	719	78,145	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	119	134	1,827	198,439	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	207	243	2,610	283,477	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	29	780	84,716	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	258	299	790	85,874	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	125	139	636	69,089	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	378	432	12,346	1,340,984	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	143	－	－	－	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	114	129	726	78,873	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	50	58	971	105,463	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	318	363	7,040	764,683	消費者サービス
MCKESSON CORP	80	90	1,360	147,781	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	554	638	7,095	770,652	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	102	100	219	23,803	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	17	21	1,135	123,375	小売
MERCK & CO INC	1,072	1,226	10,382	1,127,697	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	
METLIFE INC	343	382	1,880	204,260	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	10	11	861	93,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	205	242	770	83,653	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	97	113	1,054	114,531	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	466	526	2,451	266,278	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	3,007	3,467	52,142	5,663,177	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	23	26	304	33,069	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	29	405	44,012	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	78	90	472	51,270	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	598	685	3,611	392,225	食品・飲料・タバコ
MONGODDB INC	－	20	283	30,794	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	170	193	1,133	123,095	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	71	81	1,820	197,774	各種金融
MORGAN STANLEY	530	598	2,953	320,831	各種金融
MOSAIC CO/THE	150	174	327	35,561	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67	78	1,307	141,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	36	40	1,038	112,791	各種金融
MYLAN NV	211	244	422	45,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	47	55	581	63,117	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	157	183	386	42,017	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	71	83	153	16,676	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	103	117	738	80,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	179	208	6,304	684,783	メディア・娯楽
NEWELL BRANDS INC	193	192	376	40,933	耐久消費財・アパレル
NEWMONT GOLDCORP CORP	218	389	1,493	162,163	素材
NEWS CORP - CLASS A	164	184	238	25,855	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	196	228	5,309	576,617	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	147	171	349	37,920	商業・専門サービス
NIKE INC	524	598	5,598	608,026	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	154	178	465	50,585	公益事業
NOBLE ENERGY INC	197	227	444	48,261	エネルギー
NORDSTROM INC	48	51	183	19,922	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	114	128	2,479	269,302	運輸
NORTHERN TRUST CORP	86	98	1,051	114,173	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	68	76	2,720	295,434	資本財
NORTONLIFELOCK INC	263	294	726	78,937	ソフトウェア・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	90	101	545	59,253	消費者サービス
NRG ENERGY INC	119	126	498	54,165	公益事業
NUCOR CORP	129	143	788	85,611	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	238	275	5,729	622,281	半導体・半導体製造装置
NVR INC	1	1	596	64,746	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	142	136	1,550	168,428	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	311	426	1,625	176,598	エネルギー
OGE ENERGY CORP	82	94	404	43,899	公益事業
OKTA INC	－	49	626	68,043	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	26	32	623	67,716	運輸
OMNICOM GROUP	94	106	839	91,168	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	173	196	414	44,973	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	170	197	1,376	149,479	エネルギー
ORACLE CORP	1,093	1,139	6,411	696,348	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	33	37	1,659	180,198	小売
OWENS CORNING	44	51	342	37,244	資本財
PACCAR INC	144	165	1,310	142,369	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	38	44	508	55,177	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	39	45	1,140	123,857	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	54	60	1,192	129,508	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	103	133	200	21,828	エネルギー
PAYCHEX INC	133	154	1,321	143,501	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	－	23	570	61,984	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	461	531	5,580	606,121	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	67	76	332	36,089	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	156	187	306	33,253	銀行
PEPSICO INC	582	667	8,984	975,828	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	－	52	478	51,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PERRIGO CO PLC	53	61	300	32,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,384	2,644	9,958	1,081,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	641	741	6,184	671,713	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	180	215	2,534	275,273	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	45	53	460	49,992	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	70	80	1,037	112,680	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	65	76	130	14,161	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	190	215	3,261	354,283	銀行
POLARIS INC	24	27	281	30,566	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	99	112	1,448	157,279	素材
PPL CORPORATION	297	343	1,153	125,328	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	116	132	723	78,591	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,028	1,195	14,511	1,576,134	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	240	277	1,987	215,824	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	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	169	192	1,794	194,923	保険
PTC INC	46	52	382	41,526	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	208	240	1,455	158,063	公益事業
PULTE GROUP INC	109	125	495	53,865	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	31	35	343	37,329	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	51	56	585	63,598	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	500	579	5,096	553,510	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	56	63	668	72,590	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	172	189	187	20,373	小売
RALPH LAUREN CORP	22	24	273	29,671	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	52	59	530	57,666	各種金融
RAYTHEON CO	117	133	2,905	315,554	資本財
RED HAT INC	73	－	－	－	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	32	38	1,321	143,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	422	478	790	85,882	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	25	29	482	52,371	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	16	21	396	43,112	保険
REPUBLIC SERVICES INC	94	108	948	102,998	商業・専門サービス
RESMED INC	58	68	1,023	111,110	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	49	54	321	34,944	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	49	56	1,104	119,959	資本財
ROKU INC	－	39	602	65,427	メディア・娯楽
ROLLINS INC	59	69	254	27,634	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	42	49	1,731	188,107	資本財
ROSS STORES INC	153	174	1,962	213,161	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	68	84	1,003	108,968	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	103	117	3,142	341,294	各種金融
SABRE CORP	114	131	296	32,221	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	315	396	6,492	705,184	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	－	35	348	37,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER LTD	571	659	2,261	245,618	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	112	118	707	76,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	65	74	284	30,865	素材
SEATTLE GENETICS INC	46	53	635	68,969	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	52	59	372	40,507	各種金融
SEMPRA ENERGY	112	130	1,926	209,225	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	67	76	400	43,527	資本財
SERVICENOW INC	74	88	2,447	265,786	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34	39	2,316	251,642	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	
SIGNATURE BANK	22	26	329	35,773	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	705	783	546	59,330	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	73	82	793	86,135	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	58	66	320	34,768	資本財
SNAP INC - A	－	331	501	54,503	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	23	26	421	45,772	資本財
SOUTHERN CO	426	497	3,092	335,899	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	58	63	368	39,984	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	43	48	443	48,220	資本財
SPLUNK INC	60	71	892	96,968	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	351	400	230	24,984	電気通信サービス
SQUARE INC - A	127	160	1,063	115,551	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	93	109	650	70,672	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	62	71	1,125	122,208	資本財
STARBUCKS CORP	512	577	4,828	524,398	消費者サービス
STATE STREET CORP	155	176	1,296	140,789	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	94	105	330	35,890	素材
STERIS PLC	－	40	612	66,564	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	138	160	3,319	360,554	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	184	211	1,492	162,136	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	21	24	561	60,993	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	266	295	1,090	118,475	各種金融
SYNOPSYS INC	60	70	1,005	109,200	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	203	232	1,868	202,991	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	97	110	1,351	146,765	各種金融
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	29	－	－	－	ソフトウェア・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	47	53	664	72,184	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	119	138	373	40,513	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	96	114	423	46,048	エネルギー
TARGET CORP	204	244	2,706	293,954	小売
TE CONNECTIVITY LTD	140	159	1,480	160,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	176	204	393	42,767	エネルギー
TELEFLEX INC	18	22	780	84,775	ヘルスケア機器・サービス
TESLA, INC.	53	62	2,248	244,163	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	399	520	535	58,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	396	446	5,264	571,790	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	99	109	509	55,322	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	165	190	5,835	633,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	44	51	637	69,199	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	
TJX COS INC	509	576	3,496	379,774	小売
T-MOBILE US INC	141	164	1,267	137,655	電気通信サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	67	－	－	－	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	50	57	552	60,006	小売
TRANSDIGM GROUP INC	19	22	1,299	141,125	資本財
TRANSUNION	76	89	769	83,611	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	108	124	1,685	183,065	保険
TRIMBLE INC	102	119	468	50,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	43	50	143	15,575	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	－	53	547	59,502	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	283	347	1,024	111,230	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	121	140	1,270	138,013	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	－	92	250	27,193	運輸
UGI CORP	72	99	437	47,470	公益事業
ULTA BEAUTY INC	23	26	633	68,752	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	78	89	154	16,789	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	78	93	146	15,868	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	305	339	6,009	652,741	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	28	30	288	31,359	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	287	333	4,020	436,613	運輸
UNITED RENTALS INC	33	37	565	61,372	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	338	390	5,789	628,754	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	17	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	396	452	12,408	1,347,731	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	35	39	556	60,475	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	87	96	282	30,715	保険
US BANCORP	632	719	4,276	464,440	銀行
VAIL RESORTS INC	16	19	461	50,119	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	174	198	1,938	210,502	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	37	42	552	59,961	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	51	60	926	100,597	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	44	50	986	107,096	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	64	74	1,068	116,015	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,707	1,973	11,740	1,275,178	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	105	121	2,622	284,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	139	160	1,387	150,695	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	148	170	401	43,607	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	725	827	15,132	1,643,574	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	135	172	456	49,570	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
VMWARE INC-CLASS A	33	39	680	73,953	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	63	67	388	42,212	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	54	62	888	96,534	素材
WABCO HOLDINGS INC	21	24	329	35,781	資本財
WABTEC CORP	56	86	688	74,739	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	332	369	2,267	246,300	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	598	682	8,184	888,921	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	813	857	12,723	1,381,860	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	109	126	1,143	124,203	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	176	203	2,284	248,128	商業・専門サービス
WATERS CORP	31	32	722	78,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	24	29	244	26,544	小売
WEC ENERGY GROUP INC	131	151	1,332	144,706	公益事業
WELLCARE HEALTH PLANS INC	20	23	762	82,810	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	1,843	2,033	10,986	1,193,210	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	119	139	664	72,168	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	185	207	567	61,661	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	15	18	126	13,782	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	104	122	487	52,974	素材
WEYERHAEUSER CO	309	355	1,055	114,628	不動産
WHIRLPOOL CORP	26	30	424	46,119	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	503	582	1,289	140,009	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	53	61	1,171	127,230	保険
WIX.COM LTD	18	22	289	31,463	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	61	77	1,290	140,149	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC	124	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	60	70	487	52,952	保険
WW GRAINGER INC	19	22	707	76,888	資本財
WYNN RESORTS LTD	40	45	552	60,025	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	211	245	1,503	163,269	公益事業
XEROX CORP	87	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XEROX HOLDINGS CORP	—	95	370	40,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	104	121	1,123	122,016	半導体・半導体製造装置
XPO LOGISTICS INC	53	45	377	40,974	運輸
XYLEM INC	73	85	663	72,067	資本財
YUM! BRANDS INC	128	145	1,431	155,430	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	85	114	394	42,824	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	25	606	65,849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ZILLOW GROUP INC - C W/I		52	60	229	24,884	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		84	97	1,412	153,389	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.		78	85	420	45,684	銀行
ZOETIS INC		198	228	2,746	298,327	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	125,168	143,996	1,265,667	137,464,099	
	銘柄数<比率>	597	610	－	<65.1%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		96	112	896	73,318	素材
AIR CANADA		－	63	315	25,825	運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		180	416	1,751	143,321	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		113	134	267	21,895	公益事業
ARC RESOURCES LTD		146	－	－	－	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'		32	37	186	15,252	公益事業
AURORA CANNABIS INC		289	340	105	8,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF MONTREAL		264	304	3,083	252,306	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		505	582	4,452	364,312	銀行
BARRICK GOLD CORP		721	834	1,889	154,616	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC		129	150	563	46,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC		69	79	513	42,003	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD		209	246	174	14,289	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC		884	1,027	212	17,401	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC		350	405	3,079	251,968	各種金融
CAE INC		111	128	453	37,066	資本財
CAMECO CORP		163	189	236	19,353	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		182	211	2,438	199,517	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO		303	347	4,268	349,215	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		496	569	2,108	172,492	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		60	68	2,158	176,619	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		25	27	433	35,466	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		56	65	257	21,041	公益事業
CANOPY GROWTH CORP		85	99	201	16,519	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		62	71	409	33,508	素材
CENOVUS ENERGY INC		430	496	586	48,002	エネルギー
CGI INC		101	115	1,268	103,800	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP		95	108	227	18,632	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC		8	9	1,307	106,944	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC		－	88	78	6,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC		125	143	675	55,236	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
EMERA INC	27	117	641	52,464	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	72	83	284	23,253	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	835	966	4,825	394,855	エネルギー
ENCANA CORP	609	662	348	28,507	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	11	13	790	64,657	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	69	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	80	90	196	16,109	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	283	325	390	31,983	素材
FORTIS INC	180	209	1,121	91,738	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	76	88	1,163	95,207	素材
GEORGE WESTON LTD	32	37	390	31,974	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	86	98	354	29,017	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	124	134	445	36,433	保険
HUSKY ENERGY INC	144	164	158	12,946	エネルギー
HYDRO ONE LTD	139	161	401	32,825	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	45	50	342	28,058	保険
IGM FINANCIAL INC	36	42	163	13,393	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	114	127	420	34,392	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	58	66	902	73,829	保険
INTER PIPELINE LTD	169	197	439	35,927	エネルギー
KEYERA CORP	88	102	348	28,477	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	515	596	338	27,721	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	94	612	50,141	素材
LOBLAW COS LTD	77	88	619	50,668	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	267	310	229	18,801	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	130	146	1,076	88,106	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	815	934	2,437	199,458	保険
METHANEX CORP	25	31	155	12,754	素材
METRO INC	100	121	673	55,104	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	140	162	1,137	93,078	銀行
NEWMONT GOLDCORP CORP	115	—	—	—	素材
NUTRIEN LTD	254	279	1,764	144,368	素材
ONEX CORPORATION	37	41	334	27,352	各種金融
OPEN TEXT CORP	111	129	746	61,112	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	211	245	1,180	96,561	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	149	146	473	38,759	保険
POWER FINANCIAL CORP	106	129	425	34,789	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	87	101	137	11,242	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	—	92	310	25,416	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
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
RESTAURANT BRANDS INTERN		99	115	1,012	82,802	消費者サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC		154	176	1,119	91,606	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA		593	683	7,442	608,948	銀行	
SAPUTO INC		96	111	449	36,773	食品・飲料・タバコ	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		111	－	－	－	エネルギー	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		200	231	637	52,196	メディア・娯楽	
SHOPIFY INC - CLASS A		37	47	1,988	162,682	ソフトウェア・サービス	
SNC-LAVALIN GROUP INC		73	86	215	17,637	資本財	
STARS GROUP INC/THE		71	109	333	27,255	消費者サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC		247	281	1,725	141,155	保険	
SUNCOR ENERGY INC		660	746	3,113	254,720	エネルギー	
TC ENERGY CORP		379	444	3,019	247,025	エネルギー	
TECK RESOURCES LTD-CL B		208	235	503	41,161	素材	
THOMSON REUTERS CORP		85	96	920	75,302	商業・専門サービス	
TORONTO-DOMINION BANK		754	871	6,705	548,624	銀行	
TOURMALINE OIL CORP		106	122	154	12,600	エネルギー	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		417	－	－	－	素材	
VERMILION ENERGY INC		61	73	140	11,517	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD		22	25	152	12,446	素材	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		183	212	783	64,105	素材	
WSP GLOBAL INC		43	50	430	35,250	資本財	
小計	株数・金額	17,346	19,592	92,232	7,546,455		
	銘柄数<比率>	87	86	－	<3.6%>		
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル			
AGL ENERGY LTD		283	332	674	49,979	公益事業	
ALUMINA LTD		1,080	1,281	316	23,473	素材	
AMCOR LTD		512	－	－	－	素材	
AMP LTD		1,272	1,719	347	25,758	各種金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD		244	282	899	66,653	消費者サービス	
ASX LTD		90	103	842	62,431	各種金融	
AURIZON HOLDINGS LTD		940	1,103	637	47,280	運輸	
AUSNET SERVICES		1,056	1,291	227	16,894	公益事業	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		1,197	1,373	3,492	258,939	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD		196	240	207	15,380	銀行	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		227	275	295	21,934	銀行	
BHP GROUP LIMITED		1,228	1,424	5,336	395,663	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD		227	259	364	27,053	素材	
BORAL LTD		521	612	308	22,850	素材	
BRAMBLES LTD		688	798	992	73,566	商業・専門サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	117	133	379	28,103	エネルギー
CHALLENGER LTD	240	281	235	17,426	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED	45	53	179	13,301	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED	246	282	324	24,073	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	24	28	653	48,451	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	473	556	875	64,874	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	738	854	6,894	511,167	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	206	259	435	32,308	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	183	214	274	20,359	消費者サービス
CSL LIMITED	188	217	5,977	443,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	27	—	—	—	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	25	29	125	9,322	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	663	686	637	47,297	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	283	299	129	9,600	小売
INCITEC PIVOT LTD	745	875	291	21,606	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	998	1,153	909	67,404	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	193	222	633	46,956	素材
MACQUARIE GROUP LTD	137	159	2,203	163,383	各種金融
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	62	320	23,777	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,206	1,395	446	33,100	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,160	1,374	3,747	277,810	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	325	375	1,176	87,232	素材
OIL SEARCH LTD	604	713	525	38,941	エネルギー
ORICA LTD	173	201	479	35,551	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	740	869	720	53,421	エネルギー
QBE INSURANCE GROUP LTD	576	659	838	62,191	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	63	74	548	40,685	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	24	27	287	21,285	メディア・娯楽
RIO TINTO LTD	156	181	1,727	128,090	素材
SANTOS LTD	752	882	718	53,264	エネルギー
SEEK LTD	153	175	406	30,142	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	197	237	706	52,397	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	2,120	2,453	659	48,930	素材
SUNCORP GROUP LTD	575	647	864	64,076	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	855	1,066	519	38,519	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	1,804	2,115	761	56,456	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	175	212	140	10,416	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	304	352	656	48,648	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	52	71	154	11,431	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
(オーストラリア)		百株	百株	千円	千円		
WESFARMERS LIMITED		483	558	2,379	176,434	小売	
WESTPAC BANKING CORP		1,437	1,671	4,438	329,034	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD		397	465	1,601	118,725	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD		562	617	2,432	180,378	食品・生活必需品小売り	
WORLEY LIMITED		138	172	238	17,703	エネルギー	
小計	株数・金額	30,353	35,046	63,600	4,715,336		
	銘柄数<比率>	58	57	－	<2.2%>		
(香港)				千香港ドル			
AIA GROUP LTD		4,986	5,766	45,845	636,337	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		128	147	1,556	21,607	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA		546	644	1,163	16,143	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,540	1,780	4,824	66,969	銀行	
CK ASSET HOLDINGS LTD		1,074	1,229	6,624	91,952	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1,129	1,304	9,539	132,407	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		285	325	1,797	24,945	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD		686	791	6,438	89,363	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		978	1,028	5,515	76,558	消費者サービス	
HANG LUNG GROUP LTD		370	－	－	－	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD		851	991	1,640	22,763	不動産	
HANG SENG BANK LTD		319	369	6,046	83,921	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		550	716	2,740	38,034	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS		3,886	4,900	7,438	103,252	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		493	572	14,405	199,951	各種金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO		270	300	924	12,825	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD		270	320	830	11,525	不動産	
MGM CHINA HOLDINGS LTD		400	464	553	7,676	消費者サービス	
MINTH GROUP LTD		300	－	－	－	自動車・自動車部品	
MTR CORP		677	772	3,387	47,020	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT		2,536	2,946	3,176	44,090	不動産	
NWS HOLDINGS LTD		670	780	912	12,666	資本財	
PCCW LTD		2,160	2,490	1,152	16,001	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		580	670	3,719	51,633	公益事業	
SANDS CHINA LTD		1,001	1,161	4,449	61,761	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD		540	620	515	7,151	消費者サービス	
SINO LAND CO		1,360	1,480	1,725	23,952	不動産	
SJM HOLDINGS LTD		830	960	802	11,139	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		660	760	8,423	116,916	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD		208	238	1,674	23,237	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD		484	560	1,338	18,576	不動産	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		565	655	4,031	55,957	資本財
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		－	340	1,108	15,384	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD		3,665	4,560	3,912	54,305	食品・飲料・タバコ
WHARF HOLDINGS LTD		507	597	1,103	15,321	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		507	577	2,572	35,699	不動産
WHEELOCK & CO LTD		340	390	1,922	26,687	不動産
WYNN MACAU LTD		649	749	1,300	18,048	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		310	365	852	11,829	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	37,318	43,324	165,966	2,303,618	
	銘柄数<比率>	38	37	－	<1.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD		1,052	1,218	448	35,768	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		159	206	223	17,836	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		922	1,076	253	20,264	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD		739	853	2,255	179,975	銀行
GENTING SINGAPORE LTD		2,453	2,812	265	21,205	消費者サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		2,704	3,090	74	5,917	食品・飲料・タバコ
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		41	47	149	11,904	小売
KEPPEL CORP LTD		603	692	474	37,826	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		1,312	1,514	1,683	134,348	銀行
SATS LTD		315	360	181	14,507	運輸
SEBMCORP INDUSTRIES LTD		415	476	107	8,584	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		233	265	242	19,349	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		333	384	340	27,149	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		701	799	177	14,154	メディア・娯楽
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		673	770	321	25,684	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		3,432	3,953	1,261	100,628	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		552	598	1,594	127,270	銀行
UOL Group Limited		191	209	166	13,325	不動産
VENTURE CORP LTD		112	131	208	16,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		804	927	383	30,625	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING		978	1,132	119	9,575	資本財
小計	株数・金額	18,724	21,512	10,933	872,504	
	銘柄数<比率>	21	21	－	<0.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
A2 MILK CO LTD		301	350	494	34,535	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		428	494	444	30,996	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
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		235	273	560	39,109	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD		358	415	216	15,128	素材	
MERIDIAN ENERGY LTD		555	631	281	19,624	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD		169	195	276	19,315	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD		799	921	410	28,630	電気通信サービス	
小計	株数・金額	2,850	3,283	2,683	187,339		
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.1%>		
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
3I GROUP PLC		395	458	484	67,946	各種金融	
ADMIRAL GROUP PLC		85	91	188	26,412	保険	
ANGLO AMERICAN PLC		431	495	1,014	142,365	素材	
ANTOFAGASTA PLC		158	180	162	22,741	素材	
ASHTED GROUP PLC		196	221	520	73,101	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		146	168	410	57,535	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC		523	625	4,572	641,708	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		388	442	237	33,289	メディア・娯楽	
AVIVA PLC		1,610	1,855	776	108,898	保険	
BABCOCK INTL GROUP PLC		101	－	－	－	商業・専門サービス	
BAE SYSTEMS PLC		1,321	1,526	883	123,978	資本財	
BARCLAYS PLC		7,056	8,197	1,396	196,026	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		420	486	317	44,493	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		50	58	263	36,963	耐久消費財・アパレル	
BHP GROUP PLC		868	1,002	1,708	239,810	素材	
BP PLC		8,280	9,699	4,868	683,138	エネルギー	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		945	1,092	3,157	443,116	食品・飲料・タバコ	
BT GROUP PLC		3,514	4,058	771	108,260	電気通信サービス	
BUNZL PLC		140	161	331	46,492	資本財	
BURBERRY GROUP PLC		168	195	405	56,886	耐久消費財・アパレル	
CARNIVAL PLC		68	76	247	34,684	消費者サービス	
CENTRICA PLC		2,373	2,772	203	28,598	公益事業	
COCA-COLA HBC AG-CDI		83	94	229	32,160	食品・飲料・タバコ	
COMPASS GROUP PLC		655	756	1,530	214,834	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC		579	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC		52	60	292	41,081	素材	
DCC PLC		40	46	309	43,442	資本財	
DIAGEO PLC		1,000	1,132	3,530	495,389	食品・飲料・タバコ	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		570	648	179	25,140	保険	
EASYJET PLC		69	77	103	14,565	運輸	
EVRAZ PLC		－	246	89	12,489	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
EXPERIAN PLC	374	433	1,074	150,751	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	95	110	742	104,191	資本財
FRESNILLO PLC	91	106	66	9,331	素材
G4S PLC	641	748	155	21,835	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,050	2,379	4,083	573,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	4,632	5,221	1,257	176,524	素材
GVC HOLDINGS PLC	228	277	237	33,330	消費者サービス
HALMA PLC	－	180	371	52,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	115	134	244	34,299	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	8,272	9,653	5,606	786,696	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	394	456	810	113,745	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	524	604	476	66,799	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	70	82	395	55,550	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	66	76	423	59,435	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	280	321	140	19,710	各種金融
ITV PLC	1,533	1,752	239	33,573	メディア・娯楽
JOHNSON MATTHEY PLC	79	90	290	40,801	素材
KINGFISHER PLC	869	987	206	28,924	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,457	2,839	792	111,258	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	29,375	33,828	2,009	281,983	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	129	150	1,037	145,641	各種金融
M&G PLC	－	1,213	283	39,753	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	673	923	171	24,097	小売
MEGGITT PLC	319	368	235	33,009	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,008	2,332	522	73,322	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	292	－	－	－	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	145	164	170	23,987	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	149	227	380	53,429	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	924	1,123	224	31,520	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	1,401	1,626	1,461	205,111	公益事業
NEXT PLC	57	64	427	60,007	小売
NMC HEALTH PLC	43	44	116	16,358	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	－	217	253	35,575	小売
PEARSON PLC	323	372	248	34,863	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	130	151	373	52,475	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,064	1,213	1,600	224,570	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	277	337	1,999	280,554	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	813	931	1,743	244,637	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	－	889	396	55,593	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円		
RIO TINTO PLC		474	539	2,271	318,793	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		699	821	598	84,051	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT		48,600	－	－	－	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT		－	37,783	3	530	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC		1,976	2,295	511	71,750	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,861	2,068	4,729	663,662	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,542	1,787	4,053	568,862	エネルギー	
ROYAL MAIL PLC		381	－	－	－	運輸	
RSA INSURANCE GROUP PLC		425	489	265	37,190	保険	
SAGE GROUP PLC		446	517	383	53,862	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC		726	834	177	24,869	食品・生活必需品小売り	
SCHRODERS PLC		50	58	190	26,719	各種金融	
SEVERN TRENT PLC		98	113	267	37,583	公益事業	
SMITH & NEPHEW PLC		361	417	694	97,440	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC		163	188	311	43,761	資本財	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		－	35	300	42,233	資本財	
SSE PLC		426	494	651	91,398	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC		224	257	273	38,401	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC		1,160	1,331	927	130,121	銀行	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		1,044	1,157	364	51,102	各種金融	
TAYLOR WIMPEY PLC		1,361	1,564	271	38,167	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC		4,041	4,663	1,096	153,840	食品・生活必需品小売り	
TUI AG-DI		182	210	223	31,431	消費者サービス	
UNILEVER PLC		458	529	2,411	338,419	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC		283	326	286	40,156	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC		11,106	12,785	1,958	274,866	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE		101	122	173	24,349	資本財	
WHITBREAD PLC		75	62	278	39,052	消費者サービス	
WOOD GROUP (JOHN) PLC		281	326	114	16,088	エネルギー	
WPP PLC		524	605	592	83,133	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	172,285 93	181,958 95	84,841 －	11,905,873 <5.6%>		
(イスラエル)				千イスラエル・シェケル			
AZRIELI GROUP		17	20	544	17,056	不動産	
BANK HAPOALIM BM		441	542	1,543	48,389	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		617	714	1,788	56,060	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		899	－	－	－	電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD		9	11	647	20,301	資本財	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		292	337	525	16,469	素材	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		－	555	859	26,957	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		59	68	610	19,131	銀行	
NICE LTD		25	29	1,535	48,142	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	2,362	2,281	8,054	252,509		
	銘柄数<比率>	8	8	－	<0.1%>		
(スイス)				千スイス・フラン			
ABB LTD		759	878	1,907	209,100	資本財	
ADECCO GROUP AG-REG		63	74	455	49,898	商業・専門サービス	
ALCON INC		178	197	1,151	126,189	ヘルスケア機器・サービス	
BALOISE HOLDING AG		19	23	410	44,986	保険	
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.91	1	205	22,502	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.44	0.51	376	41,282	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.04	0.05	414	45,378	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		214	248	1,864	204,371	耐久消費財・アパレル	
CLARIANT AG		81	95	196	21,552	素材	
CREDIT SUISSE GROUP AG		1,053	1,215	1,575	172,657	各種金融	
DUFREY AG-REG		13	20	199	21,852	小売	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		3	3	238	26,104	素材	
GEBERIT AG-REG		15	17	924	101,297	資本財	
GIVAUDAN-REG		3	4	1,281	140,498	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD		92	106	494	54,148	各種金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		23	27	439	48,216	運輸	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		200	230	1,190	130,531	素材	
LONZA GROUP AG		30	35	1,179	129,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA		1,263	1,459	15,185	1,664,457	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG		894	1,023	9,130	1,000,770	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARGESA HOLDING SA-BR		15	18	145	15,973	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		7	8	720	78,973	各種金融	
ROCHE HOLDING AG		289	334	10,100	1,107,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		9	10	244	26,782	資本財	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		15	18	455	49,948	資本財	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		2	2	646	70,877	商業・専門サービス	
SIKA AG-BEARER		52	60	1,047	114,795	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG		22	26	575	63,036	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG		4	4	443	48,650	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG		12	13	365	40,083	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		14	16	811	88,942	保険	
SWISS PRIME SITE-REG		32	37	398	43,635	不動産	
SWISS RE AG		126	146	1,557	170,721	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
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SWISSCOM AG		11	12	659	72,339	電気通信サービス	
TEMENOS GROUP AG-REG		24	30	449	49,322	ソフトウェア・サービス	
THE SWATCH GROUP AG-REG		23	29	156	17,113	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG		1,590	1,840	2,207	241,946	各種金融	
VIFOR PHARMA AG		18	21	349	38,301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		62	72	2,833	310,530	保険	
小計	株数・金額	7,251	8,369	62,988	6,904,145		
	銘柄数<比率>	39	39	－	<3.3%>		
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S		2	3	2,881	46,396	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S		1	2	1,839	29,608	運輸	
CARLSBERG AS-B		44	50	4,936	79,470	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S		40	50	2,577	41,504	素材	
COLOPLAST-B		48	56	4,542	73,138	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S		295	308	2,812	45,282	銀行	
DEMANT A/S		41	51	1,027	16,543	ヘルスケア機器・サービス	
DSV PANALPINA A/S		78	105	7,755	124,856	運輸	
GENMAB A/S		25	30	4,662	75,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
H LUNDBECK A/S		28	33	797	12,846	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S		69	75	1,142	18,391	商業・専門サービス	
NOVO-NORDISK A/S		748	841	32,356	520,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S		89	100	3,154	50,794	素材	
ORSTED A/S		78	90	5,519	88,869	公益事業	
PANDORA A/S		45	47	1,316	21,203	耐久消費財・アパレル	
TRYGVESTA AS		52	59	1,081	17,418	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		80	90	5,759	92,729	資本財	
小計	株数・金額	1,771	1,998	84,165	1,355,063		
	銘柄数<比率>	17	17	－	<0.6%>		
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ			
AKER BP ASA		44	52	1,380	16,415	エネルギー	
DNB ASA		398	462	7,665	91,146	銀行	
EQUINOR ASA		479	475	8,263	98,254	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		84	98	1,678	19,959	保険	
MOWI ASA		182	210	4,706	55,961	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA		552	636	2,112	25,115	素材	
ORKLA ASA		340	368	3,238	38,505	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA-B SHS		41	47	1,183	14,075	メディア・娯楽	
TELENOR ASA		311	360	6,042	71,844	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	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
YARA INTERNATIONAL ASA		73	85	2,907	34,566	素材
小計	株数・金額	2,510	2,798	39,179	465,845	
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ		
ALFA LAVAL AB		122	150	3,481	39,207	資本財
ASSA ABLOY AB		415	479	10,973	123,561	資本財
ATLAS COPCO AB		159	184	5,828	65,623	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		277	319	11,502	129,519	資本財
BOLIDEN AB		111	127	3,324	37,430	素材
ELECTROLUX AB		99	108	2,654	29,885	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		274	317	3,509	39,516	資本財
EPIROC AB-B		160	185	1,982	22,319	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		252	291	8,898	100,195	家庭用品・パーソナル用品
HENNES & MAURITZ AB		362	383	7,029	79,150	小売
HEXAGON AB-B SHS		107	124	6,518	73,403	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS		175	201	1,537	17,306	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB		35	45	1,881	21,186	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		73	77	1,766	19,893	各種金融
INVESTOR AB		187	217	10,977	123,607	各種金融
KINNEVIK AB - B		101	117	2,571	28,952	各種金融
KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE		－	117	657	7,403	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS		29	35	1,386	15,613	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB		78	90	2,701	30,423	エネルギー
NORDEA BANK ABP		1,263	1,554	10,918	122,947	銀行
SANDVIK AB		465	535	9,342	105,199	資本財
SECURITAS AB		133	152	2,438	27,462	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		684	790	6,482	72,997	銀行
SKANSKA AB-B SHS		143	163	3,485	39,249	資本財
SKF AB		157	181	3,281	36,948	資本財
SVENSKA HANDELSBANKEN		639	742	7,113	80,102	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		379	436	5,684	64,011	銀行
SWEDISH MATCH AB		73	81	3,710	41,774	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB		217	250	3,521	39,653	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		1,273	1,469	12,941	145,718	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		1,215	1,367	5,779	65,081	電気通信サービス
VOLVO AB		647	708	10,494	118,173	資本財
小計	株数・金額	10,318	12,010	174,380	1,963,520	
	銘柄数<比率>	31	32	－	<0.9%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			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		
AIB GROUP PLC		347	383	107	12,961	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		415	454	195	23,529	銀行	
CRH PLC		340	381	1,282	154,332	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.		33	36	365	44,013	消費者サービス	
KERRY GROUP PLC-A		66	75	874	105,178	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC		65	73	363	43,730	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		94	107	339	40,884	素材	
小計	株数・金額	1,363	1,512	3,529	424,629		
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.2%>		
(ユーロ／オランダ)							
ABN AMRO BANK NV		176	203	329	39,635	銀行	
ADYEN NV		3	4	323	38,970	ソフトウェア・サービス	
AEGON NV		729	841	350	42,176	保険	
AIRBUS SE		240	278	3,763	452,857	資本財	
AKZO NOBEL NV		93	108	957	115,204	素材	
ASML HOLDING NV		168	202	4,961	596,933	半導体・半導体製造装置	
CNH INDUSTRIAL NV		419	485	479	57,679	資本財	
EXOR NV		44	51	362	43,662	各種金融	
FERRARI NV		50	58	861	103,657	自動車・自動車部品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		445	515	728	87,611	自動車・自動車部品	
HEINEKEN HOLDING NV		47	54	481	57,887	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN NV		106	123	1,156	139,183	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA		1,600	1,849	1,948	234,432	銀行	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		489	564	1,355	163,038	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE DSM NV		74	86	1,006	121,102	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		381	440	1,812	218,063	ヘルスケア機器・サービス	
NN GROUP NV		126	143	505	60,823	保険	
QIAGEN NV		95	107	400	48,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RANDSTAD NV		48	55	284	34,251	商業・専門サービス	
ROYAL KPN NV		1,430	1,754	487	58,656	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV		282	324	710	85,428	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV		637	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品	
UNILEVER NV		－	695	3,721	447,830	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK		29	33	168	20,309	エネルギー	
WOLTERS KLUWER NV		115	133	866	104,296	商業・専門サービス	
小計	株数・金額	7,836	9,116	28,024	3,371,936		
	銘柄数<比率>	24	24	－	<1.6%>		

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		74	84	451	54,380	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		314	362	2,602	313,167	食品・飲料・タバコ	
COLRUYT NV		24	26	124	15,038	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		33	37	352	42,437	各種金融	
KBC GROEP NV		102	118	798	96,082	銀行	
PROXIMUS		67	77	213	25,643	電気通信サービス	
SOLVAY SA		30	35	358	43,122	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV		23	23	101	12,160	メディア・娯楽	
UCB SA		52	59	435	52,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE		86	93	372	44,799	素材	
小計	株数・金額	809	919	5,811	699,189		
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.3%>		
(ユーロ／ルクセンブルグ)							
ARCELORMITTAL		271	312	461	55,508	素材	
RTL GROUP		17	19	84	10,149	メディア・娯楽	
TENARIS SA		193	219	210	25,384	エネルギー	
小計	株数・金額	482	551	756	91,042		
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.0%>		
(ユーロ／フランス)							
ACCOR		79	87	349	42,021	消費者サービス	
ADP		13	14	262	31,556	運輸	
AIR LIQUIDE		177	225	2,739	329,657	素材	
ALSTOM RGPT		65	75	293	35,309	資本財	
AMUNDI SA		25	29	199	23,971	各種金融	
ARKEMA		27	32	308	37,068	素材	
ATOS SE		39	46	338	40,746	ソフトウェア・サービス	
AXA		797	923	2,321	279,375	保険	
BIOMERIEUX		17	19	156	18,794	ヘルスケア機器・サービス	
BNP PARIBAS		462	534	2,714	326,573	銀行	
BOLLORE		391	453	179	21,557	運輸	
BOUYGUES		91	106	396	47,708	資本財	
BUREAU VERITAS SA		111	138	322	38,820	商業・専門サービス	
CAPGEMINI SA		65	75	816	98,199	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA		245	282	430	51,832	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON		23	26	118	14,228	食品・生活必需品小売り	
CIE DE SAINT-GOBAIN		203	233	863	103,906	資本財	
CNP ASSURANCES		73	83	147	17,759	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	
(ユーロ／フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CREDIT AGRICOLE SA	474	547	687	82,687	銀行
DANONE	254	294	2,198	264,499	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA	1	1	150	18,140	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA	54	62	875	105,289	ソフトウェア・サービス
EDENRED	99	115	549	66,101	商業・専門サービス
EDF	249	288	266	32,114	公益事業
EIFFAGE	32	37	381	45,943	資本財
ENGIE	753	869	1,235	148,598	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	119	135	1,897	228,328	耐久消費財・アパレル
EURAZEO	20	19	121	14,643	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	4	5	255	30,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	75	86	140	16,850	メディア・娯楽
FAURECIA	31	36	170	20,570	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	207	227	354	42,658	運輸
HERMES INTERNATIONAL	13	15	998	120,122	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	11	13	149	17,988	電気通信サービス
IMERYS SA	15	17	63	7,636	素材
INGENICO GROUP	24	28	281	33,844	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	15	17	174	20,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	32	37	98	11,827	メディア・娯楽
KERING	31	36	1,983	238,612	耐久消費財・アパレル
LEGRAND SA	110	127	915	110,113	資本財
L'OREAL SA	103	120	3,133	377,055	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	114	132	5,268	633,868	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	70	81	916	110,228	自動車・自動車部品
NATIXIS	402	462	184	22,204	各種金融
ORANGE S.A.	842	968	1,417	170,559	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	87	101	1,724	207,546	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	244	280	636	76,538	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	89	102	406	48,912	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	9	10	131	15,809	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	79	91	404	48,650	自動車・自動車部品
REXEL SA	127	－	－	－	資本財
SAFRAN SA	137	156	2,320	279,193	資本財
SANOFI	465	536	4,455	536,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	13	179	21,618	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	226	261	2,284	274,867	資本財
SCOR REGROUPE	68	75	284	34,269	保険
SEB SA	9	10	151	18,261	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SOCIETE BIC SA		10	12	75	9,027	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE		316	365	1,038	124,904	銀行
SODEXO		36	42	449	54,051	消費者サービス
SUEZ		157	165	214	25,859	公益事業
TELEPERFORMANCE		24	28	599	72,143	商業・専門サービス
THALES SA		44	50	461	55,582	資本財
TOTAL SA		995	1,137	5,559	668,958	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT		32	39	199	24,050	メディア・娯楽
VALEO SA		99	115	414	49,836	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT		223	257	588	70,770	公益事業
VINCI SA		210	243	2,469	297,140	資本財
VIVENDI SA		433	439	1,089	131,115	メディア・娯楽
WENDEL		12	13	167	20,190	各種金融
WORLDLINE SA		15	39	217	26,189	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	11,248	12,769	64,352	7,742,886	
	銘柄数<比率>	71	70	－	<3.7%>	
(ユーロ／ドイツ)						
1 AND 1 DRILLISCH AG		23	26	66	8,010	電気通信サービス
ADIDAS AG		74	85	2,339	281,444	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		174	201	4,408	530,437	保険
AROUNDTOWN SA		329	443	345	41,599	不動産
AXEL SPRINGER SE		21	23	147	17,710	メディア・娯楽
BASF SE		377	436	3,042	366,096	素材
BAYER AG		384	444	3,117	375,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		135	156	1,148	138,235	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		24	28	157	18,892	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG		41	47	507	61,078	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG		63	72	344	41,508	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		－	19	201	24,191	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG		404	464	238	28,662	銀行
CONTINENTAL AG		45	52	641	77,206	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		78	81	355	42,793	素材
DAIMLER AG		375	433	2,173	261,549	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE		38	54	239	28,799	小売
DEUTSCHE BANK AG		808	934	615	74,092	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		78	90	1,254	150,924	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		98	112	199	23,959	運輸
DEUTSCHE POST AG		408	473	1,629	196,044	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		1,392	1,606	2,434	292,887	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	
(ユーロ／ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN SE	148	171	606	73,031	不動産
E.ON SE	904	1,048	956	115,026	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	66	87	226	27,233	素材
FRAPORT AG	18	21	166	20,076	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	172	198	966	116,229	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	28	31	125	15,135	素材
GEA GROUP AG	66	73	211	25,395	資本財
HANNOVER RUECK SE	24	28	475	57,169	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	60	69	467	56,252	素材
HENKEL AG & CO KGAA	43	50	439	52,825	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	72	83	796	95,826	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	8	11	130	15,696	資本財
HUGO BOSS AG	25	29	122	14,683	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	466	592	1,142	137,515	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	58	－	－	－	公益事業
KION GROUP AG	29	30	185	22,340	資本財
KNORR-BREMSE AG	－	23	200	24,093	資本財
LANXESS	35	40	253	30,496	素材
MERCK KGAA	53	61	664	79,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG	75	86	128	15,430	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	21	24	611	73,584	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	61	68	1,759	211,662	保険
OSRAM LICHT AG	39	－	－	－	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	61	71	483	58,128	自動車・自動車部品
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	98	－	－	－	メディア・娯楽
PUMA AG	3	39	268	32,252	耐久消費財・アパレル
RWE AG	213	260	688	82,796	公益事業
SAP SE	404	467	5,738	690,429	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	14	16	308	37,158	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS AG	315	363	4,164	501,055	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	61	71	309	37,236	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	51	61	524	63,082	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	358	487	133	16,085	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG	181	194	259	31,239	素材
UNIPER SE	83	95	275	33,164	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	51	59	177	21,389	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG	13	16	292	35,228	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG	75	87	1,547	186,149	自動車・自動車部品
VONOVIA SE	204	243	1,166	140,405	不動産

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ／ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
WIRECARD AG		48	56	679	81,711	ソフトウェア・サービス	
ZALANDO SE		46	59	229	27,667	小売	
小計	株数・金額	10,147	11,775	53,490	6,435,996		
	銘柄数<比率>	61	60	－	<3.0%>		
(ユーロ／ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,058	1,223	456	54,877	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA		204	237	361	43,490	エネルギー	
JERONIMO MARTINS		103	119	177	21,310	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	1,366	1,579	994	119,678		
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.1%>		
(ユーロ／スペイン)							
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		104	124	433	52,211	資本財	
AENA SME SA		28	33	560	67,411	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA		180	208	1,500	180,496	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		2,735	3,150	1,500	180,504	銀行	
BANCO DE SABADELL SA		2,300	2,645	261	31,486	銀行	
BANCO SANTANDER SA		6,673	7,696	2,734	329,006	銀行	
BANKIA SA		505	580	99	12,029	銀行	
BANKINTER SA		277	321	197	23,814	銀行	
CAIXABANK		1,471	1,702	453	54,557	銀行	
CELLNEX TELECOM SAU		－	95	352	42,414	電気通信サービス	
ENAGAS SA		95	109	250	30,146	公益事業	
ENDESA SA		130	151	369	44,512	公益事業	
FERROVIAL S.A.		206	234	619	74,497	資本財	
FERROVIAL SA-RTS		206	－	－	－	資本財	
FERROVIAL SA-RTS		－	234	9	1,176	資本財	
GRIFOLS SA		123	142	422	50,825	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA		2,560	2,859	2,549	306,715	公益事業	
INDITEX SA		449	518	1,433	172,484	小売	
MAPFRE SA		442	496	125	15,059	保険	
NATURGY ENERGY GROUP SA		147	145	345	41,620	公益事業	
RED ELECTRICA DE ESPANA		178	205	353	42,528	公益事業	
REPSOL SA		572	689	1,007	121,188	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		98	114	155	18,679	資本財	
TELEFONICA SA		1,945	2,246	1,511	181,853	電気通信サービス	
小計	株数・金額	21,436	24,706	17,247	2,075,219		
	銘柄数<比率>	22	23	－	<1.0%>		
(ユーロ／イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		483	521	974	117,311	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	
(ユーロ／イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ATLANTIA SPA		208	241	543	65,435	運輸
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		240	276	228	27,474	食品・飲料・タバコ
ENEL SPA		3,352	3,874	2,646	318,430	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		1,048	1,207	1,687	203,013	エネルギー
FINECOBANK SPA		－	288	323	38,933	銀行
INTESA SANPAOLO		6,148	7,095	1,665	200,382	銀行
LEONARDO SPA		165	190	212	25,576	資本財
MEDIOBANCA SPA		256	295	303	36,547	銀行
MONCLER SPA		73	85	316	38,112	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA		171	196	102	12,311	自動車・自動車部品
POSTE ITALIANE SPA		221	253	276	33,215	保険
PRYSMIAN SPA		99	115	229	27,664	資本財
RECORDATI SPA		43	50	185	22,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA		951	988	449	54,075	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		6,980	7,132	392	47,283	電気通信サービス
TERNA SPA		585	674	391	47,102	公益事業
UNICREDIT SPA		825	950	1,175	141,481	銀行
小計	株数・金額	21,855	24,439	12,106	1,456,627	
	銘柄数<比率>	17	18	－	<0.7%>	
(ユーロ／フィンランド)						
ELISA OYJ		60	69	341	41,042	電気通信サービス
FORTUM OYJ		182	211	447	53,897	公益事業
KONE OYJ		139	161	917	110,453	資本財
METSO OYJ		42	49	167	20,204	資本財
NESTE OYJ		158	201	631	76,009	エネルギー
NOKIA OYJ		2,330	2,688	835	100,522	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		48	58	153	18,474	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		42	49	195	23,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		183	212	780	93,907	保険
STORA ENSO OYJ		221	270	335	40,395	素材
UPM-KYMMENE OYJ		217	250	766	92,170	素材
WARTSILA OYJ		181	209	190	22,935	資本財
小計	株数・金額	3,810	4,432	5,764	693,595	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.3%>	
(ユーロ／オーストリア)						
ANDRITZ AG		30	35	136	16,423	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		124	143	468	56,328	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		27	32	142	17,156	公益事業
OMV AG		60	69	368	44,292	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／オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		60	69	152	18,395	銀行
VOESTALPINE AG		46	53	126	15,256	素材
小計	株数・金額	349	403	1,395	167,852	
	銘柄数<比率>	6	6	－	<0.1%>	
(ユーロ／その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		89	102	685	82,495	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	89	102	685	82,495	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	80,796	92,308	194,158	23,361,149	
	銘柄数<比率>	237	237	－	<11.1%>	
合計	株数・金額	509,058	568,479	－	199,297,460	
	銘柄数<比率>	1,243	1,256	－	<94.4%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	6	7	1,006	109,312
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17	19	2,665	289,537
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4	5	853	92,655
PROLOGIS INC	25	29	2,722	295,723
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	58	72	661	71,848
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5	6	1,432	155,570
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	4	513	55,750
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6	7	437	47,521
DUKE REALTY CORP	14	16	593	64,441
EQUITY RESIDENTIAL	15	17	1,532	166,465
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	3	1,016	110,435
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	3	461	50,151
HCP INC	19	22	793	86,142
WELLTOWER INC	15	19	1,640	178,227
HOST HOTELS AND RESORTS INC	30	34	597	64,928
KIMCO REALTY CORP	17	19	430	46,753
LIBERTY PROPERTY TRUST	5	6	424	46,158
MACERICH CO/THE	4	5	148	16,088
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4	5	757	82,249
PUBLIC STORAGE	6	7	1,597	173,550
REGENCY CENTERS CORP	6	7	512	55,709
SIMON PROPERTY GROUP INC	12	14	2,217	240,891
SL GREEN REALTY CORP	3	3	331	36,041
SUN COMMUNITIES INC	—	4	723	78,535
UDR INC	11	13	666	72,380
VENTAS INC	14	17	1,000	108,703
VORNADO REALTY TRUST	6	8	516	56,131
WP CAREY INC	6	8	711	77,263
REALTY INCOME CORP	12	15	1,167	126,790
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	8	594	64,520
EXTRA SPACE STORAGE INC	5	6	652	70,861
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	9	1,211	131,632
IRON MOUNTAIN INC	11	13	468	50,910
AGNC INVESTMENT CORP	22	26	463	50,297
AMERICAN TOWER REIT INC	18	21	4,545	493,734
EQUINIX INC	3	4	2,266	246,116
VEREIT	40	46	446	48,467
SBA COMMUNICATIONS CORP	4	5	1,298	141,065
INVITATION HOMES INC	13	21	645	70,085
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	5	—	—	—
小計	口数・金額	口数	40,729	4,423,654
	銘柄数<比率>	39	—	<2.1%>

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
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		2	3	112	9,237
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		6	7	153	12,522
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		6	7	197	16,178
小計	口数・金額	15	17	463	37,938
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		45	56	684	50,724
GPT GROUP		83	103	629	46,678
GOODMAN GROUP		70	81	1,203	89,243
STOCKLAND		109	122	609	45,174
MIRVAC GROUP		163	202	667	49,515
VICINITY CENTRES		151	176	474	35,210
SCENTRE GROUP		231	268	1,071	79,437
小計	口数・金額	854	1,012	5,341	395,984
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		87	100	8,231	114,247
小計	口数・金額	87	100	8,231	114,247
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		110	120	354	28,268
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		107	124	249	19,937
CAPITALAND MALL TRUST		106	123	314	25,113
SUNTEC REIT		88	91	168	13,420
小計	口数・金額	412	461	1,086	86,739
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		37	42	239	33,547
HAMMERSON PLC		31	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		30	33	305	42,876
SEGRO PLC		43	51	443	62,303
小計	口数・金額	142	126	988	138,727
	銘柄数<比率>	4	3	—	<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		8	9	317	38,234
GECINA SA		1	2	335	40,352
COVIVIO		1	2	236	28,442
ICADE		1	1	133	16,045
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		5	6	947	113,997
小計	口数・金額	19	22	1,970	237,072
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>
合計	口数・金額	2,006	2,313	—	5,434,364
	銘柄数<比率>	62	62	—	<2.6%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国		百万円	百万円
	S&P 500 EMINI FUTURE	4,470	—
	FTSE 100	441	—
	DJ EURO STOXX 50	1,114	—

(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

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	199,297,460	94.0
投資信託証券	5,434,364	2.6
コール・ローン等、その他	7,275,391	3.4
投資信託財産総額	212,007,217	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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シェケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産（207,877,451千円）の投資信託財産総額（212,007,217千円）に対する比率は98.1%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

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	215,497,433,277円
コール・ローン等	4,865,378,505
株式(評価額)	199,297,460,924
投資信託証券(評価額)	5,434,364,911
未収入金	3,751,415,239
未収配当金	290,269,135
差入委託証拠金	1,858,544,563
(B)負債	4,454,247,012
未払金	3,502,277,259
未払解約金	951,945,848
その他未払費用	23,905
(C)純資産総額(A-B)	211,043,186,265
元本	110,982,930,759
次期繰越損益金	100,060,255,506
(D)受益権総口数	110,982,930,759口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,016円

(注1)	期首元本額	97,019,551,907円
	期中追加設定元本額	24,466,652,299円
	期中一部解約元本額	10,503,273,447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)	705,419,292円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,284,755,401円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,471,314,789円
	ニッセイ外国株式インデックスS A (適格機関投資家限定)	1,485,332,737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)	4,090,937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)	23,976,047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)	32,048,288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)	11,371,888,952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	75,325,693,121円
	DCニッセイ外国株式インデックス	15,291,138,731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)	605,358,530円
	DCニッセイターゲットデットファンド2055	59,931,201円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	72,703,499円
	DCニッセイターゲットデットファンド2045	39,305,684円
	DCニッセイターゲットデットファンド2035	79,667,845円
	DCニッセイターゲットデットファンド2025	22,747,558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)	40,031,114円
	ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,696,756円
	ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	3,481,454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)	995,057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)	16,196,854円
	DCニッセイターゲットデットファンド2060	4,212,091円
	DCニッセイターゲットデットファンド2050	3,974,678円
	DCニッセイターゲットデットファンド2040	6,685,873円
	DCニッセイターゲットデットファンド2030	7,284,270円

損益の状況

当期(2019年5月21日~2019年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,925,753,117円
受取配当金	1,913,810,907
受取利息	4,764,663
その他の収益	8,275,117
支払利息	△ 1,097,570
(B)有価証券売買損益	12,263,335,719
売却益	18,903,752,207
売却損	△ 6,640,416,488
(C)先物取引等損益	193,374,215
取引益	596,390,171
取引損	△ 403,015,956
(D)信託報酬等	△ 38,758,151
(E)当期損益金(A+B+C+D)	14,343,704,900
(F)前期繰越損益金	75,095,869,816
(G)追加信託差損益金	19,154,801,612
(H)解約差損益金	△ 8,534,120,822
(I)合計(E+F+G+H)	100,060,255,506
次期繰越損益金(I)	100,060,255,506

(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。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 2 期

(計算期間：2018年11月21日～2019年11月20日)

運用方針

主に新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

主要運用 対象

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



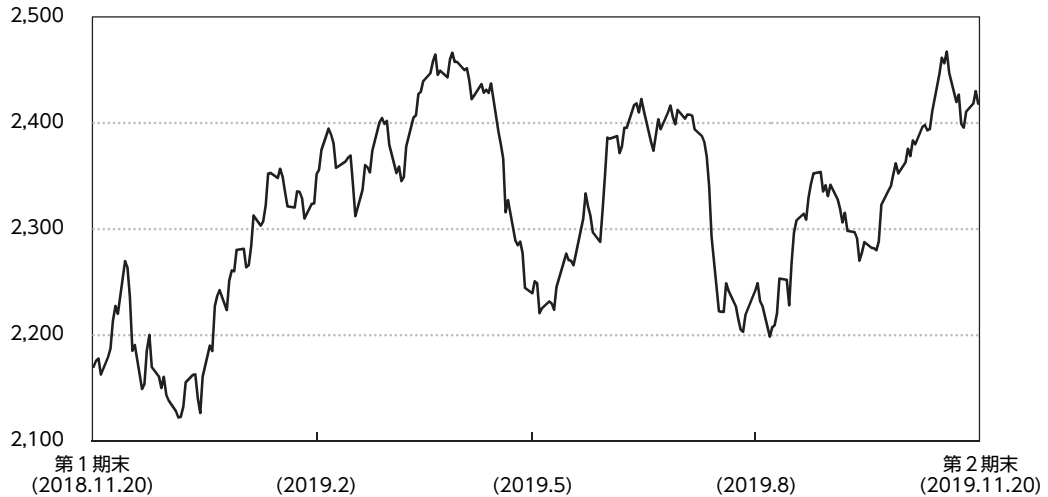
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過 2018年11月21日～2019年11月20日

海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

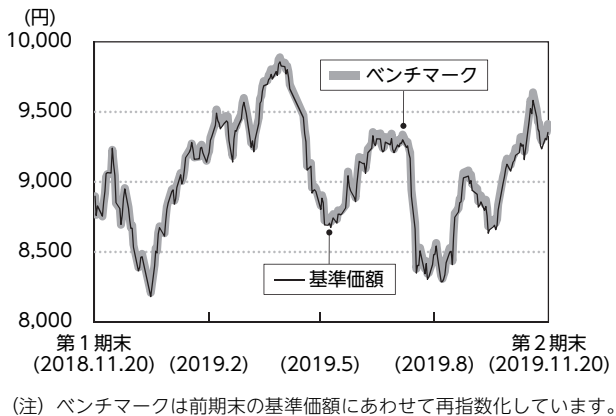


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の新興国株式市場は上昇しました。

期初以降、米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まりなどを背景に下落しましたが、2019年1月に入ると、F R Bのハト派姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に上昇基調が継続しました。5月になると中国経済に予想以上の悪化兆候が見られたことを受けて、世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことから新興国株式市場は一時下落しましたが、6月末の米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことや米国の利下げ期待から上昇しました。8月は米中貿易摩擦を巡る緊張の高まりから下落しましたが、10月以降は米中貿易摩擦の緩和期待などを背景に上昇する流れとなり、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



■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・米連邦準備制度理事会（F R B）のハト派（金融緩和推進派）姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退、米中首脳会談における貿易戦争の休止や米国の利下げ期待などを受けて新興国株式市場が上昇したこと

<下落要因>

- ・米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まり、それらに伴う世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことなどをを受けて新興国株式市場が下落したこと

ポートフォリオ

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）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+5.1%となり、ベンチマーク騰落率（+5.8%）を下回りました。

今後の運用方針

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
(設定日)	円	%		%	%	%	%	百万円
2017年8月7日	10,000	－	10,000	－	－	－	－	1,000
1期(2018年11月20日)	8,898	△11.0	9,691	△3.1	88.6	8.8	2.2	1,641
2期(2019年11月20日)	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	4.1	2,160

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 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3) 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4) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注5) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年11月20日	8,898	－	9,691	－	88.6	8.8	2.2
11月末	9,067	1.9	9,862	1.8	87.9	9.8	2.2
12月末	8,465	△4.9	9,243	△4.6	89.2	8.3	2.3
2019年1月末	9,081	2.1	9,895	2.1	85.9	11.9	2.1
2月末	9,419	5.9	10,298	6.3	84.0	13.9	2.0
3月末	9,302	4.5	10,171	5.0	89.1	8.5	2.1
4月末	9,664	8.6	10,559	9.0	88.6	9.1	2.1
5月末	8,743	△1.7	9,551	△1.4	88.4	7.9	3.5
6月末	9,208	3.5	10,059	3.8	86.9	9.4	3.2
7月末	9,204	3.4	10,066	3.9	85.6	10.9	3.2
8月末	8,423	△5.3	9,204	△5.0	87.0	8.2	4.6
9月末	8,797	△1.1	9,631	△0.6	85.9	9.6	4.5
10月末	9,266	4.1	10,151	4.7	85.4	10.4	4.1
(期末)2019年11月20日	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	4.1

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2018年11月21日～2019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	6円	0.063%	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(4)	(0.049)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
有価証券取引税	1	0.012	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.012)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	37	0.408	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)	(31)	(0.346)	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)	(6)	(0.061)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	44	0.483	

(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（9,042円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年11月21日～2019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 183 (3)	千米ドル 414	百株 64	千米ドル 105
	香港	5,949 (17)	千香港ドル 4,901 (△ 11)	1,208	千香港ドル 479
	台湾	1,630 (73)	千台湾ドル 7,416 (△ 35)	140	千台湾ドル 1,070
	イギリス	7	千イギリス・ポンド 6	—	千イギリス・ポンド —
	トルコ	201 (74)	千トルコ・リラ 219	131	千トルコ・リラ 41
	メキシコ	318	千メキシコ・ペソ 1,233 (△ 9)	59	千メキシコ・ペソ 141
	フィリピン	289 (6)	千フィリピン・ペソ 3,310	—	千フィリピン・ペソ —
	チリ	10,067 (274)	千チリ・ペソ 44,762	274	千チリ・ペソ 159
	コロンビア	21	千コロンビア・ペソ 64,039	—	千コロンビア・ペソ —
	インド	639 (128)	千インド・ルピー 20,184	110	千インド・ルピー 1,032
	インドネシア	1,808 (708)	千インドネシア・ルピア 941,105	242	千インドネシア・ルピア 83,570

ニッセイ新興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	ブラジル	百株 316 (127)	千ブラジル・レアル 893 (△ 35)	百株 11	千ブラジル・レアル 15
	チェコ	1	千チェコ・コルナ 100	1	千チェコ・コルナ 41
	韓国	93 (0.23)	千韓国ウォン 354,059 (△ 41)	12	千韓国ウォン 40,552
	中国	2,832	千人民元 2,863	—	千人民元 —
	マレーシア	469	千マレーシア・リンギット 361	103	千マレーシア・リンギット 15
	南アフリカ	170 (22)	千南アフリカ・ランド 1,727	18	千南アフリカ・ランド 210
	タイ	2,039 (187)	千タイ・バーツ 6,085 (△ 1)	238	千タイ・バーツ 524
	ポーランド	60	千ポーランド・ズロチ 143	3	千ポーランド・ズロチ 10
	ハンガリー	7	千ハンガリー・フォリント 2,821	—	千ハンガリー・フォリント —
	ユーロ ギリシャ	16	千ユーロ 19	—	千ユーロ —

(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。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	タイ	証券 1,588	千タイ・バーツ 1	証券 1,588	千タイ・バーツ 2

(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。

(3) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	2	36	—	—
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	1	33	0.200	3
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	15	481	—	—
(トルコ)		千トルコ・リラ		千トルコ・リラ
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	—	—	3	6
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	—	—	—	—
		(△ 8)		
(南アフリカ)		千南アフリカ・ランド		千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	2	56	—	—
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	—	—	0.485	32
RESILIENT REIT LTD	—	—	0.631	35
REDEFINE PROPERTIES LTD	14	117	—	—
FORTRESS REIT LTD-A	1	35	—	—
FORTRESS REIT LTD-B	—	—	1	19

(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	百万円	百万円	百万円
	1,162	1,125	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年11月21日～2019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
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	0.900	16,287	18,096	NETEASE.COM INC -ADR	0.200	5,262	26,314
TENCENT HOLDINGS LTD	0.900	4,284	4,760	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	0.900	1,949	2,166
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2	4,219	2,109	LUKOIL PJSC-SPON ADR	0.231	1,917	8,298
XIAOMI CORP-CLASS B	27	3,788	138	CHINA RESOURCES LAND LTD	4	1,727	431
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	4	3,449	862	TENCENT HOLDINGS LTD	0.300	1,358	4,529
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.658	2,916	4,433	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	3	1,352	436
MEITUAN DIANPING-CLASS B	3	2,741	856	IND & COMM BK OF CHINA - H	16	1,233	77
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	1	2,554	1,596	MONDI LTD	0.368	879	2,389
NETEASE.COM INC -ADR	0.100	2,477	24,778	SK HYNIX INC	0.139	836	6,019
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	22	2,024	91	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.214	831	3,886

(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。

(2) 新株予約権証券

銘柄	買付			銘柄	売付		
	証券数	金額	平均単価		証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
MINOR INTERNATIONAL PCL	355	4	11	MINOR INTERNATIONAL PCL	355	5	14
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW	1,233	1	1	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW	1,233	2	2

(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

2019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	
51JOB INC-ADR	1	1	7 825	商業・専門サービス
58.COM INC-ADR	3	3	19 2,106	メディア・娯楽
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	35	44	827 89,876	小売
AUTOHOME INC-ADR	1	2	16 1,805	メディア・娯楽
BAIDU INC-SPON ADR	8	8	99 10,843	メディア・娯楽

ニッセイ新興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	
BAOZUN INC-SPN ADR	1	1	4	475	小売
BBVA ARGENTINA SA-ADR	－	11	3	391	銀行
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	5	7	860	素材
CREDICORP LTD	1	1	37	4,115	銀行
GDS HOLDINGS LTD-ADR	1	2	9	982	ソフトウェア・サービス
GLOBANT SA	－	1	9	1,041	ソフトウェア・サービス
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	－	3	3	385	銀行
HUAZHU GROUP LIMITED ADR	3	4	14	1,581	消費者サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	－	2	4	518	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	21	21	1	200	エネルギー
IQIYI INC-ADR	－	4	7	779	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	22	22	72	7,927	小売
LUKOIL PJSC-SPON ADR	13	12	122	13,333	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	9	12	14	1,592	食品・生活必需品小売り
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	4	8	6	734	素材
MOBILE TELESYSTEMS PJSC	10	16	15	1,731	電気通信サービス
MOMO INC-SPON ADR	3	4	17	1,920	メディア・娯楽
NETEASE.COM INC -ADR	2	1	57	6,204	メディア・娯楽
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	3	4	52	5,736	消費者サービス
NIO INC-ADR	－	21	3	417	自動車・自動車部品
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	1	1	2	307	各種金融
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2	3	63	6,924	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3	4	8	977	素材
PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	－	5	6	723	公益事業
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	3	5	7	760	素材
PINDUODUO INC-ADR	－	6	24	2,653	小売
PJSC GAZPROM ADR	167	166	129	14,062	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	19	21	58	6,378	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	1	1	8	884	素材
ROSNEFT OJSC-GDR	38	38	27	2,980	エネルギー
RUSHYDRO PJSC-ADR	28	－	－	－	公益事業
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	87	82	123	13,372	銀行
SEVERSTAL PAO-GDR REG S	5	7	11	1,215	素材
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	19	22	2	256	不動産
SINA CORP	1	2	7	828	メディア・娯楽
SOUTHERN COPPER CORP	2	2	8	955	素材
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	35	48	35	3,833	エネルギー

ニッセイ新興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		
TAL EDUCATION GROUP- ADR		10	11	49	5,417	消費者サービス	
TATNEFT-SPONSORED ADR		8	8	58	6,367	エネルギー	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR		—	3	2	292	電気通信サービス	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR		—	3	3	394	メディア・娯楽	
TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B		—	2	1	139	エネルギー	
TRIP.COM GROUP LTD		12	14	45	4,899	小売	
VIPSHOP HOLDINGS LTD-ADR		8	14	17	1,884	小売	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI		42	66	9	1,036	銀行	
WEIBO CORP-SPON ADR		1	1	5	606	メディア・娯楽	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR		2	4	14	1,564	食品・生活必需品小売り	
YUM CHINA HOLDINGS INC		10	10	47	5,127	消費者サービス	
YY INC-ADR		1	1	8	908	メディア・娯楽	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR		—	11	23	2,512	運輸	
小計	株数・金額	668	791	2,252	244,652		
	銘柄数<比率>	43	54	—	<11.3%>		
(香港)				千香港ドル			
3SBIO INC		25	40	49	689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN		20	20	113	1,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD		40	40	44	621	不動産	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H		900	900	293	4,072	銀行	
AIR CHINA LIMITED-H		40	100	72	1,002	運輸	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T		100	100	81	1,132	ヘルスケア機器・サービス	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD		200	400	52	727	メディア・娯楽	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		60	240	56	779	素材	
ANGANG STEEL CO LTD-H		20	26	6	94	素材	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		40	40	197	2,739	素材	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD		30	40	307	4,269	耐久消費財・アパレル	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H		40	40	14	195	資本財	
BAIC MOTOR CORP LTD-H		40	40	19	263	自動車・自動車部品	
BANK OF CHINA LTD-H		2,420	2,560	832	11,548	銀行	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H		240	290	153	2,125	銀行	
BBMG CORPORATION-H		—	270	57	801	素材	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H		40	40	30	428	運輸	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS		10	15	53	742	公益事業	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR		160	160	62	868	公益事業	
BOC AVIATION LTD		5	5	38	536	資本財	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD		—	160	61	855	耐久消費財・アパレル	

ニッセイ新興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	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	80	80	67	942	自動車・自動車部品
BYD CO LTD	15	20	76	1,054	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10	10	15	213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CGN POWER CO LTD-H	200	340	68	943	公益事業
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	－	230	70	980	食品・飲料・タバコ
CHINA AOYUAN GROUP LTD	－	40	44	612	不動産
CHINA CINDA ASSET MANAGEMEN-H	180	280	46	645	各種金融
CHINA CITIC BANK	240	290	131	1,827	銀行
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	100	140	84	1,175	資本財
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	40	80	42	590	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	45	60	184	2,560	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,930	3,050	1,958	27,178	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	55	55	16	226	運輸
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	－	40	16	222	運輸
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	－	20	21	295	消費者サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	50	120	43	599	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	90	90	54	752	商業・専門サービス
CHINA EVERBRIGHT LTD	20	80	104	1,454	各種金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	70	60	119	1,655	不動産
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	80	80	17	236	自動車・自動車部品
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	65	115	47	665	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	52	52	173	2,414	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	－	65	28	395	素材
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	210	210	24	341	各種金融
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	24	40	57	795	各種金融
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	120	180	100	1,391	不動産
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	230	230	481	6,688	保険
CHINA LITERATURE LTD	4	4	13	181	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	60	100	42	582	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	30	30	37	516	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80	90	270	3,747	食品・飲料・タバコ
CHINA MERCHANTS BANK-H	120	120	469	6,512	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	40	40	49	692	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	144	229	127	1,764	銀行
CHINA MOBILE LTD/HK	185	195	1,212	16,835	電気通信サービス
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	60	60	15	211	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	80	120	86	1,195	素材

ニッセイ新興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	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	40	40	43	599	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	120	120	318	4,413	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	76	86	253	3,521	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	780	780	347	4,817	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	140	140	298	4,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	100	100	16	227	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	90	90	42	588	資本財
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	－	40	17	241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	40	65	54	763	資本財
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	130	130	16	227	保険
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	40	60	271	3,764	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	60	60	54	749	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	20	40	178	2,476	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	100	100	342	4,753	不動産
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	40	40	28	391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	40	60	60	844	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	100	100	152	2,118	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40	40	20	279	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40	40	27	378	資本財
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	44	66	126	1,758	保険
CHINA TELECOM CORP LTD-H	420	420	132	1,836	電気通信サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	900	1,340	222	3,087	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	60	22	313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	180	180	132	1,843	電気通信サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	26	47	135	1,885	不動産
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	400	－	－	－	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	50	50	20	282	銀行
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	80	80	47	652	不動産
CITIC LTD	160	190	194	2,705	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	50	70	106	1,478	各種金融
CNOOC LTD	540	570	685	9,509	エネルギー
COSCO PACIFIC LTD	20	60	39	547	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	230	280	313	4,344	不動産
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	30	30	82	1,145	商業・専門サービス
CRRC CORP LTD H	90	130	66	929	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	45	45	23	330	食品・飲料・タバコ
DATANG INTL POWER GEN CO-H	－	100	15	208	公益事業

ニッセイ新興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	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	80	80	63	887	自動車・自動車部品
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20	24	206	2,864	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	40	70	49	680	各種金融
FOSUN INTERNATIONAL	55	130	141	1,970	資本財
FULLSHARE HOLDINGS LTD	125	—	—	—	資本財
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	40	40	33	465	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8	32	74	1,032	自動車・自動車部品
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	250	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	150	231	3,218	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20	20	37	520	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	30	48	41	571	各種金融
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	200	200	14	194	小売
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	65	65	40	568	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	20	—	—	—	不動産
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	—	60	54	753	商業・専門サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	80	80	135	1,881	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56	96	81	1,135	自動車・自動車部品
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	16	32	41	578	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	14	14	17	237	各種金融
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	—	20	70	971	消費者サービス
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	30	50	111	1,540	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10	10	18	250	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	68	100	81	1,135	各種金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20	20	102	1,421	家庭用品・パーソナル用品
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10	10	13	192	半導体・半導体製造装置
HUANENG POWER INTL INC-H	80	140	51	713	公益事業
HUANENG RENEWABLES CORP-H	80	80	23	332	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	34	54	66	926	各種金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,100	2,070	1,200	16,664	銀行
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	20	21	294	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	20	20	18	253	素材
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	20	—	—	—	不動産
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	—	70	23	326	不動産
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	20	20	45	631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	25	23	320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	40	70	58	818	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	10	30	55	768	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興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	
KUNLUN ENERGY CO LTD	60	100	69	964	公益事業
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65	40	34	480	不動産
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	30	30	16	227	素材
LEGEND GROUP LTD	180	220	127	1,764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEGEND HOLDINGS CORP-H	10	10	16	224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI NING CO LTD	－	60	156	2,169	耐久消費財・アパレル
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	40	40	49	684	不動産
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	40	55	179	2,496	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	25	25	16	224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAANSHAN IRON & STEEL-H	－	60	16	231	素材
MEITU INC	25	25	4	56	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEITUAN DIANPING-CLASS B	－	32	307	4,263	小売
MMG LTD	40	40	6	96	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	22	22	70	977	保険
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	20	20	14	199	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	30	23	328	素材
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	150	230	74	1,034	保険
PETROCHINA CO LTD-H	640	640	238	3,304	エネルギー
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	190	230	222	3,090	保険
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	160	175	1,616	22,431	保険
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	70	260	135	1,880	銀行
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	60	95	96	1,342	半導体・半導体製造装置
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40	40	40	559	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	40	40	9	136	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10	30	70	982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	10	10	14	199	資本財
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13	27	38	538	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	20	55	92	1,282	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	80	80	24	345	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20	24	256	3,564	耐久消費財・アパレル
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	30	30	85	1,184	不動産
SHUI ON LAND LTD	－	115	18	250	不動産
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	80	80	8	113	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINO BIOPHARMACEUTICAL	180	220	256	3,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	60	60	18	250	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	30	30	13	191	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	60	240	51	719	素材

ニッセイ新興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	
SINOPHARM GROUP CO-H		28	36	97 1,346	ヘルスケア機器・サービス
SINOTRANS LTD		—	60	14 204	運輸
SINOTRUK HONG KONG LTD		—	20	27 376	資本財
SOHO CHINA LTD		45	45	12 177	不動産
SSY GROUP LTD		40	40	25 357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUN ART RETAIL GROUP LTD		55	55	49 687	食品・生活必需品小売り
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD		60	80	298 4,141	不動産
SUNNY OPTICAL TECH		21	25	324 4,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD		174	180	6,058 84,096	メディア・娯楽
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO		40	60	73 1,017	食品・飲料・タバコ
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		20	30	53 738	ソフトウェア・サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H		—	20	101 1,403	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS		30	30	23 328	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD		110	150	100 1,390	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H		30	60	82 1,142	資本財
WUXI APPTec CO LTD-H		—	5	55 766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC		15	20	177 2,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XIAOMI CORP-CLASS B		—	274	234 3,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H		—	24	22 306	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD		60	60	27 386	半導体・半導体製造装置
YANZHOU COAL MINING CO-H		40	40	27 376	エネルギー
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING		—	10	50 699	食品・飲料・タバコ
YUEXIU PROPERTY CO LTD		160	160	26 373	不動産
YUZHOU PROPERTIES CO		—	130	46 651	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H		35	35	29 403	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H		20	20	14 200	運輸
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H		—	7	18 250	保険
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		10	10	27 387	小売
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H		12	17	46 648	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		180	180	51 714	素材
ZTE CORP-H		12	28	62 862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,043 175	27,801 195	29,931 —	415,452 <19.2%>
(台湾)				千台湾ドル	
ACER INC		50	50	90 322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD		10	10	317 1,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		—	10	444 1,582	資本財

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	100	100	790	2,812	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	40	70	315	1,122	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	20	20	475	1,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	170	260	206	735	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	20	556	1,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	250	250	1,067	3,800	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD	30	41	599	2,133	各種金融
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	114	188	430	1,533	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	40	40	169	604	自動車・自動車部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	10	10	92	328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	40	40	36	129	運輸
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	370	370	367	1,306	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	53	53	136	484	保険
CHINA STEEL CORP	370	370	869	3,095	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	130	120	1,356	4,827	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS	80	130	245	874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	550	600	1,335	4,752	銀行
DELTA ELECTRONICS INC	70	60	837	2,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	311	333	922	3,285	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	－	10	401	1,429	耐久消費財・アパレル
EVA AIRWAYS CORP	31	32	45	163	運輸
EVERGREEN MARINE	31	31	39	140	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	60	100	300	1,069	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	40	40	294	1,048	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10	11	216	769	耐久消費財・アパレル
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	272	325	746	2,657	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	100	110	957	3,406	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	30	40	385	1,371	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	140	140	1,363	4,854	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	10	10	34	121	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20	20	134	478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	200	200	911	3,243	保険
GIANT MANUFACTURING	10	10	218	777	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	10	10	340	1,212	半導体・半導体製造装置
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	20	20	93	333	不動産
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10	10	266	947	資本財
HON HAI PRECISION INDUSTRY	352	392	3,637	12,950	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10	10	579	2,061	小売
HTC CORP	10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	217	229	501	1,785	銀行
INNOLUX CORPORATION	180	280	195	694	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	40	80	186	662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	40	70	352	1,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MACRONIX INTERNATIONAL	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MEDIATEK INC	50	50	2,105	7,493	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	320	350	1,074	3,825	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10	20	171	610	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PLASTICS CORP	150	170	1,222	4,351	素材
NANYA TECHNOLOGY CORP	20	40	284	1,013	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	10	282	1,005	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	20	20	438	1,559	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	40	60	424	1,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	—	10	295	1,051	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	40	70	283	1,008	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10	20	191	681	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	20	624	2,221	食品・生活必需品小売り
QUANTA COMPUTER INC	70	90	571	2,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10	20	468	1,666	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	12	12	56	202	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	6	6	46	165	耐久消費財・アパレル
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	172	312	317	1,128	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	244	344	444	1,583	銀行
STANDARD FOODS CORP	10	10	62	222	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	20	40	149	530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIMED BIOLOGICS INC	—	10	130	464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	279	285	410	1,461	銀行
TAIWAN BUSINESS BANK	83	87	109	388	銀行
TAIWAN CEMENT	118	158	666	2,373	素材
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	245	293	616	2,195	銀行
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	30	60	216	768	運輸
TAIWAN MOBILE CO LTD	40	50	575	2,047	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	750	780	24,570	87,469	半導体・半導体製造装置
TATUNG CO LTD	—	60	125	447	耐久消費財・アパレル
TECO ELECTRIC & MACHINERY	30	—	—	—	資本財

ニッセイ新興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
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		—	100	521	1,854	銀行	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		150	150	1,110	3,951	食品・飲料・タバコ	
UNITED MICROELECTRONICS CORP		310	370	538	1,916	半導体・半導体製造装置	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		20	20	133	473	半導体・半導体製造装置	
WALSIN TECHNOLOGY CORP		10	10	167	596	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIN SEMICONDUCTORS CORP		10	10	325	1,157	半導体・半導体製造装置	
WINBOND ELECTRONICS CORP		50	50	85	302	半導体・半導体製造装置	
WISTRON CORP		51	91	267	952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS LTD		27	27	105	376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YAGEO CORPORATION		10	10	323	1,151	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		220	300	595	2,119	各種金融	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		10	10	140	498	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計	株数・金額	8,374	9,937	65,106	231,779		
	銘柄数<比率>	82	86	—	<10.7%>		
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		—	7	8	1,185	素材	
小計	株数・金額	—	7	8	1,185		
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.1%>		
(トルコ)				千トルコ・リラ			
AKBANK T.A.S.		46	93	72	1,385	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		4	4	8	169	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS		4	4	8	165	耐久消費財・アパレル	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		3	10	20	388	資本財	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		4	12	59	1,125	食品・生活必需品小売り	
COCA-COLA ICECEK AS		1	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		28	81	61	1,179	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		1	1	10	198	自動車・自動車部品	
HACI OMER SABANCI HOLDING		18	65	59	1,140	各種金融	
KOC HOLDING AS		15	25	52	995	資本財	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		13	—	—	—	素材	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		2	2	8	159	運輸	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		2	—	—	—	自動車・自動車部品	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		2	3	50	960	エネルギー	
TURK HAVA YOLLARI AO		9	9	14	267	運輸	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		13	13	6	120	資本財	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		22	35	47	898	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI		48	71	73	1,391	銀行	

ニッセイ新興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
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE HALK BANKASI		11	－	－	－	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C		30	30	19	369	銀行	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		14	－	－	－	銀行	
ULKER BISKUVI SANAYI AS		3	－	－	－	食品・飲料・タバコ	
YAPI VE KREDI BANKASI		16	－	－	－	銀行	
小計	株数・金額	320	465	573	10,915		
	銘柄数<比率>	23	16	－	<0.5%>		
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ			
ALFA S.A.B.-A		63	96	150	843	資本財	
ALSEA SAB DE CV		11	11	59	331	消費者サービス	
AMERICA MOVIL SAB DE CV		1,023	1,081	1,631	9,151	電気通信サービス	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		10	22	233	1,311	食品・飲料・タバコ	
BANCO SANTANDER MEXICO, S.A., INSTITUCION B		35	－	－	－	銀行	
CEMEX SAB-CPO		417	478	339	1,906	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		11	－	－	－	食品・飲料・タバコ	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		－	16	179	1,006	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		3	3	29	165	小売	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		60	60	1,077	6,042	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S.A.B.-B		4	9	202	1,136	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		4	6	218	1,225	運輸	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH		9	9	185	1,040	運輸	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		35	53	183	1,029	食品・飲料・タバコ	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		9	9	62	349	資本財	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		81	81	857	4,809	銀行	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		49	75	181	1,015	銀行	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		107	107	572	3,213	素材	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		69	69	299	1,678	メディア・娯楽	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		3	3	83	468	素材	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV		11	18	149	836	公益事業	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		29	49	187	1,051	家庭用品・パーソナル用品	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO		－	8	60	340	メディア・娯楽	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		20	33	144	809	素材	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		4	11	207	1,165	運輸	
WALMART DE MEXICO-SER V		149	168	922	5,177	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	2,217	2,477	8,218	46,106		
	銘柄数<比率>	24	24	－	<2.1%>		

ニッセイ新興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
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		36	63	323	688	資本財	
ABOITIZ POWER CORP		28	28	102	217	公益事業	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		75	75	85	182	資本財	
AYALA CORPORATION		5	11	971	2,069	資本財	
AYALA LAND INC		197	239	1,075	2,290	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		15	48	454	969	銀行	
BDO UNIBANK INC		53	63	1,002	2,135	銀行	
DMCI HOLDINGS INC		71	71	54	115	資本財	
GLOBE TELECOM INC		0.65	0.65	125	267	電気通信サービス	
GT CAPITAL HOLDINGS INC		1	1	171	364	資本財	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		9	28	341	728	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC		59	91	713	1,520	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORP		8	13	282	600	消費者サービス	
MANILA ELECTRIC COMPANY		4	13	452	963	公益事業	
MEGAWORLD CORP		229	229	109	232	不動産	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		281	281	130	278	各種金融	
METROPOLITAN BANK & TRUST		12	55	375	800	銀行	
PLDT INC		1	2	294	627	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO		34	34	88	188	不動産	
SECURITY BANK CORP		4	4	91	195	銀行	
SM INVESTMENTS CORP		4	7	785	1,673	資本財	
SM PRIME HOLDINGS INC		273	329	1,309	2,789	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP		17	28	428	912	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	1,424	1,720	9,769	20,809		
	銘柄数<比率>	23	23	—	<1.0%>		
(チリ)				千チリ・ペソ			
AGUAS ANDINAS SA-A		46	46	1,597	220	公益事業	
BANCO DE CHILE		689	1,789	16,374	2,258	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION		0.79	1	6,079	838	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION		0.06	—	—	—	銀行	
BANCO SANTANDER CHILE		1,780	2,197	10,411	1,435	銀行	
CENCOSUD SA		27	43	4,525	624	食品・生活必需品小売り	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		2	2	1,984	273	食品・飲料・タバコ	
COLBUN SA		137	137	1,664	229	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		4	4	994	137	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		2	2	1,524	210	電気通信サービス	
EMPRESAS CMPC SA		24	37	6,911	953	素材	

ニッセイ新興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
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
EMPRESAS COPEC SA		9	12	8,731	1,204	エネルギー	
ENEL CHILE SA		604	904	5,542	764	公益事業	
ENERSIS SA		588	1,364	20,607	2,841	公益事業	
ITAU CORPBANCA		2,575	10,008	4,375	603	銀行	
LATAM AIRLINES GROUP SA		6	9	8,264	1,139	運輸	
S.A.C.I. FALABELLA		18	24	8,962	1,235	小売	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		3	3	5,934	818	素材	
小計	株数・金額	6,522	16,590	114,485	15,787		
	銘柄数<比率>	18	17	—	<0.7%>		
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ			
BANCOLOMBIA SA		4	7	32,057	1,013	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF		12	16	73,149	2,311	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA		8	8	5,931	187	素材	
ECOPETROL SA		126	126	39,335	1,243	エネルギー	
GRUPO ARGOS SA		5	5	9,882	312	素材	
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		76	76	10,629	335	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA		5	12	42,480	1,342	各種金融	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		2	2	6,720	212	各種金融	
INTERCONEXION ELECTRICA SA		8	14	28,099	887	公益事業	
小計	株数・金額	250	271	248,287	7,845		
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.4%>		
(インド)				千インド・ルピー			
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		15	15	550	836	運輸	
AMBUJA CEMENTS LTD		11	11	229	348	素材	
ASHOK LEYLAND LTD		22	22	184	280	資本財	
ASIAN PAINTS LTD		7	9	1,587	2,412	素材	
AUROBINDO PHARMA LTD		5	8	345	525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVENUE SUPERMARTS LTD		2	2	506	769	食品・生活必需品小売り	
AXIS BANK LTD		54	61	4,566	6,941	銀行	
BAJAJ AUTO LTD		1	2	850	1,292	自動車・自動車部品	
BAJAJ FINANCE LTD		4	5	2,332	3,545	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD		0.80	1	1,089	1,655	保険	
BHARAT FORGE LTD		4	4	195	296	自動車・自動車部品	
BHARAT HEAVY ELECTROCALCS		17	—	—	—	資本財	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		15	22	1,173	1,783	エネルギー	
BHARTI AIRTEL LTD		36	70	3,096	4,706	電気通信サービス	
BHARTI INFRATEL LTD		7	7	183	279	電気通信サービス	

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BOSCH LTD	0.15	0.15	224	341	自動車・自動車部品
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	0.56	3	945	1,437	食品・飲料・タバコ
CADILA HEALTHCARE LTD	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIPLA LIMITED	7	10	506	769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	14	39	779	1,185	エネルギー
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1	6	347	527	運輸
DABUR INDIA LTD	10	16	750	1,140	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	—	2	424	645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR. REDDY'S LABORATORIES	2	3	954	1,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	0.35	0.35	761	1,156	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	21	42	533	810	公益事業
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2	2	101	153	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	7	11	779	1,185	家庭用品・パーソナル用品
GRASIM INDUSTRIES LTD	8	8	679	1,032	素材
HAVELLS INDIA LTD	4	7	531	808	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	13	17	1,949	2,962	ソフトウェア・サービス
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	—	20	1,148	1,746	保険
HERO MOTOCORP LTD	1	4	1,009	1,534	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	23	35	681	1,035	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	12	19	560	851	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	19	21	4,305	6,544	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	48	52	11,569	17,585	銀行
ICICI BANK LTD	67	76	3,792	5,764	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	—	4	587	892	保険
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	6	6	141	215	銀行
INDIAN OIL CORPORATION LTD	36	59	796	1,210	エネルギー
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	104	112	8,006	12,169	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	2	2	289	439	運輸
ITC LTD	104	104	2,612	3,971	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	17	25	634	964	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	13	15	2,088	3,174	資本財
LIC HOUSING FINANCE LTD	5	5	248	377	銀行
LUPIN LTD	4	4	356	542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	5	20	661	1,006	各種金融
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21	31	1,746	2,654	自動車・自動車部品
MARICO LTD	8	14	508	772	家庭用品・パーソナル用品
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3	3	2,324	3,533	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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
(インド)		百株	百株	千インド・ルピー	千円		
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD		20	20	274	416	自動車・自動車部品	
NESTLE INDIA LTD		0.62	0.62	875	1,330	食品・飲料・タバコ	
NTPC LTD		52	101	1,192	1,812	公益事業	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		26	79	1,057	1,606	エネルギー	
PAGE INDUSTRIES LTD		0.14	0.14	322	489	耐久消費財・アパレル	
PETRONET LNG LTD		8	18	509	774	エネルギー	
PIDILITE INDUSTRIES LTD		2	2	355	540	素材	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD		1	2	472	717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD		35	58	1,142	1,736	公益事業	
REC LTD		13	13	195	297	各種金融	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED		86	91	13,790	20,960	エネルギー	
SHREE CEMENT LTD		0.16	0.26	520	790	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		3	7	850	1,292	各種金融	
SIEMENS LTD		1	－	－	－	資本財	
STATE BANK OF INDIA		47	57	1,913	2,907	銀行	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS		27	27	1,175	1,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD		28	28	5,957	9,055	ソフトウェア・サービス	
TATA MOTORS LTD		42	42	711	1,081	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD		21	21	119	181	公益事業	
TATA STEEL LTD		6	11	465	707	素材	
TECH MAHINDRA LTD		12	15	1,159	1,763	ソフトウェア・サービス	
TITAN CO LTD		6	9	1,107	1,683	耐久消費財・アパレル	
ULTRATECH CEMENT LTD		2	3	1,238	1,882	素材	
UNITED SPIRITS LTD		6	6	371	565	食品・飲料・タバコ	
UPL LTD		7	16	888	1,350	素材	
VEDANTA LTD		30	57	815	1,239	素材	
VODAFONE IDEA LTD		28	213	129	196	電気通信サービス	
WIPRO LTD		25	38	974	1,480	ソフトウェア・サービス	
YES BANK LTD		41	55	353	537	銀行	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE		10	16	474	720	メディア・娯楽	
小計	株数・金額	1,417	2,074	110,641	168,174		
	銘柄数<比率>	79	79	－	<7.8%>		
(インドネシア)				千インドネシア・ルピア			
ADARO ENERGY TBK PT		271	271	35,772	275	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		584	648	430,920	3,318	自動車・自動車部品	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		307	347	1,095,652	8,436	銀行	
BANK DANAMON INDONESIA TBK		67	－	－	－	銀行	

ニッセイ新興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	
(インドネシア)		百株	百株	千円	
BANK MANDIRI TBK		539	604	431,860	3,325 銀行
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		158	232	176,320	1,357 銀行
BANK RAKYAT INDONESIA		1,599	1,794	751,686	5,787 銀行
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO		83	83	17,181	132 銀行
BARITO PACIFIC TBK PT		—	885	110,182	848 素材
BUMI SERPONG DAMAI PT		163	163	22,657	174 不動産
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT		144	226	161,590	1,244 食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT		11	11	59,015	454 食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		199	199	40,994	315 食品・飲料・タバコ
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		60	60	47,550	366 素材
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA		38	38	75,905	584 素材
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		46	46	52,555	404 食品・飲料・タバコ
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT		85	208	165,360	1,273 食品・飲料・タバコ
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		41	41	21,320	164 運輸
KALBE FARMA TBK PT		418	1,152	175,104	1,348 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB		47	—	—	— 小売
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT		—	43	52,460	403 素材
PAKUWON JATI TBK PT		453	453	26,953	207 不動産
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT		215	215	43,215	332 公益事業
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK		56	94	116,795	899 素材
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		111	111	14,541	111 メディア・娯楽
TELEKOMUNIKASI TBK PT		1,438	1,581	635,562	4,893 電気通信サービス
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		40	—	—	— 電気通信サービス
UNILEVER INDONESIA TBK PT		32	47	201,160	1,548 家庭用品・パーソナル用品
UNITED TRACTORS TBK PT		35	50	112,250	864 エネルギー
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		88	—	—	— 資本財
小計	株数・金額	7,328	9,602	5,074,560	39,074
	銘柄数<比率>	28	26	—	<1.8%>
(ブラジル)				千ブラジル・レアル	
AMBEV SA		144	151	266	6,899 食品・飲料・タバコ
ATACADAO SA		8	19	34	905 食品・生活必需品小売り
B2W CIA DIGITAL		—	6	32	837 小売
BANCO BRADESCO S.A.		28	39	122	3,175 銀行
BANCO BRADESCO SA-PREF		103	130	430	11,124 銀行
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		—	6	41	1,067 各種金融
BANCO DO BRASIL SA		24	28	128	3,315 銀行
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL		10	13	59	1,528 銀行

ニッセイ新興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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	15	22	74	1,936	保険
BM&FBOVESPA SA	60	67	321	8,306	各種金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	18	27	41	1,082	不動産
BRASKEM SA-PREF A	3	5	14	362	素材
BRF SA	10	16	53	1,388	食品・飲料・タバコ
CCR SA	26	38	64	1,670	運輸
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4	7	24	631	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4	7	25	648	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	—	1	0.027	0.702	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	—	1	0.057	1	公益事業
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	3	5	39	1,027	食品・生活必需品小売り
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	17	29	36	941	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6	10	51	1,334	公益事業
CIELO SA	27	39	29	771	ソフトウェア・サービス
COGNA EDUCACAO	29	42	43	1,114	消費者サービス
COSAN SA	3	8	48	1,248	エネルギー
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	6	—	—	—	公益事業
EMBRAER SA	14	20	34	899	資本財
ENERGISA SA-UNITS	—	6	28	737	公益事業
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	3	6	30	780	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	4	5	51	1,327	公益事業
FIBRIA CELULOSE SA	7	—	—	—	素材
GERDAU SA-PREF	22	31	47	1,226	素材
HYPERA S.A	6	11	37	958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	3	24	88	2,283	保険
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	99	156	549	14,217	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	137	137	184	4,764	銀行
JBS SA	16	35	92	2,398	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	19	19	33	865	素材
LOCALIZA RENT A CAR	11	19	77	2,015	運輸
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	15	23	45	1,187	小売
LOJAS RENNER S.A.	22	24	122	3,165	小売
M DIAS BRANCO SA	2	2	6	173	食品・飲料・タバコ
MAGAZINE LUIZA SA	2	16	71	1,842	小売
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	6	6	17	445	不動産
NATURA COSMETICOS SA	3	12	37	967	家庭用品・パーソナル用品
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	—	9	51	1,326	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ新興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
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・レアル	千円		
ODONTOPREV S.A.		5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		85	95	296	7,677	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		120	132	379	9,824	エネルギー	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		8	26	71	1,861	小売	
PORTO SEGURO SA		2	2	11	302	保険	
RAIA DROGASIL SA		6	8	89	2,312	食品・生活必需品小売り	
RUMO SA		24	34	80	2,092	運輸	
SUL AMERICA SA - UNITS		4	7	36	932	保険	
SUZANO S.A.		12	15	57	1,492	素材	
TELEF BRASIL		10	14	78	2,019	電気通信サービス	
TIM PARTICIPACOES SA		18	35	46	1,207	電気通信サービス	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		9	22	45	1,175	エネルギー	
VALE SA		96	101	489	12,664	素材	
WEG SA		22	22	65	1,706	資本財	
小計	株数・金額	1,362	1,794	5,343	138,172		
	銘柄数<比率>	53	56	—	<6.4%>		
(チェコ)				千チェコ・コルナ			
CEZ AS		3	5	295	1,390	公益事業	
KOMERCNI BANKA AS		1	1	147	696	銀行	
MONETA MONEY BANK AS		11	11	89	421	銀行	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS		1	—	—	—	電気通信サービス	
小計	株数・金額	18	18	532	2,508		
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.1%>		
(韓国)				千韓国ウォン			
AMOREPACIFIC CORP		0.79	1	19,110	1,775	家庭用品・パーソナル用品	
AMOREPACIFIC CORP-PREF		0.17	0.17	1,506	139	家庭用品・パーソナル用品	
AMOREPACIFIC GROUP		0.60	0.60	4,716	438	家庭用品・パーソナル用品	
BGF RETAIL CO LTD/NEW		0.15	0.15	2,700	250	食品・生活必需品小売り	
BNK FINANCIAL GROUP INC		5	15	11,215	1,041	銀行	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		0.73	1	7,833	727	ヘルスケア機器・サービス	
CELLTRION INC		2	2	50,829	4,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION PHARM INC		0.34	0.34	1,315	122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHEIL WORLDWIDE INC		1	1	3,181	295	メディア・娯楽	
CJ CHEILJEDANG CORP		0.15	0.26	6,487	602	食品・飲料・タバコ	
CJ CORP		0.28	1	12,025	1,117	資本財	
CJ ENM CO LTD		0.28	0.28	4,219	392	小売	
CJ LOGISTICS		0.16	0.16	2,560	237	運輸	

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	0.53	0.89	8,348	775	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	2	2	1,127	104	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	—	1	3,117	289	資本財
DAUM COMMUNICATIONS CORP	1	1	24,727	2,297	メディア・娯楽
DB INSURANCE CO LTD	1	1	8,838	821	保険
DGB FINANCIAL GROUP INC	3	—	—	—	銀行
DONGSUH COMPANIES INC	0.66	—	—	—	食品・生活必需品小売り
DOOSAN BOBCAT INC	0.69	2	8,826	819	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1	—	—	—	資本財
E-MART CO LTD	0.43	0.63	8,316	772	食品・生活必需品小売り
FILA KOREA LTD	—	1	8,670	805	耐久消費財・アパレル
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	0.96	1	6,053	562	資本財
GS HOLDINGS CORP	1	3	15,931	1,480	エネルギー
GS RETAIL CO LTD	0.52	0.52	2,080	193	食品・生活必需品小売り
HANA FINANCIAL GROUP	8	9	35,271	3,276	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	1	4	13,894	1,290	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD	0.13	0.21	6,919	642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SCIENCE CO LTD	0.25	0.25	988	91	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	3	9	10,560	981	自動車・自動車部品
HANSSEM CO LTD	0.20	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANWHA CHEMICAL CORP	2	2	4,143	384	素材
HANWHA CORPORATION	0.83	4	11,158	1,036	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	5	5	1,187	110	保険
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	0.67	0.67	1,956	181	資本財
HELIXMITH CO LTD	0.30	0.53	5,310	493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HLB INC	0.69	0.69	9,404	873	耐久消費財・アパレル
HOTEL SHILLA CO LTD	0.61	0.99	8,088	751	小売
HYUNDAI DEPT STORE CO	0.26	0.26	2,064	191	小売
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2	2	9,190	853	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	0.35	0.59	8,938	830	運輸
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	0.21	0.31	10,540	979	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1	1	3,425	318	保険
HYUNDAI MOBIS	1	2	56,026	5,204	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	4	4	59,500	5,527	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	0.78	1	13,694	1,272	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	0.45	0.45	3,370	313	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	1	2	8,307	771	素材

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5	7	9,522	884	銀行
KANGWON LAND INC	2	3	11,259	1,045	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	12	13	62,321	5,789	銀行
KCC CORP	0.11	0.11	2,425	225	資本財
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	0.44	—	—	—	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORPORATION	6	8	35,322	3,281	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1	1	5,414	502	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	6	7	22,199	2,062	公益事業
KOREA GAS CORPORATION	0.54	0.54	2,173	201	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	0.83	1	9,924	921	各種金融
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	1	1	11,716	1,088	資本財
KOREA ZINC CO LTD	0.17	0.26	11,024	1,024	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	0.87	0.87	2,288	212	運輸
KT&G CORP	3	3	36,691	3,408	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	0.35	0.35	2,593	240	素材
LG CHEM LTD	1	1	46,672	4,335	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.15	0.15	2,632	244	素材
LG CORP	2	3	22,687	2,107	資本財
LG DISPLAY CO LTD	4	7	10,251	952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	2	3	23,223	2,157	耐久消費財・アパレル
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	0.29	0.36	43,740	4,063	家庭用品・パーソナル用品
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.04	0.04	2,996	278	家庭用品・パーソナル用品
LG INNOTEK CO LTD	0.28	0.28	3,346	310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	2	9	11,621	1,079	各種金融
LG UPLUS CORP	5	3	4,774	443	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	0.45	0.45	10,035	932	素材
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.57	0.57	2,091	194	資本財
LOTTE SHOPPING CO	0.22	0.22	2,937	272	小売
MEDY-TOX INC	0.08	0.08	2,368	219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MERITZ SECURITIES CO LTD	—	10	4,513	419	各種金融
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	7	13	9,656	897	各種金融
NAVER CORP	4	4	72,803	6,763	メディア・娯楽
NCSoft CORPORATION	0.47	0.56	31,416	2,918	メディア・娯楽
NETMARBLE CORPORATION	0.58	0.58	5,092	473	メディア・娯楽
OCI CO LTD	0.32	0.32	2,057	191	素材
ORANGE LIFE INSURANCE, LTD.	0.65	0.65	1,865	173	保険
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.43	0.43	4,665	433	食品・飲料・タバコ

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
			株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
OTTOGI CORPORATION		0.02	0.02	1,128	104	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP		0.13	0.13	2,437	226	メディア・娯楽
POSCO		2	2	56,826	5,279	素材
POSCO CHEMICAL CO LTD		－	0.74	3,570	331	素材
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION		0.69	0.69	1,331	123	資本財
S-1 CORPORATION		0.32	0.32	3,078	285	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD		0.44	0.53	21,147	1,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP		2	2	27,604	2,564	資本財
SAMSUNG CARD CO		0.58	0.58	2,148	199	各種金融
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO		1	1	19,178	1,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		146	150	806,833	74,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD		26	26	112,102	10,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD		3	3	6,543	607	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD		0.89	0.89	20,781	1,930	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES		11	11	8,044	747	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD		1	2	16,537	1,536	保険
SAMSUNG SDI CO LTD		1	1	42,922	3,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD		0.93	1	22,769	2,115	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD		1	3	13,280	1,233	各種金融
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD		13	14	62,781	5,832	銀行
SHINSEGAE CO LTD		0.14	0.14	3,745	347	小売
SILLAJEN INC		1	1	3,411	316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK HOLDINGS CO LTD		0.78	1	30,520	2,835	資本財
SK HYNIX INC		17	17	147,398	13,693	半導体・半導体製造装置
SK INNOVATION CO LTD		1	1	27,579	2,562	エネルギー
SK TELECOM CO LTD		0.42	0.62	15,221	1,414	電気通信サービス
S-OIL CORPORATION		0.94	1	13,069	1,214	エネルギー
STX PAN OCEAN CO LTD		4	4	1,811	168	運輸
WOONGJIN COWAY CO LTD		1	1	14,409	1,338	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK		12	－	－	－	銀行
WOORI FINANCIAL GROUP INC		－	15	18,714	1,738	銀行
YUHAN CORP		0.16	0.28	6,076	564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	399	480	2,587,005	240,332	
	銘柄数<比率>	114	113	－	<11.1%>	
(中国)				千人民元		
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		－	80	28	444	銀行
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		－	10	44	692	素材

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	86	48	744	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	—	45	16	252	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	37	20	317	銀行
BANK OF NINGBO CO LTD -A	—	17	49	761	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	—	45	41	639	銀行
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	—	110	41	633	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	97	42	648	銀行
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	—	5	43	671	消費者サービス
CHINA MERCHANTS BANK-A	8	37	138	2,143	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	—	27	44	687	各種金融
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	—	19	35	541	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-A	—	35	21	331	銀行
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	—	113	39	603	素材
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	—	106	50	785	公益事業
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	—	6	21	329	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	—	84	41	635	エネルギー
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	88	49	756	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	—	78	41	635	資本財
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	—	41	20	317	資本財
CHINA UNITED NETWORK-A	—	92	54	835	電気通信サービス
CHINA VANKE CO LTD -A	—	9	24	371	不動産
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	—	45	81	1,255	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A	—	10	22	341	各種金融
CRRC CORP LTD-A	—	23	15	246	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	29	41	646	各種金融
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	—	2	22	351	食品・飲料・タバコ
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	26	41	645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GF SECURITIES CO LTD-A	—	37	49	768	各種金融
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	—	8	47	734	耐久消費財・アパレル
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	33	55	864	各種金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	29	40	632	各種金融
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	—	22	74	1,154	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	—	28	40	620	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	21	36	558	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	—	62	46	719	銀行
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	—	5	38	591	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	—	12	40	627	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興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	
(中国)		百株	百株	千人民元 千円	
IND & COMM BK OF CHINA-A	—	56	32	505	銀行
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	—	22	43	673	銀行
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	—	324	41	640	素材
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	—	6	17	276	食品・飲料・タバコ
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	—	5	47	738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	—	4	39	605	食品・飲料・タバコ
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1	2	246	3,805	食品・飲料・タバコ
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	—	18	63	984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	—	4	34	528	食品・飲料・タバコ
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	—	205	53	826	資本財
MIDEA GROUP CO LTD-A	—	3	17	267	耐久消費財・アパレル
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	—	5	47	738	食品・飲料・タバコ
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	—	9	41	645	保険
PETROCHINA CO LTD-A	—	69	38	590	エネルギー
PING AN BANK CO LTD-A	—	18	29	456	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4	19	168	2,607	保険
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	—	27	39	604	不動産
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	—	100	41	639	資本財
SAIC MOTOR CORP LTD-A	—	8	18	281	自動車・自動車部品
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	—	30	43	678	資本財
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	—	31	37	585	銀行
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	—	110	52	808	各種金融
SUNING.COM CO LTD-A	—	44	44	691	小売
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	—	9	41	641	素材
WEICHAI POWER CO LTD-A	—	34	44	685	資本財
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	5	18	282	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	—	7	93	1,442	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	—	5	46	725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZTE CORP-A	—	7	22	344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	13	2,845	3,163	48,841
	銘柄数<比率>	3	68	—	<2.3%>
(マレーシア)				千マレーシア・リンギット	
AIRASIA GROUP BERHAD	25	25	4	121	運輸
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	20	20	5	148	銀行
AMBANK HOLDINGS BHD	32	97	40	1,058	銀行
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	28	—	—	—	メディア・娯楽
AXIATA GROUP BERHAD	57	87	37	990	電気通信サービス

ニッセイ新興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	
(マレーシア)	百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	3	3	4	128	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	126	155	83	2,176	銀行
DIALOG GROUP BHD	99	99	34	891	エネルギー
DIGI.COM BHD	65	96	44	1,160	電気通信サービス
FGV HOLDINGS BHD	29	－	－	－	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3	3	10	272	食品・飲料・タバコ
GAMUDA BHD	31	31	11	307	資本財
GENTING BHD	45	67	41	1,071	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	59	59	19	500	消費者サービス
GENTING PLANTATIONS BHD	5	5	5	133	食品・飲料・タバコ
HAP SENG CONSOLIDATED	11	11	10	285	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	26	47	25	658	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG BANK BERHAD	13	22	37	976	銀行
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	4	19	31	832	銀行
IHH HEALTHCARE BHD	63	63	34	896	ヘルスケア機器・サービス
IJM CORP BHD	52	52	10	286	資本財
IOI CORPORATION BHD	44	44	19	508	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	35	－	－	－	不動産
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	11	11	24	645	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	122	122	105	2,754	銀行
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	16	49	40	1,061	運輸
MAXIS BHD	62	62	33	864	電気通信サービス
MISC BHD	24	24	19	519	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1	2	28	752	食品・飲料・タバコ
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	62	78	57	1,498	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	4	16	38	1,011	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	15	22	36	958	公益事業
PPB GROUP BERHAD	10	18	34	891	食品・飲料・タバコ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	24	70	33	867	素材
PUBLIC BANK BHD	91	99	198	5,167	銀行
QL RESOURCES BHD	－	20	14	386	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	16	87	50	1,317	銀行
SIME DARBY BERHAD	48	48	11	294	資本財
SIME DARBY PLANTATION BHD	52	77	39	1,032	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD	48	48	3	102	不動産
SP SETIA BHD	23	23	3	84	不動産
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	22	8	217	電気通信サービス

ニッセイ新興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	
(マレーシア)		百株	百株	千円・リンギット	千円	
TENAGA NASIONAL BHD		97	97	133	3,483	公益事業
TOP GLOVE CORP BHD		30	30	13	359	ヘルスケア機器・サービス
UMW HOLDINGS BHD		11	—	—	—	自動車・自動車部品
WESTPORTS HOLDINGS BHD		18	18	7	202	運輸
YTL CORPORATION BERHAD		83	83	7	194	公益事業
小計	株数・金額	1,766	2,132	1,458	38,073	
	銘柄数<比率>	46	43	—	<1.8%>	
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD		22	22	362	2,661	銀行
ANGLO PLATINUM LTD		1	2	290	2,137	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		9	12	376	2,768	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		9	9	117	864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD		8	10	366	2,694	食品・生活必需品小売り
BIDVEST GROUP LTD		8	8	193	1,419	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		0.86	1	192	1,418	銀行
CLICKS GROUP LTD		5	7	205	1,509	食品・生活必需品小売り
CORONATION FUND MANAGERS LTD		4	—	—	—	各種金融
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED		7	11	144	1,062	保険
EXXARO RESOURCES LTD		4	7	102	753	エネルギー
FIRSTRAND LTD		103	103	709	5,211	各種金融
GOLD FIELDS LTD		19	31	250	1,844	素材
IMPERIAL LOGISTICS LTD		3	—	—	—	運輸
INVESTEC LTD		5	9	78	575	各種金融
KUMBA IRON ORE LTD		1	2	81	597	素材
LIBERTY HOLDINGS LTD		2	2	26	195	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		24	40	99	733	ヘルスケア機器・サービス
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD		17	17	37	273	保険
MONDI LTD		2	—	—	—	素材
MR PRICE GROUP LTD		6	6	110	812	小売
MTN GROUP LTD		48	54	521	3,832	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD		—	13	166	1,222	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS		13	18	4,264	31,344	小売
NEDBANK GROUP LTD		10	12	295	2,170	銀行
NEPI ROCKCASTLE PLC		7	11	146	1,080	不動産
NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS		18	35	68	505	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL LTD		151	151	301	2,217	保険
PICK N PAY STORES LTD		6	6	47	347	食品・生活必需品小売り

ニッセイ新興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	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
PIONEER FOODS GROUP LTD		2	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PSG GROUP LTD		4	4	96	710	各種金融
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL		12	51	160	1,177	保険
REINET INVESTMENTS SCA		3	3	95	703	各種金融
REMGRO LTD		13	16	298	2,193	各種金融
RMB HOLDINGS LTD		14	21	181	1,336	各種金融
SANLAM LIMITED		52	68	565	4,159	保険
SAPPI LIMITED		11	11	44	329	素材
SASOL LTD		16	17	510	3,751	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD		11	14	201	1,480	食品・生活必需品小売り
SPAR GROUP LIMITED/THE		3	5	125	923	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD		39	41	744	5,471	銀行
TELKOM SA SOC LTD		4	4	24	179	電気通信サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		4	7	114	842	小売
TIGER BRANDS LTD		3	5	119	880	食品・飲料・タバコ
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		8	8	47	350	小売
VODACOM GROUP LTD		15	20	264	1,943	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		20	29	172	1,266	小売
小計	株数・金額	769	943	13,326	97,953	
	銘柄数<比率>	46	43	—	<4.5%>	
(タイ)				千タイ・パーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG		28	38	862	3,088	電気通信サービス
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR		125	137	1,109	3,972	運輸
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG		5	16	278	996	銀行
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F		74	296	713	2,553	ヘルスケア機器・サービス
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN		144	236	254	912	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG		38	134	154	551	エネルギー
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN		24	60	279	998	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL		111	195	273	977	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN		6	13	171	614	ヘルスケア機器・サービス
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI		30	72	466	1,668	不動産
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN		58	102	260	931	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-FOREIGN		142	185	1,419	5,083	食品・生活必需品小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN		10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R		2	10	354	1,267	公益事業
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN		22	42	185	665	公益事業
GLOW ENERGY PCL - FOREIGN		10	—	—	—	公益事業

ニッセイ新興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
(タイ)		百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN		－	15	261	934	公益事業	
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR		74	184	312	1,119	小売	
INDORAMA VENTURES-FOREIGN		30	51	163	584	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-F		－	63	403	1,443	電気通信サービス	
IRPC PCL - FOREIGN		184	701	238	853	エネルギー	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		54	72	1,072	3,840	銀行	
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI		67	114	188	673	銀行	
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG		87	213	211	758	不動産	
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR		41	71	260	934	消費者サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG		－	21	127	456	各種金融	
PTT EXPLORATION & PROD-FOR		37	37	444	1,589	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR		59	72	381	1,366	素材	
PTT PCL/FOREIGN		320	360	1,575	5,638	エネルギー	
RATCH GROUP PCL-FOREIGN		－	23	170	609	公益事業	
ROBINSON PCL-FOREIGN		10	10	65	233	小売	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG		9	25	965	3,454	素材	
SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG		52	28	324	1,162	銀行	
THAI OIL PCL-FRGN		24	24	163	584	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-F		37	98	132	473	食品・飲料・タバコ	
TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN		271	271	37	135	銀行	
TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN		－	22	131	470	電気通信サービス	
TRUE CORP PCL-FOREIGN		202	364	158	568	電気通信サービス	
小計	株数・金額	2,387	4,375	14,571	52,167		
	銘柄数<比率>	33	36	－	<2.4%>		
(ポーランド)				千ポーランド・ズロチ			
ALIOR BANK SA		1	1	5	159	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		0.75	－	－	－	銀行	
BANK MILLENNIUM SA		12	47	28	787	銀行	
BANK PEKAO SA		4	4	48	1,369	銀行	
CCC SA		0.57	0.57	6	180	耐久消費財・アパレル	
CD PROJEKT SA		1	2	57	1,621	メディア・娯楽	
CYFROWY POLSAT SA		4	4	12	345	メディア・娯楽	
DINO POLSKA SA		0.96	0.96	13	380	食品・生活必需品小売り	
GRUPA AZOTY SA		0.89	－	－	－	素材	
GRUPA LOTOS SA		1	2	26	734	エネルギー	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		1	1	2	58	素材	
KGHM POLSKA MIEDZ SA		2	4	40	1,127	素材	

ニッセイ新興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
(ポーランド)		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円		
LPP SA		0.02	0.04	34	959	耐久消費財・アパレル	
MBANK SA		0.30	1	41	1,175	銀行	
ORANGE POLSKA SA		13	13	8	248	電気通信サービス	
PGE SA		17	17	15	433	公益事業	
PKO BANK POLSKI SA		27	27	102	2,869	銀行	
PLAY COMMUNICATIONS SA		2	－	－	－	電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		8	8	83	2,328	エネルギー	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		36	54	25	719	エネルギー	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		16	19	75	2,113	保険	
SANTANDER BANK POLSKA S.A.		0.76	1	33	939	銀行	
小計	株数・金額	156	212	662	18,552		
	銘柄数<比率>	22	19	－	<0.9%>		
(ハンガリー)				千ハンガリー・フォリント			
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		6	9	2,905	1,050	エネルギー	
OTP BANK RT		6	6	9,276	3,353	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT		2	6	3,738	1,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額	15	22	15,920	5,755		
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.3%>		
(ユーロ／ギリシャ)				千ユーロ			
FF GROUP		1	1	0.619	74	小売	
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION		7	12	17	2,082	電気通信サービス	
JUMBO SA		3	5	10	1,323	小売	
MOTOR OIL (HELLAS) SA		2	2	5	656	エネルギー	
OPAP SA		6	13	13	1,581	消費者サービス	
TITAN CEMENT CO. S.A.		1	－	－	－	素材	
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		－	3	6	803	素材	
小計	株数・金額	23	39	54	6,522		
	銘柄数<比率>	6	6	－	<0.3%>		
合計	株数・金額	58,480	84,605	－	1,850,663		
	銘柄数<比率>	834	920	－	<85.7%>		

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

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

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

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

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末		
			口数	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
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF		7	9	133	14,502
ISHARES MSCI QATAR CP ETF		9	10	191	20,783
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		—	15	456	49,544
小計	口数・金額	16	35	781	84,830
	銘柄数<比率>	2	3	—	<3.9%>
(トルコ)				千トルコ・リラ	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		3	—	—	—
小計	口数・金額	3	—	—	—
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—>
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		8	8	266	1,494
小計	口数・金額	8	8	266	1,494
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		6	9	205	1,513
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		0.485	—	—	—
RESILIENT REIT LTD		0.631	—	—	—
REDEFINE PROPERTIES LTD		14	29	245	1,806
FORTRESS REIT LTD-A		1	3	77	569
FORTRESS REIT LTD-B		1	—	—	—
小計	口数・金額	25	42	529	3,889
	銘柄数<比率>	6	3	—	<0.2%>
合計	口数・金額	55	86	—	90,215
	銘柄数<比率>	10	7	—	<4.2%>

(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
外国 MINI MSCI EM INDEX FUTURES	百万円 183	百万円 —

(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

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,850,663	85.1
投資信託証券	90,215	4.1
コール・ローン等、その他	234,379	10.8
投資信託財産総額	2,175,258	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108.61円、1香港ドル13.88円、1台湾ドル3.56円、1イギリス・ポンド140.33円、1トルコ・リラ19.03円、1メキシコ・ペソ5.61円、1フィリピン・ペソ2.13円、100チリ・ペソ13.79円、100コロンビア・ペソ3.16円、1インド・ルピー1.52円、100インドネシア・ルピア0.77円、1ブラジル・レアル25.86円、1チェコ・コルナ4.71円、100韓国ウォン9.29円、1人民元15.44円、1マレーシア・リングgit26.10円、1南アフリカ・ランド7.35円、1タイ・バーツ3.58円、1ポーランド・ズロチ28.01円、100ハンガリー・フォリント36.15円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産（2,088,262千円）の投資信託財産総額（2,175,258千円）に対する比率は96.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,286,368,867円
コール・ローン等	156,979,444
株式(評価額)	1,850,663,620
投資信託証券(評価額)	90,215,065
未収入金	117,673,204
未収配当金	1,291,471
差入委託証拠金	69,546,063
(B)負債	125,849,834
未払金	111,537,253
未払解約金	14,311,923
その他未払費用	658
(C)純資産総額(A-B)	2,160,519,033
元本	2,309,692,542
次期繰越損益金	△ 149,173,509
(D)受益権総口数	2,309,692,542口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,354円

(注1) 期首元本額 1,844,866,571円
 期中追加設定元本額 1,061,417,332円
 期中一部解約元本額 596,591,361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。

ニッセイ新興国株式インデックスファンド
 (適格機関投資家限定) 787,226,995円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックス
 ファンド 1,413,724,632円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)
 49,901,389円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)
 7,015,043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)
 2,005,205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) 32,645,881円
 DCニッセイ新興国株式インデックス 17,173,397円

(注3) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は
 149,173,509円です。

損益の状況

当期 (2018年11月21日～2019年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	45,025,454円
受取配当金	43,685,497
受取利息	738,374
その他収益	665,161
支払利息	△ 63,578
(B)有価証券売買損益	61,717,899
売買益	259,143,242
売買損	△ 197,425,343
(C)先物取引等損益	7,450,901
取引益	29,666,208
取引損	△ 22,215,307
(D)信託報酬等	△ 7,748,175
(E)当期損益金(A+B+C+D)	106,446,079
(F)前期繰越損益金	△ 203,294,197
(G)追加信託差損益金	△ 107,694,668
(H)解約差損益金	55,369,277
(I)合計(E+F+G+H)	△ 149,173,509
次期繰越損益金(I)	△ 149,173,509

(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Ｊ－ＲＥＩＴ インデックスマザーファンド

運用報告書

第 25 期

(計算期間：2019年5月14日～2019年11月12日)

運用方針	①国内の金融商品取引所に上場しているＪリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。 ②Ｊリートへの投資にあたっては、東証ＲＥＩＴ指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証ＲＥＩＴ指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜追加・見直しを行います。
主要運用対象	国内の金融商品取引所に上場しているＪリート

運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における時価の構成割合が30％を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ・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

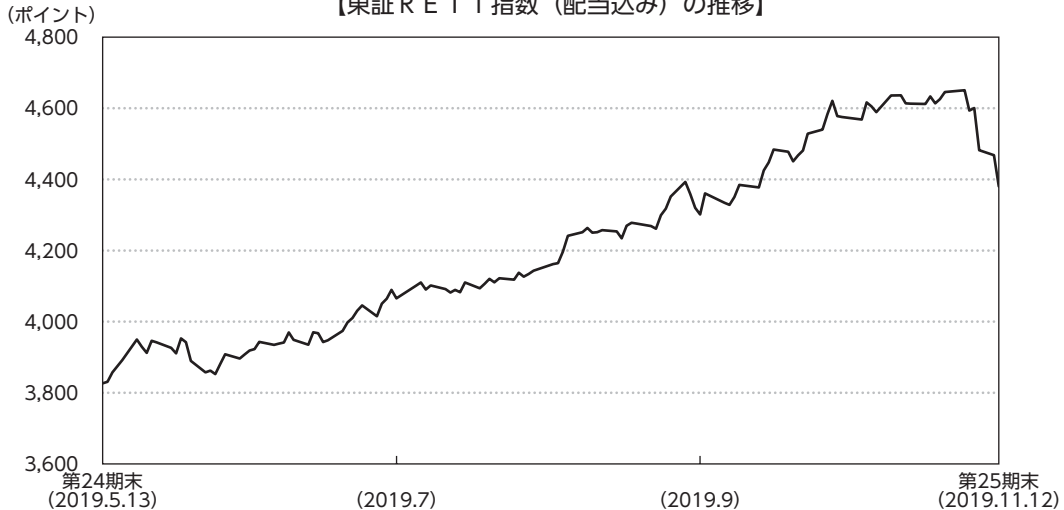
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年5月14日～2019年11月12日

Jリート市況

【東証REIT指数（配当込み）の推移】

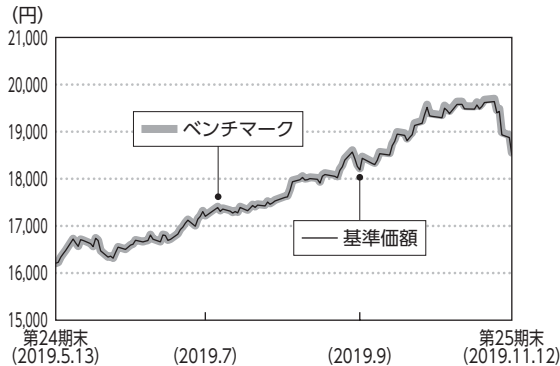


（注）指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期のＪリート市場は上昇しました。

期初以降のＪリート市場は、魅力的な配当利回り水準にあることや良好な不動産賃貸市況を背景とした着実な配当金成長を実現していることに加えて、活発な不動産売買市場を活用した物件入れ替えによる資産価値の顕在化やこれまで以上に収益性に連動した運用報酬体系への移行といったＪリート各社による投資主価値向上を目的とした取り組みが評価され上昇基調で推移しました。当期末には米中貿易協議の進展に対する期待の高まりを受けて金利が上昇するとともに株式市場で投資家のリスク選好姿勢が強まったことを背景に、これまで相対的に高い配当利回りと業績の安定的な成長が評価されていたＪリート市場から株式市場へ資金移動が生じたためＪリート市場は急落しましたが、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

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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「Ｊリート市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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。

ポートフォリオの構築・運用は、東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は＋14.2%となり、ベンチマーク騰落率（＋14.5%）を下回りました。これは未収配当を含めたキャッシュ保有の影響などによるものです。

今後の運用方針

東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄について完全法にて投資を行い、ベンチマークの動きに連動する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	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
21期 (2017年11月13日)	12,990	△ 6.8	12,633	△ 6.9	98.3	14,369
22期 (2018年 5 月14日)	14,359	10.5	13,977	10.6	98.4	16,412
23期 (2018年11月12日)	15,019	4.6	14,633	4.7	98.4	17,161
24期 (2019年 5 月13日)	16,209	7.9	15,818	8.1	98.5	20,640
25期 (2019年11月12日)	18,510	14.2	18,107	14.5	98.6	31,230

(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	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%
(期首) 2019年 5 月13日	16,209	－	15,818	－	98.5
5 月末	16,472	1.6	16,079	1.6	98.7
6 月末	16,715	3.1	16,319	3.2	98.4
7 月末	17,434	7.6	17,032	7.7	98.5
8 月末	18,082	11.6	17,676	11.7	98.1
9 月末	18,921	16.7	18,510	17.0	98.5
10月末	19,536	20.5	19,122	20.9	98.5
(期末) 2019年11月12日	18,510	14.2	18,107	14.5	98.6

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2019年5月14日～2019年11月12日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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（17,799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5月14日～2019年11月12日

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
	エスコンジャパンリート投資法人	0.082	9,568	0.012	1,424
	サンケイリアルエステート投資法人	0.214	25,644	0.015	1,809
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.264	172,914	0.037	24,178
	MCUBS Midcity投資法人	1	119,323	0.120	13,977
	森ヒルズリート投資法人	0.917	151,838	0.123	20,738
	産業ファンド投資法人	1	164,238	0.136	21,379
	アドバンス・レジデンス投資法人	0.822	283,237	0.231	78,599
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.497	100,947	0.063	13,076
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.408	212,807	0.119	61,418
	GLP投資法人	1	267,163	0.259	34,260
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.334	111,184	0.046	15,481
	日本プロロジスリート投資法人	1	366,381	0.158	44,582
	星野リゾート・リート投資法人	0.121	69,000	0.018	10,253
	Oneリート投資法人	0.143	43,978	0.015	4,818
	イオンリート投資法人	0.973	138,011	0.123	17,891
国内	ヒューリックリート投資法人	0.759	147,791	0.087	17,276
	日本リート投資法人	0.260	115,180	0.034	15,545
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6	120,340	0.643	12,947
	日本ヘルスケア投資法人	0.044	8,304	0.005	953
	積水ハウス・リート投資法人	3	267,356	0.322	29,665
	トーセイ・リート投資法人	0.247	33,010	0.044	5,537
	ケネディクス商業リート投資法人	0.351	97,762	0.045	12,372
	ヘルスケア&メディカル投資法人	0.175	23,335	0.021	2,783
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.160	18,876	0.024	2,790
	野村不動産マスターファンド投資法人	2	459,505	0.345	65,398
	いちごホテルリート投資法人	0.135	17,251	0.042	5,301
	ラサールロジポート投資法人	1	160,737	0.090	13,810
	スターアジア不動産投資法人	0.306	35,731	0.033	3,785
	マリモ地方創生リート投資法人	0.070	8,641	0.011	1,393
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.199	82,862	0.023	9,759
	大江戸温泉リート投資法人	0.149	13,361	0.015	1,418
	さくら総合リート投資法人	0.170	16,284	0.023	2,177

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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
国内		千口	千円	千口	千円
	投資法人みらい	0.866	50,571	0.110	6,371
	森トラスト・ホテルリート投資法人	0.186	26,447	0.026	3,715
	三菱地所物流リート投資法人	0.348	115,695	0.016	5,411
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.194	24,706	0.011	1,486
	ザイマックス・リート投資法人	0.226	29,567	0.012	1,562
	タカラレーベン不動産投資法人	0.509	60,850	0.024	2,835
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.122	13,518	0.016	1,848
	日本ビルファンド投資法人	0.774	608,357	0.113	89,426
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.799	557,219	0.116	81,646
	日本リテールファンド投資法人	1	337,626	0.219	51,417
	オリックス不動産投資法人	1	351,081	0.232	52,520
	日本プライムリアルティ投資法人	0.507	250,077	0.075	37,316
	プレミアム投資法人	0.735	111,638	0.221	32,971
	東急リアル・エステート投資法人	0.536	107,366	0.078	15,427
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.557	79,175	0.077	10,769
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1	371,255	0.262	53,299
	森トラスト総合リート投資法人	0.570	107,503	0.082	15,419
	インヴィンシブル投資法人	5	341,977	0.408	26,192
	フロンティア不動産投資法人	0.318	147,489	0.043	20,508
	平和不動産リート投資法人	0.499	67,159	0.074	10,091
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.522	138,403	0.076	20,404
	福岡リート投資法人	0.414	74,912	0.061	11,038
	ケネディクス・オフィス投資法人	0.247	199,711	0.036	29,159
	いちごオフィスリート投資法人	0.633	67,823	0.224	23,456
	大和証券オフィス投資法人	0.185	150,843	0.027	22,124
	阪急阪神リート投資法人	0.360	57,598	0.048	8,120
	スターツプロシード投資法人	0.125	24,102	0.022	4,163
	大和ハウスリート投資法人	1	306,143	0.140	40,965
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2	220,442	0.370	32,489
	日本賃貸住宅投資法人	0.900	85,726	0.132	12,589
	ジャパンエクセレント投資法人	0.716	121,446	0.105	18,497

(注1) 金額は受渡代金です。

(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。

組入有価証券明細表

2019年11月12日現在

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.222	0.292	35,653
サンケイリアルエステート投資法人	0.214	0.413	48,857
日本アコモデーションファンド投資法人	0.720	0.947	625,020
MCUBS MidCity投資法人	2	3	380,137
森ヒルズリート投資法人	2	3	552,998
産業ファンド投資法人	2	3	577,624
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2	917,329
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1	362,755
アクティブ・プロパティーズ投資法人	1	1	784,850
GLP投資法人	5	7	933,702
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.898	1	405,019
日本プロロジスリート投資法人	2	4	1,177,146
星野リゾート・リート投資法人	0.330	0.433	242,047
Oneリート投資法人	0.316	0.444	142,524
イオンリート投資法人	2	3	440,811
ヒューリックリート投資法人	1	2	475,150
日本リート投資法人	0.699	0.925	435,212
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12	18	363,294
日本ヘルスケア投資法人	0.099	0.138	26,910
積水ハウス・リート投資法人	5	8	766,360
トーセイ・リート投資法人	0.417	0.620	80,042
ケネディクス商業リート投資法人	0.794	1	298,210
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.454	0.608	78,918
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.434	0.570	64,809
野村不動産マスターファンド投資法人	6	8	1,696,844
いちごホテルリート投資法人	0.379	0.472	61,501
ラサールロジポート投資法人	1	2	414,038
スターアジア不動産投資法人	0.672	0.945	104,422
マリモ地方創生リート投資法人	0.186	0.245	31,017
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.526	0.702	302,562
大江戸温泉リート投資法人	0.350	0.484	46,270
さくら総合リート投資法人	0.469	0.616	56,364

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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
	千口	千口	千円
投資法人みらい	2	3	178,293
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.508	0.668	93,252
三菱地所物流リート投資法人	0.229	0.561	193,825
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.217	0.400	52,040
ザイマックス・リート投資法人	0.200	0.414	53,406
タカラレーベン不動産投資法人	0.324	0.809	94,653
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.335	0.441	50,803
日本ビルファンド投資法人	2	2	2,160,297
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	2	1,997,149
日本リテールファンド投資法人	4	5	1,298,082
オリックス不動産投資法人	4	5	1,320,237
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	876,258
プレミア投資法人	2	2	392,382
東急リアル・エステート投資法人	1	1	371,495
グローバル・ワン不動産投資法人	1	1	267,030
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	6	1,344,649
森トラスト総合リート投資法人	1	2	380,324
インヴィンシブル投資法人	7	12	777,251
フロンティア不動産投資法人	0.737	1	475,134
平和不動産リート投資法人	1	1	242,683
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	1	499,306
福岡リート投資法人	1	1	263,667
ケネディクス・オフィス投資法人	0.670	0.881	710,086
いちごオフィスリート投資法人	1	2	236,262
大和証券オフィス投資法人	0.500	0.658	538,244
阪急阪神リート投資法人	0.975	1	221,750
スターツプロシード投資法人	0.341	0.444	87,379
大和ハウスリート投資法人	2	3	1,133,095
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6	9	780,045
日本賃貸住宅投資法人	2	3	309,826
ジャパンエクセレント投資法人	1	2	456,884
合計	口数・金額	119	164
	銘柄数<比率>	63	63
			30,784,197
			<98.6%>

(注1) 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。

投資信託財産の構成

2019年11月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	30,784,197	95.5
コール・ローン等、その他	1,439,226	4.5
投資信託財産総額	32,223,423	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月12日現在)

項目	当期末
(A) 資産	32,223,423,559円
コール・ローン等	792,647,436
投資信託証券(評価額)	30,784,197,200
未収入金	415,966,524
未収配当金	230,612,399
(B) 負債	992,477,248
未払解約金	992,471,957
その他未払費用	5,291
(C) 純資産総額(A-B)	31,230,946,311
元本	16,872,685,759
次期繰越損益金	14,358,260,552
(D) 受益権総口数	16,872,685,759口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,510円

- (注1) 期首元本額 12,733,396,683円
 期中追加設定元本額 7,921,986,718円
 期中一部解約元本額 3,782,697,642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Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド (適格機関投資家限定) 1,589,972,269円
 DCニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド 1,581,536,665円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイＪリートインデックスファンド 8,419,133,428円
 ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド2013-02 (適格機関投資家限定) 1,858,829,013円
 DCニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドA 2,561,151,816円
 DCニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドB 803,438,830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) 37,334,238円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 3,061,187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) 909,984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) 2,578,683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) 14,739,646円

損益の状況

当期 (2019年5月14日～2019年11月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	458,831,258円
受取配当金	458,993,135
受取利息	5,835
その他の収益	11
支払利息	△ 167,723
(B) 有価証券売買損益	2,695,037,429
売却益	2,728,119,915
売却損	△ 33,082,486
(C) 信託報酬等	△ 12,245
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,153,856,442
(E) 前期繰越損益金	7,906,726,433
(F) 追加信託差損益金	6,453,784,418
(G) 解約差損益金	△ 3,156,106,741
(H) 合計(D+E+F+G)	14,358,260,552
次期繰越損益金(H)	14,358,260,552

- (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。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

運用報告書

第 2 期

(計算期間：2018年11月21日～2019年11月20日)

運用方針

主に各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

主要運用 対象

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・ 株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



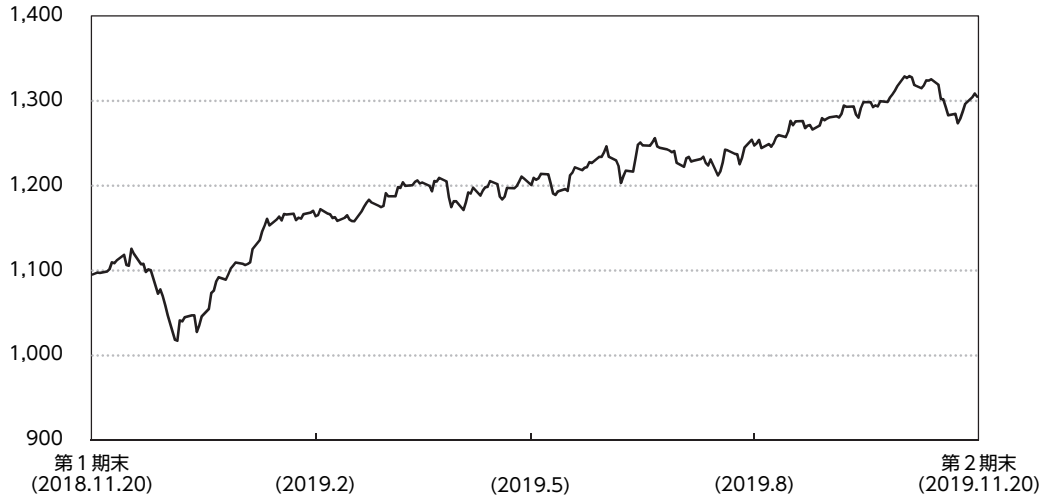
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過 2018年11月21日～2019年11月20日

先進国リート市況

【S & P 先進国 R E I T インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】



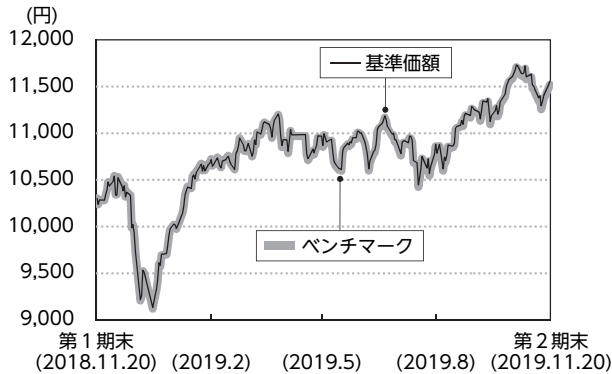
(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の先進国 R E I T 市場は米中通商協議の進展期待から上昇して始まりました。

12月に入ると米国における経済指標の後退や政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理が悪化したため2019年1月初めにかけて下落しましたが、その後、4月中旬にかけては米長期金利が低下基調であったことや米企業の1－3月期業績が良好であったことを好感して上昇しました。

期末にかけては米中貿易摩擦の動向により下落する場面もありましたが、欧州中央銀行（E C B）による景気刺激策への期待感や良好な米主要株価指標を受けて株式市場が上昇したことから先進国 R E I T 市場もつられて堅調推移となり、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>

- ・ 2019年1月から当期末にかけて米長期金利が低下傾向で推移したことや米中貿易摩擦に対する懸念の後退、またECBによる景気刺激策への期待感や米株式市場の上昇につられて先進国REIT市場が上昇基調となったこと

<下落要因>

- ・ 期初から2019年1月初めにかけて米国において景気指標が後退したことや政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理の悪化を受けて先進国REIT市場が軟調に推移したこと

ポートフォリオ

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート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+12.2%となり、ベンチマーク騰落率（+11.8%）におおむね連動しました。

今後の運用方針

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート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。

設定以来の運用実績

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	投資信託証券組入比率	純資産総額
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2017年9月28日	10,000	—	10,000	—	—	—	2,000
1期(2018年11月20日)	10,304	3.0	10,249	2.5	—	98.3	2,017
2期(2019年11月20日)	11,556	12.2	11,458	11.8	—	97.7	2,470

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 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3) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%
(期首)2018年11月20日	10,304	—	10,249	—	—	98.3
11月末	10,433	1.3	10,382	1.3	—	98.2
12月末	9,513	△ 7.7	9,454	△ 7.8	—	98.2
2019年 1 月末	10,385	0.8	10,334	0.8	—	98.5
2 月末	10,627	3.1	10,577	3.2	—	98.3
3 月末	11,013	6.9	10,948	6.8	—	97.8
4 月末	10,983	6.6	10,912	6.5	—	97.7
5 月末	10,674	3.6	10,601	3.4	—	98.3
6 月末	10,701	3.9	10,623	3.7	—	98.1
7 月末	10,965	6.4	10,886	6.2	—	98.3
8 月末	10,875	5.5	10,800	5.4	—	98.3
9 月末	11,333	10.0	11,245	9.7	—	97.9
10月末	11,719	13.7	11,630	13.5	0.0	97.4
(期末)2019年11月20日	11,556	12.2	11,458	11.8	—	97.7

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年11月21日～2019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) (投資信託証券)	4円 (0) (4)	0.035% (0.000) (0.035)	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) (投資信託証券)	1 (0) (1)	0.010 (0.000) (0.010)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 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)	8 (7)	0.074 (0.064)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(1)	(0.010)	・ 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	13	0.119	

(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（10,798円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年11月21日～2019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	千米ドル	百株	千米ドル
		—	—	0.07	0.151
		(0.07)	(0.198)		

(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。以下同じです。

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.269	35	0.235	30
AGREE REALTY CORP	0.210	13	—	—
ALEXANDER'S INC	0.026	10	0.067	23
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.209	29	—	—
PROLOGIS INC	1	79	0.445	37
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	0.202	10	0.130	6
		(3)		
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	1	3
		(△0.114)		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.190	38	0.051	10
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.257	25	0.008	0.880
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17	23	19	25
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.266	13	—	—
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	0.396	11	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	0.579	20	0.080	3
	(△ 4)			
DUKE REALTY CORP	0.455	13	—	—
EASTGROUP PROPERTIES	0.212	24	0.014	1
EPR PROPERTIES	0.130	10	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	0.583	44	0.564	48
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.128	38	0.062	20
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.159	20	0.118	15
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	0.528	18	—	—
GETTY REALTY CORP	—	—	0.054	1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	—	—	0.206	4
HCP INC	0.913	27	—	—
WELLTOWER INC	0.992	78	0.118	10
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.328	10	0.034	1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.515	22	—	—
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	0.717	18	0.371	9
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	—	0.204	3
EQUITY COMMONWEALTH	1	46	1	36
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	—	—	—	0.019
	(△ 1)			
KILROY REALTY CORP	0.135	10	0.136	10
KIMCO REALTY CORP	0.567	10	—	—

外国

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
LEXINGTON REALTY TRUST	2	22	1	11
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.723	36	0.187	11
MACK-CALI REALTY CORP	—	—	0.400	8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.299	36	0.198	25
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.273	10	—	0.003
	(0.116)	(△0.988)		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	—	—	0.219	6
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	—	0.509	2
PUBLIC STORAGE	0.368	85	0.276	62
REGENCY CENTERS CORP	0.154	10	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.284	47	0.101	15
SL GREEN REALTY CORP	0.119	10	0.223	20
LIFE STORAGE INC	—	—	0.006	0.628
SUN COMMUNITIES INC	0.281	37	0.109	16
UDR INC	0.463	21	—	—
VENTAS INC	0.695	44	0.079	5
VORNADO REALTY TRUST	—	—	0.206	12
WP CAREY INC	1	86	0.075	6
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	0.387	10	0.084	2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	—	—	—	—
	(△ 1)			
REALTY INCOME CORP	0.763	53	0.018	1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.172	20	0.013	1
	(1)			
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.095	10	0.017	1
CUBESMART	1	42	0.878	28
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.179	20	0.107	13
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	0.220	10	0.033	1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3	58	0.711	13
URSTADT BIDDLE - CL A	—	—	0.040	0.944
DOUGLAS EMMETT INC	0.504	20	0.173	7
IRON MOUNTAIN INC	—	—	0.112	3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	0.291	10	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	—	—	0.199	5
	(1)			
CHESAPEAKE LODGING TRUST	—	—	—	—
	(△0.934)			
TERRENO REALTY CORP	0.222	10	—	—

外国

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
CORESITE REALTY CORP	0.170	16	0.065	7
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.533	24	0.418	19
CHATHAM LODGING TRUST	—	—	0.258	4
STAG INDUSTRIAL INC	0.675	19	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	—	—	0.017	0.199
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	—	—	—	0.007
	(△ 1)			
EQUINIX INC	1	810	—	—
VEREIT	5	47	0.601	5
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	0.368	10	0.142	4
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.511	10	1	19
SELECT INCOME REIT	—	—	—	—
	(△ 1)			
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	—	—	0.045	3
CORECIVIC INC	—	—	0.376	6
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	0.427	10	0.102	2
CYRUSONE INC	0.178	10	0.008	0.620
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.592	10	0.207	3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	41	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.243	10	0.009	0.432
	(△ 5)			
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	—	0.524	19
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	—	—	0.214	2
		(△0.084)		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.582	10	—	—
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.240	10	0.063	3
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	—	0.930	3
CARETRUST REIT INC	0.809	19	—	—
STORE CAPITAL CORP	0.730	24	0.104	3
URBAN EDGE PROPERTIES	1	22	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	0.967	19	0.606	12
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.338	10	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	—	—	0.407	6
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	—	0.191	2
GLOBAL NET LEASE INC	—	—	0.426	8
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	—	—	1	21
FOREST CITY REALTY TRUST- A	—	—	4	104
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	—	—	0.022	0.959

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
FARMLAND PARTNERS INC	—	—	0.696	4
MANULIFE US REAL ESTATE INV	—	—	10	9
		(△0.669)		
TIER REIT INC	—	—	—	—
	(△0.743)			
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	—	—	—
	(△0.494)			
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	0.611	19	0.100	2
	(0.586)	(△ 10)		
COLONY CAPITAL INC	—	—	0.883	5
INVITATION HOMES INC	4	131	1	32
JBG SMITH PROPERTIES	0.243	10	—	—
CLIPPER REALTY INC	—	—	0.562	6
GLADSTONE LAND CORP	—	—	0.168	2
GLOBAL MEDICAL REIT INC	—	—	1	13
INFRAREIT INC	—	—	0.605	12
VICI PROPERTIES INC	6	129	—	—
AMERICOLD REALTY TRUST	2	74	—	—
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	—	—	—	0.010
	(0.502)			
SPIRIT MTA REIT	—	—	1	9
RETAIL VALUE INC	—	—	0.243	9
	(0.014)	(0.445)		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	1	34	0.412	8
BRT APARTMENTS CORP	1	22	1	19
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.260	20	0.116	11
SAFEHOLD INC	0.743	21	0.587	20
AMERICAN FINANCE TRUST INC	1	17	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	1	17	—	—
ARA US HOSPITALITY TRUST	25	21	—	—
COREPOINT LODGING INC	2	22	1	11
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.400	12	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	—	0.500	24
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	—	—	0.200	2
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	—	—	0.200	4
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.500	13	1	25
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	—	—	0.200	3

ニッセイ先進国リート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
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2	24	1	16
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	28	0.900	13
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	28	—	—
SLATE RETAIL REIT	—	—	0.300	3
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	—	—	0.200	2
SLATE OFFICE REIT	—	—	0.400	2
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1	13	—	—
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	0.700	13	0.200	4
(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	2	29	0.431	5
GPT GROUP	4	29	0.372	2
GOODMAN GROUP	1	20	0.380	5
STOCKLAND	3	14	1	5
MIRVAC GROUP	6	20	—	—
INVESTA OFFICE FUND	—	—	7	43
CHARTER HALL RETAIL REIT	—	—	0.408	1
CHARTER HALL GROUP	2	27	0.960	10
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	—	—	0.329	1
GDI PROPERTY GROUP	—	—	1	2
APN INDUSTRIA REIT	—	—	1	4
NATIONAL STORAGE REIT	9	17	4	7
SCENTRE GROUP	3	15	1	6
ARENA REIT	—	—	0.755	2
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	—	—	2	7
CHARTER HALL LONG WALE REIT	5	33	—	—
PROPERTYLINK GROUP	—	—	7	9
CENTURIA METROPOLITAN REIT	10	32	5	16
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	3	274	2	217
PROSPERITY REIT	—	—	18	52
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26	130	26	134
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	31	163	—	—
FORTUNE REIT	15	157	18	177
(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	—	—	—	—
		(△0.785)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7	13	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	5	13	1	3

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
KEPPEL REIT	—	— (△0.090)	—	—
SUNTEC REIT	19	36 (△0.449)	8	15
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	12	16 (△0.870)	—	—
STARHILL GLOBAL REIT	—	— (△0.010)	2	1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	—	— (△0.466)	3	5
FRASERS COMMERCIAL TRUST	14	23 (△0.061)	6	10
FRASERS CENTREPOINT TRUST	5	14	—	—
ESR REIT	—	— (△0.068)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	— (△0.161)	1	2
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	—	— (△0.522)	—	—
AIMS APAC REIT	—	— (△0.015)	8	12
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	—	— (△0.323)	—	—
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	—	— (△0.247)	—	—
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	6	17 (△0.127)	7	22
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	6	13 (△0.028)	0.900	2
CACHE LOGISTICS TRUST	—	— (△0.018)	11	8
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	10	18	14	25
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	—	— (△0.139)	1	1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	—	—	5	3
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	—	— (△0.015)	12	5
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	—	— (△0.626)	—	—

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	—	—	9	5
		(△0.006)		
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	57	30	23	12
	(23)	(△0.705)		
FRASERS HOSPITALITY TRUST	21	15	21	15
SPH REIT	—	—	9	10
OUE HOSPITALITY TRUST	—	—	—	—
	(△ 17)			
KEPPEL DC REIT	24	46	—	—
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	25	26	4	5
		(△0.702)		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	38	30	23	19
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	—	—	5	—
	(5)			
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル		千ニュージーランド・ドル
KIWI PROPERTY GROUP LTD	20	32	27	41
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	—	—	7	12
GOODMAN PROPERTY TRUST	—	—	4	10
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	—	—	3	8
ARGOSY PROPERTY LTD	—	—	5	7
STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	5	12
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	1	8	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.858	7	—	—
SEGRO PLC	4	35	0.958	7
WORKSPACE GROUP PLC	1	15	0.438	4
INTU PROPERTIES PLC	10	10	13	14
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1	11	0.072	0.517
SHAFTESBURY PLC	1	10	1	14
DERWENT LONDON PLC	0.235	7	—	—
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	—	—	1	0.592
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4	8	—	—
HANSTEEN HOLDINGS PLC	—	—	4	4
RDI REIT PLC	—	—	—	—
	(△ 15)			
TRITAX BIG BOX REIT PLC	10	15	5	7
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	—	5	5
REGIONAL REIT LTD	—	—	4	4
UNITE GROUP PLC	0.813	7	—	—
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	9	10	6	5

外国

ニッセイ先進国リート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
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	20	19	9	8
PICTON PROPERTY INCOME LTD	10	8	7	6
AEW UK REIT PLC	20	18	16	15
(イスラエル)		千イスラエル・シェケル		千イスラエル・シェケル
REIT 1 LTD	2	37	0.673	14
(ユーロ／アイルランド)		千ユーロ		千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC-W/I	11	15	4	7
GREEN REIT PLC	—	—	10	20
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	—	—	5	8
(ユーロ／オランダ)				
NSI NV	—	—	0.158	6
(ユーロ／ベルギー)				
COFINIMMO	0.327	38	—	—
RETAIL ESTATES	—	—	0.098	8
BEFIMMO S.C.A.	0.225	11	0.088	4
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	—	—	0.245	6
AEDIFICA	0.284	24	0.208	17
MONTEA	0.182	11	0.047	3
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	—	—	0.245	0.110
MONTEA-RTS	—	—	0.182	—
	(0.182)			
AEDIFICA SA-RTS	—	—	—	—
		(△0.221)		
(ユーロ／フランス)				
KLEPIERRE	0.291	9	—	—
GECINA SA	0.193	25	0.009	1
COVIVIO	—	—	0.305	29
	(0.130)	(11)		
MERCIALYS	—	—	0.357	4
ICADE	0.238	18	0.342	28
ALTAREA	—	—	0.057	10
		(△0.657)		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.248	35	0.069	9
(ユーロ／ドイツ)				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	—	—	—	—
		(△ 1)		
HAMBORNER REIT AG	—	—	1	11
(ユーロ／スペイン)				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	—	—	0.221	1
		(△0.101)		

外国

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	(ユーロ／スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	0.739	8 (△0.504)	0.093	1
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	—	— (△0.615)	2	21
	(ユーロ／イタリア)				
	BENI STABILI SPA	— (△ 15)	—	—	—
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	—	— (△0.015)	—	—
	COVIVIO	—	— (△ 11)	—	0.056

(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。

主要な売買銘柄

2018年11月21日～2019年11月20日

株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
—	—	—	—	ASHFORD INC	0.007	16	2,346

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

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

組入有価証券明細表

2019年11月20日現在

外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	2	2	350	38,024
ACADIA REALTY TRUST	1	1	35	3,878
AGREE REALTY CORP	0.445	0.655	49	5,346
ALEXANDER'S INC	0.059	0.018	5	635
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	1	308	33,486
PROLOGIS INC	10	10	989	107,439
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	2	137	14,915
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3	2	5	628
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	2	506	55,047
BRANDYWINE REALTY TRUST	2	2	41	4,514
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	1	185	20,151
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6	4	6	750
CEDAR REALTY TRUST INC	1	1	3	364
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	2	159	17,295
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	1	56	6,178
COUSINS PROPERTIES INC	6	2	108	11,790
SITE CENTERS CORP	2	2	35	3,818
DUKE REALTY CORP	5	6	222	24,139
EASTGROUP PROPERTIES	0.533	0.731	97	10,607
EPR PROPERTIES	1	1	94	10,219
EQUITY RESIDENTIAL	5	5	514	55,888
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	352	38,247
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	159	17,275
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1	2	100	10,961
GETTY REALTY CORP	0.508	0.454	15	1,643
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.430	0.224	5	550
HCP INC	7	8	295	32,087
WELLTOWER INC	6	6	586	63,673
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1	2	72	7,849
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.611	0.611	8	943
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	2	101	11,012
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2	2	68	7,393
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	12	214	23,298
EQUITY COMMONWEALTH	1	1	45	4,964

ニッセイ先進国リート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
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1	0.187	13	1,517
KILROY REALTY CORP	1	1	133	14,523
KIMCO REALTY CORP	6	7	160	17,425
LEXINGTON REALTY TRUST	3	4	49	5,361
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	2	173	18,801
LTC PROPERTIES INC	0.615	0.615	29	3,171
MACERICH CO/THE	1	1	46	4,997
MACK-CALI REALTY CORP	1	1	33	3,615
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	1	256	27,904
MONMOUTH REIT -CL A	1	1	17	1,862
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.637	0.637	51	5,574
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3	3	149	16,258
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.246	0.027	0.732	79
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	1	9	1,012
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.309	0.309	54	5,931
PUBLIC STORAGE	2	2	522	56,758
RPT REALTY	1	1	18	1,959
REGENCY CENTERS CORP	2	2	185	20,098
SAUL CENTERS INC	0.186	0.186	9	1,060
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	3	27	2,953
SIMON PROPERTY GROUP INC	4	5	777	84,403
SL GREEN REALTY CORP	1	1	121	13,188
LIFE STORAGE INC	0.723	0.717	78	8,573
SUN COMMUNITIES INC	1	1	243	26,433
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	1	23	2,527
TAUBMAN CENTERS INC	0.943	0.943	31	3,456
UDR INC	4	4	236	25,710
UMH PROPERTIES INC	0.479	0.479	7	775
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.194	0.194	23	2,505
VENTAS INC	5	6	370	40,245
VORNADO REALTY TRUST	2	2	176	19,217
WP CAREY INC	1	2	234	25,468
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1	1	37	4,020
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1	2	68	7,441
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1	—	—	—
REALTY INCOME CORP	4	5	414	45,048
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	2	210	22,822

ニッセイ先進国リート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
KITE REALTY GROUP TRUST	1	1	30	3,362
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	2	228	24,811
CUBESMART	2	3	96	10,490
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	432	46,968
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2	2	109	11,881
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3	3	31	3,412
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	8	166	18,135
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3	3	48	5,287
URSTADT BIDDLE - CL A	0.462	0.422	10	1,116
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	1	14	1,572
DOUGLAS EMMETT INC	2	2	124	13,570
IRON MOUNTAIN INC	4	4	164	17,840
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	2	49	5,336
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	2	96	10,471
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	2	63	6,917
CHESAPEAKE LODGING TRUST	0.934	—	—	—
TERRENO REALTY CORP	0.813	1	58	6,373
CORESITE REALTY CORP	0.567	0.672	77	8,426
RLJ LODGING TRUST	3	3	52	5,648
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.644	0.759	35	3,876
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1	1	31	3,378
CHATHAM LODGING TRUST	0.958	0.700	12	1,370
STAG INDUSTRIAL INC	1	2	65	7,163
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1	1	18	2,054
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1	0.707	22	2,470
EQUINIX INC	—	1	807	87,745
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3	3	50	5,481
VEREIT	15	19	190	20,665
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3	3	101	11,077
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	3	73	8,021
SELECT INCOME REIT	1	—	—	—
WHITESTONE REIT	0.599	0.599	8	911
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.942	0.897	79	8,630
CORECIVIC INC	2	2	32	3,563
GEO GROUP INC/THE	2	2	30	3,321
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3	4	111	12,135
CYRUSONE INC	1	1	129	14,034

ニッセイ先進国リート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
PHYSICIANS REALTY TRUST	2	3	58	6,397
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	2	111	12,122
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7	1	84	9,216
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1	1	28	3,047
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	2	127	13,900
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	0.866	8	908
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	5	125	13,643
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.870	1	54	5,889
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	1	38	4,172
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	4	18	1,974
CARETRUST REIT INC	1	1	40	4,426
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1	1	18	2,032
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	0.508	0.508	6	751
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	1	10	1,101
STORE CAPITAL CORP	2	3	139	15,181
PARAMOUNT GROUP INC	3	3	42	4,664
URBAN EDGE PROPERTIES	1	2	58	6,324
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.677	0.677	15	1,688
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1	2	42	4,611
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.688	1	33	3,624
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.298	0.298	14	1,546
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	2	45	4,986
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.376	0.185	2	234
CITY OFFICE REIT INC	0.423	0.423	5	616
GLOBAL NET LEASE INC	1	1	28	3,146
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.951	0.951	26	2,888
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.390	0.390	16	1,797
FOREST CITY REALTY TRUST- A	4	—	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.266	0.244	11	1,238
FARMLAND PARTNERS INC	1	0.604	3	415
MANULIFE US REAL ESTATE INV	14	4	4	495
TIER REIT INC	0.743	—	—	—
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	0.494	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	3	4	98	10,751
COLONY CAPITAL INC	9	8	41	4,457
INVITATION HOMES INC	4	8	244	26,571

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末	
			評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千ドル
JBG SMITH PROPERTIES		1	1	71
CLIPPER REALTY INC		0.655	0.093	0.867
GLADSTONE LAND CORP		0.168	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC		1	0.215	2
INFRAREIT INC		0.605	—	—
VICI PROPERTIES INC		1	7	187
AMERICOLD REALTY TRUST		0.888	3	124
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		0.305	0.807	17
SPIRIT MTA REIT		1	—	—
RETAIL VALUE INC		0.555	0.326	12
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		—	1	25
BRT APARTMENTS CORP		—	0.345	5
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		0.491	0.491	5
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		0.080	0.224	18
SAFEHOLD INC		—	0.156	5
AMERICAN FINANCE TRUST INC		—	1	18
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		—	1	34
ARA US HOSPITALITY TRUST		—	25	21
COREPOINT LODGING INC		—	1	10
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	372 156	404 154	16,768 —
(カナダ)				千カナダ・ドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		0.300	0.300	14
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		1	1	44
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1	1	59
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		1	1	17
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM		0.500	0.500	14
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		2	2	43
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE		0.300	0.300	8
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		2	1	50
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		0.700	0.700	38
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		1	1	12
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		0.600	0.400	6
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		0.600	1	17
Dream Global Real Estate Investm		1	1	21

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
			□数	評価額	
		□数		外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		0.600	0.600	9	794
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		0.300	0.300	20	1,676
CHOICE PROPERTIES REIT		1	1	23	1,942
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		0.200	0.200	3	307
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		0.400	1	21	1,751
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		0.400	2	36	2,954
SLATE RETAIL REIT		0.300	—	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		0.500	0.500	9	801
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA		0.200	—	—	—
SLATE OFFICE REIT		0.400	—	—	—
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		0.400	1	17	1,459
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		—	0.500	11	930
小計	□数・金額	19	22	504	41,285
	銘柄数<比率>	24	22	—	<1.7%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		16	18	226	16,803
GPT GROUP		29	34	209	15,537
GOODMAN GROUP		26	27	410	30,436
STOCKLAND		39	42	210	15,630
BWP TRUST		7	7	31	2,360
MIRVAC GROUP		62	68	225	16,717
INVESTA OFFICE FUND		7	—	—	—
CHARTER HALL RETAIL REIT		5	4	21	1,568
ABACUS PROPERTY GROUP		5	5	19	1,417
VICINITY CENTRES		53	53	143	10,620
CHARTER HALL GROUP		7	9	99	7,370
CROMWELL PROPERTY GROUP		24	24	31	2,299
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		11	11	30	2,284
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		3	3	15	1,149
INGENIA COMMUNITIES GROUP		3	3	14	1,050
GDI PROPERTY GROUP		7	5	9	669
APN INDUSTRIA REIT		1	—	—	—
NATIONAL STORAGE REIT		7	13	26	1,972
SCENTRE GROUP		88	90	362	26,909
ARENA REIT		4	3	9	713
CHARTER HALL EDUCATION TRUST		3	3	11	870
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		2	—	—	—

ニッセイ先進国リート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
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
VIVA ENERGY REIT		6	6	18	1,341
CHARTER HALL LONG WALE REIT		2	8	44	3,312
PROPERTYLINK GROUP		7	—	—	—
RURAL FUNDS GROUP		3	3	7	543
CENTURIA METROPOLITAN REIT		—	5	17	1,293
小計	□数・金額	440	455	2,196	162,874
	銘柄数<比率>	26	23	—	<6.6%>
(香港)				千香港ドル	
CHAMPION REIT		31	31	156	2,168
LINK REIT		35	36	2,937	40,773
PROSPERITY REIT		18	—	—	—
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		—	31	160	2,228
FORTUNE REIT		21	18	163	2,266
小計	□数・金額	105	116	3,417	47,437
	銘柄数<比率>	4	4	—	<1.9%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		37	37	108	8,697
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		40	47	95	7,602
CAPITALAND MALL TRUST		41	46	117	9,364
KEPPEL REIT		27	27	33	2,667
SUNTEC REIT		34	45	83	6,629
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		31	44	73	5,828
STARHILL GLOBAL REIT		2	—	—	—
ASCOTT RESIDENCE TRUST		19	15	20	1,666
FRASERS COMMERCIAL TRUST		0.100	8	13	1,066
FRASERS CENTREPOINT TRUST		—	5	15	1,228
ESR REIT		17	17	9	727
CDL HOSPITALITY TRUSTS		11	10	16	1,281
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		8	8	12	1,032
AIMS APAC REIT		8	—	—	—
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		8	8	8	716
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		29	29	7	570
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		1	0.300	0.975	77
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		11	17	42	3,425
CACHE LOGISTICS TRUST		16	5	3	283
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		29	25	58	4,646
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		11	10	11	877

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
			□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		13	8	5	459
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		12	—	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		35	35	40	3,211
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		9	—	—	—
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		—	57	31	2,483
SPH REIT		9	—	—	—
OUE HOSPITALITY TRUST		17	—	—	—
KEPPEL DC REIT		1	26	52	4,155
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		5	25	32	2,562
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		—	14	12	990
小計	□数・金額	494	575	905	72,255
	銘柄数<比率>	28	25	—	<2.9%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		22	14	22	1,546
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		15	8	14	978
GOODMAN PROPERTY TRUST		15	10	22	1,598
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		5	1	4	324
ARGOSY PROPERTY LTD		12	7	10	738
STRIDE PROPERTY GROUP		5	—	—	—
小計	□数・金額	76	42	74	5,186
	銘柄数<比率>	6	5	—	<0.2%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		16	17	99	14,027
HAMMERSON PLC		12	12	37	5,330
LAND SECURITIES GROUP PLC		12	13	120	16,970
SEGRO PLC		16	20	174	24,529
WORKSPACE GROUP PLC		1	2	32	4,506
INTU PROPERTIES PLC		22	19	7	1,049
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		9	9	13	1,856
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		4	5	46	6,565
SHAFTESBURY PLC		3	3	32	4,565
BIG YELLOW GROUP PLC		2	2	26	3,710
DERWENT LONDON PLC		1	1	71	10,062
INVISTA FOUNDATION PROPERTY		8	6	3	544
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		10	14	35	4,986
HANSTEEN HOLDINGS PLC		12	8	8	1,165
RDI REIT PLC		19	3	5	749

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
			□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
TRITAX BIG BOX REIT PLC		21	26	41	5,781
SAFESTORE HOLDINGS PLC		3	3	24	3,373
ASSURA PLC		37	37	26	3,780
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		8	2	2	395
REGIONAL REIT LTD		4	—	—	—
CAPITAL & REGIONAL PLC		8	8	2	298
NEWRIVER REIT PLC		4	4	9	1,289
UNITE GROUP PLC		4	4	58	8,161
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		3	6	5	791
LXI REIT PLC		2	2	2	380
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		3	3	2	386
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		—	10	8	1,257
PICTON PROPERTY INCOME LTD		—	2	2	363
AEW UK REIT PLC		—	3	3	448
小計	□数・金額	255	259	907	127,328
	銘柄数<比率>	26	28	—	<5.2%>
(イスラエル)				千イスラエル・シェケル	
REIT 1 LTD		—	1	34	1,082
小計	□数・金額	—	1	34	1,082
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>
(ユーロ／アイルランド)				千ユーロ	
HIBERNIA REIT PLC-W/I		—	6	9	1,132
GREEN REIT PLC		10	—	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		5	0.257	0.459	55
小計	□数・金額	16	7	9	1,187
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
(ユーロ／オランダ)					
WERELDHAVE NV		0.626	0.626	13	1,632
EUROCOMMERCIAL-CVA		0.759	0.759	20	2,463
VASTNED RETAIL NV		0.245	0.245	7	857
NSI NV		0.282	0.124	5	604
小計	□数・金額	1	1	46	5,558
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.2%>
(ユーロ／ベルギー)					
COFINIMMO		—	0.327	43	5,256
RETAIL ESTATES		0.098	—	—	—
BEFIMMO S.C.A.		—	0.137	8	975
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES		0.245	—	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA		0.251	0.251	42	5,061

ニッセイ先進国リート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
(ユーロ／ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		0.279	0.355	41	4,954
MONTEA		—	0.135	11	1,353
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS		0.245	—	—	—
小計	□数・金額	1	1	146	17,601
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.7%>
(ユーロ／フランス)					
KLEPIERRE		3	3	121	14,654
GECINA SA		0.784	0.968	150	18,134
COVIVIO		0.826	0.651	66	8,036
MERCIALYS		0.857	0.500	6	745
ICADE		0.700	0.596	53	6,396
ALTAREA		0.057	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		2	2	342	41,199
小計	□数・金額	8	8	741	89,166
	銘柄数<比率>	7	6	—	<3.6%>
(ユーロ／ドイツ)					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1	1	32	3,906
HAMBORNER REIT AG		1	—	—	—
小計	□数・金額	3	1	32	3,906
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.2%>
(ユーロ／スペイン)					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		1	1	9	1,153
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		5	5	78	9,400
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		6	4	54	6,507
小計	□数・金額	13	11	141	17,061
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.7%>
(ユーロ／イタリア)					
BENI STABILI SPA		15	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		1	1	6	822
小計	□数・金額	16	1	6	822
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	61	33	1,124	135,304
	銘柄数<比率>	25	22	—	<5.5%>
合計	□数・金額	1,824	1,911	—	2,413,971
	銘柄数<比率>	295	284	—	<97.7%>

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

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

(注3) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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。

投資信託財産の構成

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	2,413,971	95.5
コール・ローン等、その他	113,831	4.5
投資信託財産総額	2,527,803	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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シェケル31.35円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産（2,428,992千円）の投資信託財産総額（2,527,803千円）に対する比率は96.1%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,527,803,057円
コール・ローン等	109,238,996
投資信託証券(評価額)	2,413,971,912
未収入金	104,316
未収配当金	4,487,833
(B)負債	56,919,556
未払解約金	56,919,231
その他未払費用	325
(C)純資産総額(A-B)	2,470,883,501
元本	2,138,126,735
次期繰越損益金	332,756,766
(D)受益権総口数	2,138,126,735口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,556円

(注1) 期首元本額 1,958,293,015円
期中追加設定元本額 322,424,011円
期中一部解約元本額 142,590,291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。
ニッセイ先進国リートインデックスファンド
(適格機関投資家限定) 1,859,238,576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) 64,798,652円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)
5,538,910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)
1,584,230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) 25,749,136円
DCニッセイ先進国リートインデックス 181,217,231円

損益の状況

当期(2018年11月21日~2019年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	85,194,427円
受取配当金	84,772,482
受取利息	278,115
その他収益金	167,077
支払利息	△ 23,247
(B)有価証券売買損益	174,378,381
売却益	332,384,426
売却損	△ 158,006,045
(C)信託報酬等	△ 1,576,335
(D)当期損益金(A+B+C)	257,996,473
(E)前期繰越損益金	59,621,713
(F)追加信託差損益金	31,006,755
(G)解約差損益金	△ 15,868,175
(H)合計(D+E+F+G)	332,756,766
次期繰越損益金(H)	332,756,766

(注1) (B)有価証券売却損益は、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。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 3 期

(計算期間：2018年3月13日～2019年3月11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として運用を行います。
- 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します。



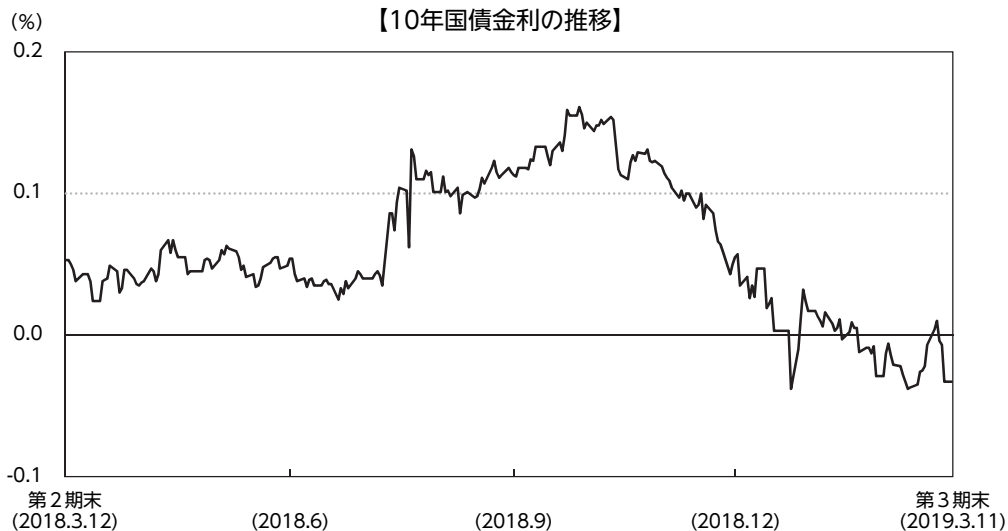
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年3月13日～2019年3月11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。

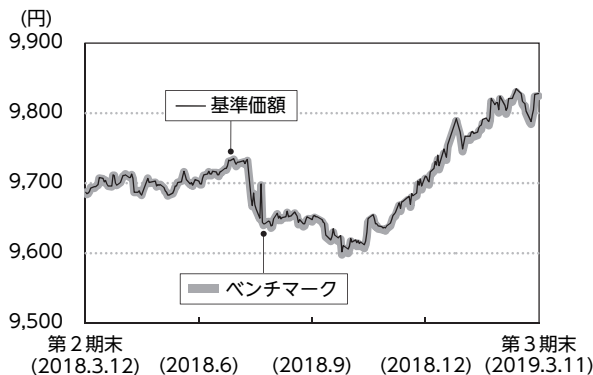
当期の10年国債金利は低下しました。

期初以降、米金利の先高感などから上昇する場面もありましたが、米保護主義政策や米中貿易摩擦の強まりに対する懸念などもあり、国内金利は上下する展開となりました。

7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利は上昇し、それ以降も円安・株高の進行等を受けて上昇基調となりました。

しかし10月には、日米の株価が大きく下落したことなどから金利は低下し、その後も世界景気の減速懸念を背景に低下しました。年明け以降は、世界的な株価の反発から金利が上昇する場面もありましたが、米金利の先高感が弱まったことなどから国内金利も低下基調となり、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、米金利の先高感や米保護主義政策に対する懸念などを背景とした国内金利の変動を受けて上下しました。7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利が上昇（債券価格は下落）したため基準価額は下落し、その後は下落基調となりました。

しかし10月には、日米の株価が大きく下落したことなどから金利が低下したことを受けて、基準価額は上昇しました。その後も世界景気の減速懸念を背景に金利が低下基調となったことから基準価額は上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオ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て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+1.5%となり、ほぼベンチマーク騰落率（+1.4%）に連動しました。

今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

設定以来の運用実績

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
(設定日)	円	%		%	%	百万円
2016年7月11日	10,000	—	10,000	—	—	181,409
1期(2017年3月10日)	9,581	△4.2	9,585	△4.2	99.0	157,558
2期(2018年3月12日)	9,687	1.1	9,688	1.1	99.1	126,324
3期(2019年3月11日)	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2	91,526

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、設定時を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注3) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
	円	%		%	%
(期首)2018年3月12日	9,687	—	9,688	—	99.1
3月末	9,696	0.1	9,697	0.1	99.2
4月末	9,688	0.0	9,690	0.0	99.2
5月末	9,711	0.2	9,712	0.2	99.1
6月末	9,717	0.3	9,716	0.3	96.6
7月末	9,699	0.1	9,698	0.1	99.1
8月末	9,648	△0.4	9,645	△0.4	90.3
9月末	9,626	△0.6	9,622	△0.7	99.2
10月末	9,642	△0.5	9,639	△0.5	99.2
11月末	9,682	△0.1	9,680	△0.1	99.1
12月末	9,755	0.7	9,753	0.7	99.2
2019年1月末	9,794	1.1	9,790	1.1	99.2
2月末	9,814	1.3	9,811	1.3	99.1
(期末)2019年3月11日	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2018年3月13日～2019年3月11日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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（9,701円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年3月13日～2019年3月11日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	16,348,423	41,472,649
	地方債証券	248,246	3,756,361
	特殊債券	414,481	3,878,269
			(196,639)
社債券		825,628	3,173,021

(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) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

主要な売買銘柄

2018年3月13日～2019年3月11日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
千円		千円	
第350回 利付国債 (10年)	920,986	第122回 利付国債 (5年)	845,215
第386回 利付国債 (2年)	722,049	第123回 利付国債 (5年)	796,295
第385回 利付国債 (2年)	721,923	第345回 利付国債 (10年)	757,880
第387回 利付国債 (2年)	689,871	第381回 利付国債 (2年)	752,329
第351回 利付国債 (10年)	665,126	第385回 利付国債 (2年)	721,198
第352回 利付国債 (10年)	627,923	第386回 利付国債 (2年)	721,034
第132回 利付国債 (5年)	506,563	第305回 利付国債 (10年)	704,043
第164回 利付国債 (20年)	413,403	第346回 利付国債 (10年)	652,672
第133回 利付国債 (5年)	407,438	第339回 利付国債 (10年)	616,822
第130回 利付国債 (5年)	403,079	第387回 利付国債 (2年)	585,974

(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

2019年3月11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	58,653,000	65,804,309	71.9	—	58.1	8.2	5.6
地方債証券	8,313,000	8,644,145	9.4	—	2.3	5.8	1.3
	(8,313,000)	(8,644,145)	(9.4)	—	(2.3)	(5.8)	(1.3)
特殊債券	8,875,327	9,221,202	10.1	—	2.9	6.0	1.1
(除く金融債券)	(8,875,327)	(9,221,202)	(10.1)	—	(2.9)	(6.0)	(1.1)
金融債券	600,000	601,393	0.7	—	—	0.3	0.3
	(600,000)	(601,393)	(0.7)	—	—	(0.3)	(0.3)
社債券	6,300,000	6,493,591	7.1	—	1.8	4.6	0.7
	(6,300,000)	(6,493,591)	(7.1)	—	(1.8)	(4.6)	(0.7)
合計	82,741,327	90,764,642	99.2	—	65.2	24.9	9.0
	(24,088,327)	(24,960,333)	(27.3)	—	(7.1)	(16.7)	(3.5)

(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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第387回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/4/15	103,000	103,276
	第388回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/5/15	97,000	97,285
	第389回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/6/1	52,000	52,159
	第390回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/7/1	117,000	117,381
	第391回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/8/1	147,000	147,510
	第392回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/9/1	235,000	235,867
	第393回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/10/1	270,000	271,050
	第394回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/11/1	290,000	291,191
	第395回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/12/1	361,000	362,555
	第396回 利付国債 (2年)	0.1000	2021/1/1	300,000	301,359
	第397回 利付国債 (2年)	0.1000	2021/2/1	300,000	301,422
	第124回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/6/20	299,000	299,953
	第125回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/9/20	284,000	285,084
	第126回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/12/20	429,000	430,909
	第127回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/3/20	627,000	630,178
	第128回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/6/20	634,000	637,613
	第129回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/9/20	625,000	629,037
	第130回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/12/20	629,000	633,465
	第131回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/3/20	297,000	299,343
	第132回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/6/20	666,000	671,694
	第133回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/9/20	402,000	405,774
	第134回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/12/20	307,000	310,088
	第135回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/3/20	356,000	359,816
	第1回 利付国債 (40年)	2.4000	2048/3/20	111,000	165,078
	第2回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	142,000	204,745
	第3回 利付国債 (40年)	2.2000	2050/3/20	141,000	204,823
	第4回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	194,000	283,856
	第5回 利付国債 (40年)	2.0000	2052/3/20	191,000	269,904
	第6回 利付国債 (40年)	1.9000	2053/3/20	199,000	276,785
	第7回 利付国債 (40年)	1.7000	2054/3/20	225,000	300,541
	第8回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	243,000	302,372
	第9回 利付国債 (40年)	0.4000	2056/3/20	224,000	205,752
	第10回 利付国債 (40年)	0.9000	2057/3/20	245,000	265,290
	第11回 利付国債 (40年)	0.8000	2058/3/20	162,000	169,563
	第308回 利付国債 (10年)	1.3000	2020/6/20	61,000	62,128
	第309回 利付国債 (10年)	1.1000	2020/6/20	316,000	321,040
	第310回 利付国債 (10年)	1.0000	2020/9/20	165,000	167,900
	第311回 利付国債 (10年)	0.8000	2020/9/20	123,000	124,787

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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312回 利付国債 (10年)	1.2000	2020/12/20	862,000	882,713
	第313回 利付国債 (10年)	1.3000	2021/ 3 /20	350,000	360,290
	第314回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 3 /20	128,000	131,244
	第315回 利付国債 (10年)	1.2000	2021/ 6 /20	283,000	291,716
	第316回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 6 /20	110,000	113,137
	第317回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 9 /20	80,000	82,545
	第318回 利付国債 (10年)	1.0000	2021/ 9 /20	208,000	214,092
	第319回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/12/20	106,000	109,707
	第320回 利付国債 (10年)	1.0000	2021/12/20	225,000	232,242
	第321回 利付国債 (10年)	1.0000	2022/ 3 /20	231,000	239,098
	第322回 利付国債 (10年)	0.9000	2022/ 3 /20	80,000	82,562
	第323回 利付国債 (10年)	0.9000	2022/ 6 /20	59,000	61,047
	第324回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/ 6 /20	194,000	200,095
	第325回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/ 9 /20	203,000	209,910
	第326回 利付国債 (10年)	0.7000	2022/12/20	2,000	2,065
	第327回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/12/20	49,000	50,786
	第328回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/ 3 /20	39,000	40,199
	第329回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/ 6 /20	9,000	9,371
	第330回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/ 9 /20	3,000	3,131
	第332回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/12/20	366,000	379,384
	第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 3 /20	325,000	337,502
	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 6 /20	328,000	341,257
	第335回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/ 9 /20	289,000	299,632
	第336回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/12/20	53,000	55,038
	第337回 利付国債 (10年)	0.3000	2024/12/20	336,000	345,008
	第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 3 /20	646,000	667,996
	第339回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 6 /20	685,000	709,310
	第340回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 9 /20	875,000	907,313
	第341回 利付国債 (10年)	0.3000	2025/12/20	854,000	880,901
	第342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	878,000	894,207
	第343回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 6 /20	883,000	899,891
	第344回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 9 /20	911,000	928,682
	第345回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/12/20	532,000	542,459
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	647,000	659,597
	第347回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 6 /20	905,000	922,403
	第348回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 9 /20	819,000	834,159
	第349回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/12/20	892,000	907,788
	第350回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 3 /20	915,000	930,381
	第351回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 6 /20	665,000	675,546

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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352回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 9 /20	625,000	634,275
	第353回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/12/20	309,000	313,242
	第 1 回 利付国債 (30年)	2.8000	2029/ 9 /20	13,000	16,804
	第 2 回 利付国債 (30年)	2.4000	2030/ 2 /20	27,000	34,036
	第 3 回 利付国債 (30年)	2.3000	2030/ 5 /20	28,000	35,107
	第 4 回 利付国債 (30年)	2.9000	2030/11/20	79,000	105,235
	第 5 回 利付国債 (30年)	2.2000	2031/ 5 /20	50,000	62,871
	第 6 回 利付国債 (30年)	2.4000	2031/11/20	69,000	89,058
	第 7 回 利付国債 (30年)	2.3000	2032/ 5 /20	66,000	84,845
	第 8 回 利付国債 (30年)	1.8000	2032/11/22	60,000	73,485
	第 9 回 利付国債 (30年)	1.4000	2032/12/20	56,000	65,579
	第10回 利付国債 (30年)	1.1000	2033/ 3 /20	101,000	114,176
	第11回 利付国債 (30年)	1.7000	2033/ 6 /20	77,000	93,612
	第12回 利付国債 (30年)	2.1000	2033/ 9 /20	79,000	100,756
	第13回 利付国債 (30年)	2.0000	2033/12/20	95,000	120,057
	第14回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/ 3 /20	119,000	157,639
	第15回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 6 /20	127,000	170,544
	第16回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 9 /20	108,000	145,404
	第17回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/12/20	91,000	121,523
	第18回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	110,000	145,522
	第19回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 6 /20	98,000	129,923
	第20回 利付国債 (30年)	2.5000	2035/ 9 /20	113,000	153,716
	第21回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/12/20	112,000	149,085
	第22回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 3 /20	134,000	183,226
	第23回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 6 /20	138,000	189,101
	第24回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 9 /20	114,000	156,541
	第25回 利付国債 (30年)	2.3000	2036/12/20	130,000	174,463
	第26回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	234,000	318,834
	第27回 利付国債 (30年)	2.5000	2037/ 9 /20	223,000	309,102
	第28回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/ 3 /20	268,000	373,090
	第29回 利付国債 (30年)	2.4000	2038/ 9 /20	261,000	359,775
	第30回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	281,000	383,522
	第31回 利付国債 (30年)	2.2000	2039/ 9 /20	265,000	357,856
	第32回 利付国債 (30年)	2.3000	2040/ 3 /20	331,000	455,158
	第33回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	367,000	484,337
	第34回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	335,000	457,502
	第35回 利付国債 (30年)	2.0000	2041/ 9 /20	366,000	486,004
	第36回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/ 3 /20	374,000	498,568
	第37回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	386,000	507,767

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	267,000	346,264
	第 39 回 利付国債 (30年)	1.9000	2043/ 6 /20	244,000	322,482
	第 40 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 9 /20	222,000	288,835
	第 41 回 利付国債 (30年)	1.7000	2043/12/20	231,000	295,691
	第 42 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 3 /20	245,000	313,874
	第 43 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 6 /20	241,000	309,010
	第 44 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 9 /20	238,000	305,415
	第 45 回 利付国債 (30年)	1.5000	2044/12/20	267,000	330,222
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/ 3 /20	303,000	374,926
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/ 6 /20	288,000	363,680
	第 48 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/ 9 /20	277,000	336,566
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	276,000	335,447
	第 50 回 利付国債 (30年)	0.8000	2046/ 3 /20	272,000	289,699
	第 51 回 利付国債 (30年)	0.3000	2046/ 6 /20	174,000	163,295
	第 52 回 利付国債 (30年)	0.5000	2046/ 9 /20	184,000	181,799
	第 53 回 利付国債 (30年)	0.6000	2046/12/20	166,000	167,998
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	272,000	289,212
	第 55 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 6 /20	258,000	274,117
	第 56 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 9 /20	263,000	279,211
	第 57 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/12/20	270,000	286,413
	第 58 回 利付国債 (30年)	0.8000	2048/ 3 /20	310,000	328,572
	第 60 回 利付国債 (30年)	0.9000	2048/ 9 /20	218,000	236,778
	第 61 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/12/20	144,000	148,386
	第 46 回 利付国債 (20年)	2.2000	2020/ 6 /22	3,000	3,090
	第 47 回 利付国債 (20年)	2.2000	2020/ 9 /21	152,000	157,472
	第 48 回 利付国債 (20年)	2.5000	2020/12/21	66,000	69,123
	第 49 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/ 3 /22	40,000	41,830
	第 50 回 利付国債 (20年)	1.9000	2021/ 3 /22	54,000	56,250
	第 52 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/ 9 /21	4,000	4,228
	第 53 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/12/20	4,000	4,251
	第 54 回 利付国債 (20年)	2.2000	2021/12/20	1,000	1,065
	第 56 回 利付国債 (20年)	2.0000	2022/ 6 /20	2,000	2,141
	第 70 回 利付国債 (20年)	2.4000	2024/ 6 /20	51,000	57,928
	第 72 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/ 9 /20	64,000	72,043
	第 73 回 利付国債 (20年)	2.0000	2024/12/20	30,000	33,767
	第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 3 /20	8,000	8,999
	第 78 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 6 /20	8,000	9,041
	第 80 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 6 /20	8,000	9,142
	第 81 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 9 /20	106,000	121,059

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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 82 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 9 /20	126,000	144,731
	第 83 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/12/20	104,000	120,017
	第 84 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/12/20	136,000	156,013
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	112,000	129,883
	第 86 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 3 /20	104,000	122,081
	第 87 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 3 /20	101,000	117,843
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	220,000	259,637
	第 89 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 6 /20	104,000	121,973
	第 90 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 9 /20	331,000	390,060
	第 91 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 9 /20	209,000	247,882
	第 92 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/12/20	431,000	506,890
	第 93 回 利付国債 (20年)	2.0000	2027/ 3 /20	230,000	269,711
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	332,000	392,015
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/ 6 /20	305,000	366,680
	第 96 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 6 /20	174,000	206,280
	第 97 回 利付国債 (20年)	2.2000	2027/ 9 /20	236,000	282,919
	第 98 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 9 /20	172,000	204,714
	第 99 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/12/20	387,000	462,167
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	277,000	334,391
	第101回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 3 /20	224,000	274,482
	第102回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 6 /20	181,000	222,626
	第103回 利付国債 (20年)	2.3000	2028/ 6 /20	169,000	206,289
	第104回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 6 /20	135,000	162,268
	第105回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 9 /20	252,000	303,856
	第106回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 9 /20	152,000	184,734
	第107回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/12/20	152,000	183,921
	第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	202,000	240,456
	第109回 利付国債 (20年)	1.9000	2029/ 3 /20	161,000	192,137
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	184,000	223,284
	第111回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/ 6 /20	145,000	178,046
	第112回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 6 /20	203,000	247,176
	第113回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 9 /20	225,000	274,878
	第114回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/12/20	119,000	145,848
	第115回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/12/20	66,000	81,601
	第116回 利付国債 (20年)	2.2000	2030/ 3 /20	79,000	97,939
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	126,000	154,822
	第118回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/ 6 /20	96,000	117,248
	第119回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 6 /20	68,000	81,523
	第120回 利付国債 (20年)	1.6000	2030/ 6 /20	88,000	103,523

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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121回 利付国債 (20年)	1.9000	2030/ 9 /20	237,000	287,575
	第122回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 9 /20	154,000	185,095
	第123回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/12/20	253,000	313,714
	第124回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/12/20	149,000	183,012
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	155,000	194,590
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	141,000	173,648
	第127回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 3 /20	130,000	158,549
	第128回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 6 /20	226,000	276,160
	第129回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 6 /20	131,000	158,482
	第130回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 9 /20	233,000	282,524
	第131回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/ 9 /20	127,000	152,420
	第132回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/12/20	169,000	203,236
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	216,000	262,483
	第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/ 3 /20	182,000	221,628
	第135回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 3 /20	114,000	137,357
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 3 /20	119,000	141,853
	第137回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 6 /20	130,000	156,938
	第138回 利付国債 (20年)	1.5000	2032/ 6 /20	141,000	166,532
	第139回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 6 /20	129,000	154,045
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 9 /20	348,000	420,902
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	251,000	304,121
	第142回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/12/20	153,000	187,451
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	255,000	305,987
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	167,000	198,097
	第145回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 6 /20	383,000	465,632
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	347,000	422,559
	第147回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/12/20	385,000	464,017
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 3 /20	329,000	391,944
	第149回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 6 /20	359,000	428,168
	第150回 利付国債 (20年)	1.4000	2034/ 9 /20	364,000	429,126
	第151回 利付国債 (20年)	1.2000	2034/12/20	321,000	368,960
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	350,000	402,458
	第153回 利付国債 (20年)	1.3000	2035/ 6 /20	345,000	402,273
	第154回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 9 /20	334,000	384,353
	第155回 利付国債 (20年)	1.0000	2035/12/20	361,000	403,616
	第156回 利付国債 (20年)	0.4000	2036/ 3 /20	233,000	237,347
	第157回 利付国債 (20年)	0.2000	2036/ 6 /20	218,000	214,418
	第158回 利付国債 (20年)	0.5000	2036/ 9 /20	333,000	343,802
	第159回 利付国債 (20年)	0.6000	2036/12/20	334,000	350,315

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	339,000	360,946
	第161回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 6 /20	338,000	353,727
	第162回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 9 /20	334,000	349,133
	第163回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/12/20	347,000	362,281
	第164回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 3 /20	415,000	424,964
	第165回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 6 /20	345,000	352,748
	第166回 利付国債 (20年)	0.7000	2038/ 9 /20	330,000	349,192
	第167回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/12/20	137,000	139,637
	小計	—	—	—	65,804,309
地方債証券	第697回 東京都公募公債	1.1100	2021/ 6 /18	200,000	204,944
	第707回 東京都公募公債	0.8700	2022/ 3 /18	200,000	205,098
	第708回 東京都公募公債	0.8900	2022/ 6 /20	300,000	308,485
	第730回 東京都公募公債	0.6640	2024/ 3 /19	300,000	309,568
	平成22年度第12回 北海道公募公債	1.2900	2021/ 1 /28	200,000	204,739
	平成27年度第1回 北海道公募公債	0.4300	2025/ 4 /30	300,000	306,412
	第 3 0 回 神奈川県公募公債 (20年)	1.1610	2035/ 9 /20	100,000	111,885
	第360回 大阪府公募公債 (10年)	0.9000	2022/ 5 /30	300,000	308,274
	第378回 大阪府公募公債 (10年)	0.7000	2023/11/28	144,000	148,433
	第 12 回 大阪府公募公債 (20年)	1.4530	2034/ 9 /26	100,000	115,563
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	1.0200	2022/ 4 /13	300,000	309,084
	第 21 回 兵庫県公募公債 (20年)	1.5400	2034/ 5 / 9	100,000	116,612
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	0.9060	2022/ 5 /20	300,000	308,360
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	0.6390	2023/ 3 /28	300,000	307,396
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	0.9210	2023/ 7 /24	100,000	103,892
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	0.6700	2024/ 2 /26	119,000	122,756
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	0.7100	2022/12/26	300,000	307,790
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	1.0000	2022/ 3 /25	300,000	308,842
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	0.7900	2023/ 2 /27	300,000	309,046
	第 10 回 群馬県公募公債	0.6700	2023/11/24	300,000	309,024
	第110回 共同発行市場公募地方債	0.8900	2022/ 5 /25	300,000	308,242
	第123回 共同発行市場公募地方債	0.8700	2023/ 6 /23	300,000	310,784
	第133回 共同発行市場公募地方債	0.6890	2024/ 4 /25	300,000	310,049
	平成22年度第1回 福島県公募公債	1.0500	2020/11/26	200,000	203,505
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	0.8330	2023/ 5 /23	150,000	155,065
	第 22 回 大阪市公募公債 (20年)	0.3470	2036/ 5 /30	100,000	98,541
	第 1 回 名古屋市公募公債	2.5300	2035/ 3 /20	100,000	133,017
	第 1 回 京都市公募公債	2.1400	2024/12/20	300,000	336,201
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	0.6890	2024/ 2 /19	100,000	103,248
	平成22年度第1回 横浜市公募公債	1.3600	2020/ 5 /25	300,000	304,800

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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
地方債証券	平成23年度第4回 横浜市公募公債	1.0450	2021/11/12	200,000	205,440
	第25回 横浜市公募公債(20年)	1.7200	2032/7/16	100,000	118,481
	平成22年度第7回 札幌市公募公債	1.0500	2020/9/18	200,000	203,106
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	0.7280	2023/12/26	150,000	155,005
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	0.4510	2024/12/24	150,000	153,480
	平成23年度第6回 福岡市公募公債	1.0000	2021/10/28	200,000	205,119
	平成24年度第4回 福岡市公募公債	0.8000	2022/10/31	100,000	102,815
	平成22年度第6回 広島市公募公債	1.2100	2021/5/31	200,000	205,263
	平成22年度第1回 相模原市公募公債	1.2900	2020/12/18	100,000	102,241
	平成22年度第1回 岡山県公募公債	1.0500	2020/11/30	200,000	203,524
	小計	—	—	—	8,644,145
特殊債券 (除く金融債券)	第1回 政保新関西空港債券	0.8010	2022/8/29	200,000	206,134
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	2.2000	2023/6/19	300,000	329,305
	第107回 政保道路機構債券	1.3000	2020/5/29	315,000	320,316
	第137回 政保道路機構債券	1.2000	2021/6/30	400,000	411,785
	第139回 政保道路機構債券	1.1000	2021/7/30	500,000	514,068
	第155回 政保道路機構債券	0.9000	2022/1/31	300,000	308,480
	第163回 政保道路機構債券	0.9010	2022/5/31	300,000	309,426
	第190回 政保道路機構債券	0.6050	2023/5/31	500,000	514,509
	第212回 政保道路機構債券	1.5000	2034/2/28	100,000	118,223
	第218回 政保道路機構債券	0.6600	2024/5/31	500,000	519,347
	第233回 政府道路機構債券	1.3150	2034/11/30	100,000	115,796
	第278回 政保道路機構債券	0.2370	2036/5/30	100,000	98,131
	第12回 政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	2020/5/22	313,000	318,187
	第12回 地方公共団体金融機構債券	1.3800	2020/5/28	200,000	203,238
	第25回 政保地方公共団体金融機構債券	1.2000	2021/6/14	200,000	205,778
	第36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	2022/5/20	200,000	206,225
	第48回 政保地方公共団体金融機構債券	0.6050	2023/5/16	300,000	308,620
	第48回 地方公共団体金融機構債券	0.8130	2023/5/26	400,000	412,816
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5090	2025/5/23	200,000	207,185
	第35回 日本政策金融公庫債券	0.6200	2023/5/8	100,000	102,348
	第133回 住宅金融支援機構債券	0.8280	2023/5/19	1,000,000	1,032,263
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7100	2045/6/10	33,871	36,208
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4300	2045/11/10	91,810	97,538
	第46回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8500	2046/3/10	110,994	119,618
	第54回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4700	2046/11/10	89,814	95,535
	第55回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4100	2046/12/10	97,752	103,783
	第60回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.3400	2047/5/10	99,464	105,382
	第61回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.2600	2047/6/10	48,211	50,872

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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
特殊債券 (除く金融債券)	第 62 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.2100	2047/ 7 /10	408,832	430,500
	第 63 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.1100	2047/ 8 /10	254,405	266,565
	第 73 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.3000	2048/ 6 /10	163,611	173,116
	第 78 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.0800	2048/11/10	148,563	155,382
	第 19 回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.8680	2023/ 6 /20	300,000	310,392
	第 4 回 広島高速道路債券	1.4480	2021/ 2 /26	200,000	205,438
	第 45 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.0500	2021/12/20	200,000	205,537
	第 55 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8420	2023/ 3 /20	100,000	103,143
	小計	—	—	—	9,221,202
金融債券	い第779号 利付農林債券	0.2600	2020/ 4 /27	300,000	300,774
	第333回 利付しんぎん中金債券	0.0900	2022/ 8 /26	100,000	100,168
	第335回 利付しんぎん中金債券	0.1000	2022/10/27	100,000	100,221
	第336回 利付しんぎん中金債券	0.1000	2022/11/25	100,000	100,229
	小計	—	—	—	601,393
社債券	第 3 回 ノルデア・バンク	1.7500	2022/ 6 /15	200,000	210,063
	第 5 回 スヴェンスカ・ハンデルスパンケン	0.6790	2024/ 9 / 4	200,000	204,178
	第 33 回 中日本高速道路債券	1.0840	2021/ 9 /17	300,000	307,709
	第 56 回 中日本高速道路債券	0.7590	2023/12/20	200,000	206,336
	第 60 回 中日本高速道路債券	0.5430	2024/12/20	100,000	102,421
	第 20 回 西日本高速道路債券	0.7590	2023/ 9 /20	100,000	103,026
	第 25 回 西日本高速道路債券	0.5240	2024/12/20	200,000	204,636
	第 26 回 西日本高速道路債券	0.6040	2025/ 5 /21	200,000	205,800
	第 14 回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	0.8200	2025/ 5 /26	100,000	102,818
	第 12 回 オリエンタルランド	0.3730	2022/ 3 /18	100,000	100,873
	第 3 回 富士フィルムホールディングス	0.8820	2022/12/ 2	300,000	308,864
	第 68 回 新日本製鐵	1.1090	2021/ 9 /17	200,000	205,079
	第 19 回 豊田自動織機	1.1090	2021/ 9 /17	200,000	205,162
	第 24 回 豊田自動織機	0.7970	2023/ 6 /20	100,000	102,858
	第 71 回 伊藤忠商事	0.8620	2023/ 3 /15	200,000	205,775
	第 39 回 住友商事	1.7080	2022/ 3 /16	100,000	104,771
	第 45 回 住友商事	1.1170	2022/ 4 /20	100,000	103,088
	第 46 回 住友商事	0.8840	2022/12/12	100,000	102,845
	第 79 回 三菱商事	1.0220	2022/ 5 /20	100,000	102,936
	第 1 回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	0.8570	2024/ 9 / 5	100,000	102,437
	第127回 三菱東京UFJ銀行	1.2750	2021/ 7 /14	200,000	205,933
	第 1 回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	0.8490	2024/ 9 /12	100,000	102,397
	第 9 回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	1.6800	2021/ 4 /28	200,000	206,818
	第 23 回 三井住友銀行劣後特約付	1.6100	2020/12/17	100,000	102,738
	第 20 回 みずほ銀行劣後特約付	1.4900	2022/ 6 / 3	100,000	104,253

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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
社債券	第 27 回 三菱UFJリース	0.5080	2021/ 2 /24	100,000	100,876
	第 46 回 三井不動産	0.9640	2022/ 8 /30	100,000	102,999
	第111回 三菱地所	0.9290	2022/ 9 /14	100,000	102,954
	第 75 回 東京急行電鉄	0.9820	2022/ 6 / 7	100,000	102,809
	第 77 回 東京急行電鉄	0.9870	2023/ 6 /12	100,000	103,696
	第 26 回 東日本旅客鉄道	1.1900	2022/12/20	100,000	104,114
	第 82 回 東日本旅客鉄道	1.1600	2021/12/22	100,000	102,999
	第 87 回 東日本旅客鉄道	0.8690	2022/ 9 /27	200,000	205,488
	第 27 回 西日本旅客鉄道	1.3600	2020/ 6 /11	100,000	101,659
	第 19 回 KDDI	1.1510	2020/ 6 /19	100,000	101,401
	第483回 関西電力	1.1550	2020/ 9 /18	200,000	203,363
	第381回 中国電力	0.9530	2024/ 4 /25	200,000	207,437
	第304回 北陸電力	0.9890	2023/10/25	100,000	103,634
	第306回 北陸電力	0.8750	2024/ 5 /24	100,000	103,358
	第253回 四国電力	1.0000	2023/ 6 /23	200,000	207,087
	第429回 九州電力	0.9090	2024/ 9 /25	200,000	206,854
	第290回 北海道電力	2.0900	2021/ 4 /23	200,000	208,331
	第 13 回 電源開発	2.0400	2025/ 6 /20	100,000	110,699
	小計	—	—	—	6,493,591
	合計	—	—	—	90,764,642

投資信託財産の構成			2019年3月11日現在
項目	当期末		
	評価額	比率	
	千円		%
公社債	90,764,642		99.2
コール・ローン等、その他	764,212		0.8
投資信託財産総額	91,528,855		100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年3月11日現在)

項目	当期末
(A)資産	91,528,855,575円
コール・ローン等	473,990,138
公社債(評価額)	90,764,642,989
未収利息	283,795,220
前払費用	6,427,228
(B)負債	2,119,186
未払解約金	2,118,151
その他未払費用	1,035
(C)純資産総額(A-B)	91,526,736,389
元本	93,129,262,284
次期繰越損益金	△ 1,602,525,895
(D)受益権総口数	93,129,262,284口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,828円

(注1) 期首元本額 130,405,709,835円
 期中追加設定元本額 4,841,831,876円
 期中一部解約元本額 42,118,279,427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。

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定)
 91,251,950,880円
 DCニッセイ日本債券インデックス 1,370,545,203円
 DCニッセイターゲットデットファンド2055 11,539,456円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 301,530,733円
 DCニッセイターゲットデットファンド2045 10,430,998円
 DCニッセイターゲットデットファンド2035 28,542,831円
 DCニッセイターゲットデットファンド2025 81,037,786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) 38,328,674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)
 3,058,399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)
 11,253,897円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
 バランスファンド(8資産均等型) 20,202,954円
 DCニッセイターゲットデットファンド2060 90,225円
 DCニッセイターゲットデットファンド2050 132,203円
 DCニッセイターゲットデットファンド2040 180,399円
 DCニッセイターゲットデットファンド2030 437,646円

(注3) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は1,602,525,895円です。

損益の状況

当期(2018年3月13日~2019年3月11日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,017,791,453円
受取利息	1,018,425,977
支払利息	△ 634,524
(B)有価証券売買損益	198,453,815
売買益	770,775,165
売買損	△ 572,321,350
(C)信託報酬等	△ 141,250
(D)当期損益金(A+B+C)	1,216,104,018
(E)前期繰越損益金	△ 4,081,273,899
(F)追加信託差損益金	△ 133,674,569
(G)解約差損益金	1,396,318,555
(H)合計(D+E+F+G)	△ 1,602,525,895
次期繰越損益金(H)	△ 1,602,525,895

(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。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 26 期

(計算期間：2019年5月21日～2019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

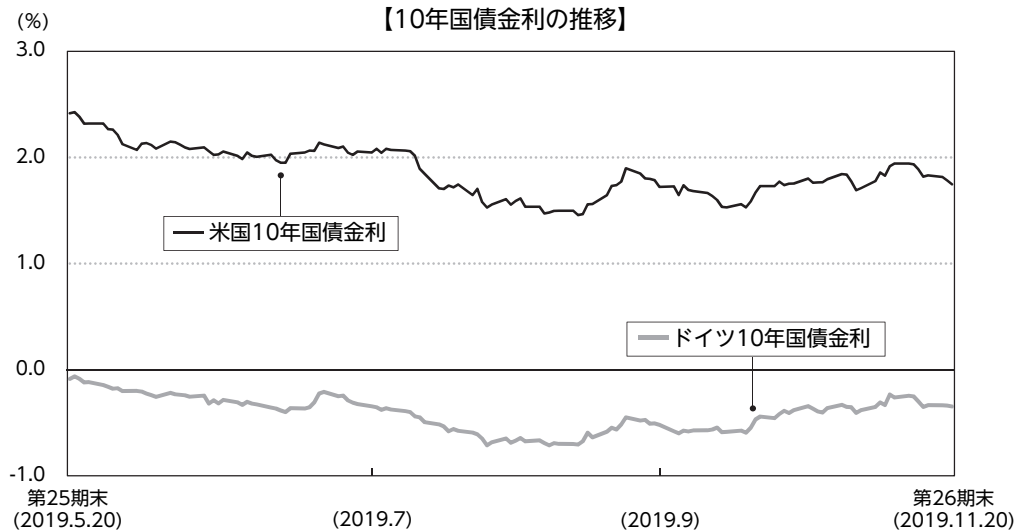
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年5月21日～2019年11月20日

投資環境

■ 海外債券市況

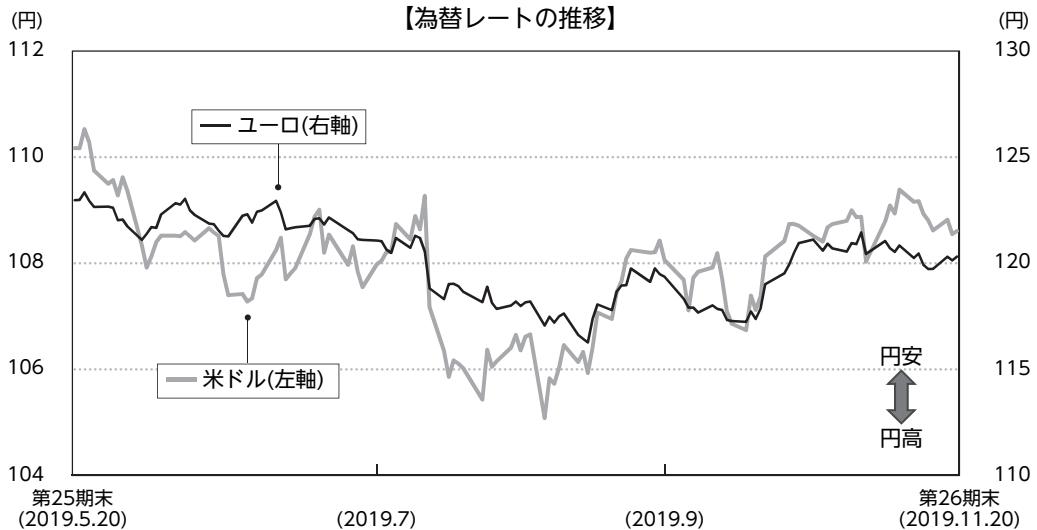


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は低下しました。期初以降、米中貿易摩擦への警戒感や激化懸念などを背景に、金利は低下傾向で推移しました。9月になると米中通商協議の進展期待などから金利は上昇し、その後はおおむね上昇傾向となりましたが、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年国債金利は低下しました。期初以降、世界の景気減速懸念やブレグジット（イギリスの欧州連合（EU）離脱）を巡る混迷、欧州中央銀行（ECB）の追加金融緩和観測等から金利は低下傾向となりました。9月以降はECBの金融緩和観測が後退したことや米中通商協議の進展期待などを背景に上昇傾向となりましたが、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

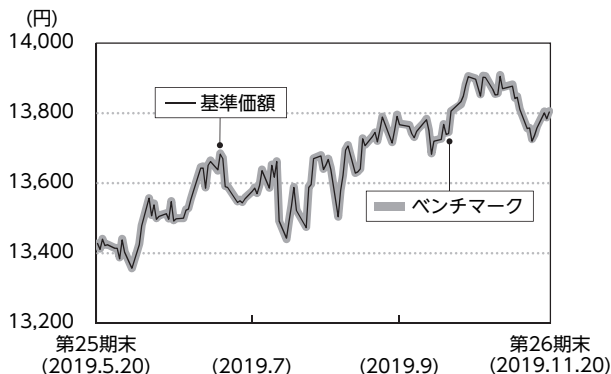


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは下落しました。期初以降、米中貿易摩擦の激化懸念などから米ドルは対円で下落し、その後は米中通商協議の動向や米利下げへの見方などを背景に上下する展開となりました。8月になると米中通商協議決裂への懸念等から米ドルは下落しましたが、その後は協議の進展期待などを背景に上昇傾向となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、世界の景気減速懸念やブレグジットを巡る混迷、ECBの追加金融緩和観測等からユーロは下落傾向で推移しました。9月以降はハードブレグジット（イギリスのEUからの強硬離脱）リスクの後退やECBの金融緩和観測の後退などからユーロはおおむね上昇傾向となりました。

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月にかけて米中貿易摩擦への警戒感などから海外主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)傾向となったこと
- ・ 9月から当期末にかけて米中貿易協議の進展期待などから米ドルが対円で上昇したこと

<下落要因>

- ・ 8月頃、米中通商協議の決裂などを受けて投資家のリスク回避姿勢により主要通貨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+2.8%となり、ベンチマーク騰落率(+2.8%)に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(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)2019年5月20日	13,428	—	13,563	—	99.1
5月末	13,403	△0.2	13,540	△0.2	99.0
6月末	13,577	1.1	13,715	1.1	99.1
7月末	13,617	1.4	13,756	1.4	98.9
8月末	13,706	2.1	13,847	2.1	99.1
9月末	13,773	2.6	13,911	2.6	99.1
10月末	13,905	3.6	14,049	3.6	99.0
(期末)2019年11月20日	13,803	2.8	13,945	2.8	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2019年5月21日～2019年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	2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)	(2)	(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)	・ 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	2	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（13,647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5月21日～2019年11月20日

公社債

		買付額	売付額
外国	アメリカ	千米ドル 32,361	千米ドル 9,165
	カナダ	千カナダ・ドル 1,659	千カナダ・ドル 691
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 1,457	千オーストラリア・ドル 53
	シンガポール	千シンガポール・ドル 378	千シンガポール・ドル 151
	イギリス	千イギリス・ポンド 2,493	千イギリス・ポンド 727
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,818	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 1,073	千ノルウェー・クローネ -
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 1,431	千スウェーデン・クローナ -
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 10,017	千メキシコ・ペソ 2,775
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,128	千マレーシア・リンギット 393
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 4,900	千南アフリカ・ランド -
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 1,321	千ポーランド・ズロチ 396
	ユーロ	千ユーロ 361	千ユーロ 85
		アイルランド 国債証券 826	212
		オランダ 国債証券 1,084	316
		ベルギー 国債証券 4,920	856
		フランス 国債証券 3,434	1,179
		ドイツ 国債証券 2,686	603
		スペイン 国債証券 4,237	1,031
		イタリア 国債証券 267	82
		フィンランド 国債証券 615	178
		オーストリア 国債証券	

(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

2019年5月21日～2019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	129,713	US TREASURY	177,242
US TREASURY	128,422	US TREASURY	151,810
US TREASURY	115,749	US TREASURY	150,424
US TREASURY	115,328	US TREASURY	149,388
US TREASURY	98,940	US TREASURY	124,074
US TREASURY	98,689	US TREASURY	123,221
US TREASURY	89,978	FRANCE (GOVT OF)	45,827
US TREASURY	81,770	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	39,923
US TREASURY	81,455	UK TSY 2% 2020	36,821
US TREASURY	79,676	BUONI POLIENNALI DEL TES	36,577

(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

2019年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
	104,940	109,802	11,925,668	47.9	—	20.2	17.9	9.8
カナダ	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
	5,210	5,697	466,156	1.9	—	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
	5,800	6,672	494,692	2.0	—	1.4	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
	1,170	1,251	99,840	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
	8,570	11,110	1,559,090	6.3	—	4.9	1.0	0.4
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						
	6,110	7,964	128,222	0.5	—	0.4	0.1	0.1

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末							
		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ノルウェー		千ノルウェー・クローネ 4,720	千ノルウェー・クローネ 4,887	千円 58,108	% 0.2	% －	% 0.1	% 0.1	% 0.1
スウェーデン		千スウェーデン・クローナ 6,600	千スウェーデン・クローナ 7,443	83,814	0.3	－	0.2	0.1	0.1
メキシコ		千メキシコ・ペソ 35,180	千メキシコ・ペソ 37,120	208,248	0.8	－	0.5	0.2	0.1
マレーシア		千マレーシア・リンギット 4,030	千マレーシア・リンギット 4,216	110,059	0.4	－	0.3	0.1	0.0
南アフリカ		千南アフリカ・ランド 20,880	千南アフリカ・ランド 19,107	140,439	0.6	－	0.5	0.0	0.0
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 4,730	千ポーランド・ズロチ 5,042	141,228	0.6	－	0.2	0.2	0.1
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ						
	アイルランド	1,240	1,429	171,943	0.7	－	0.5	0.2	－
	オランダ	3,100	3,786	455,599	1.8	－	1.1	0.6	0.1
	ベルギー	3,840	4,827	580,811	2.3	－	1.7	0.5	0.1
	フランス	16,680	20,171	2,427,014	9.8	－	6.7	2.1	0.9
	ドイツ	10,620	12,796	1,539,643	6.2	－	3.6	1.7	0.9
	スペイン	9,470	11,542	1,388,846	5.6	－	3.7	1.3	0.6
	イタリア	15,670	18,155	2,184,518	8.8	－	5.4	2.4	1.0
	フィンランド	1,010	1,138	137,011	0.6	－	0.3	0.2	0.0
オーストリア	2,280	2,820	339,312	1.4	－	0.9	0.4	0.1	
合計		－	－	24,640,272	99.1	－	53.6	30.3	15.1

(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	
						邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	80	100	10,904
	US TREASURY	6.5000	2026/11/15	60	78	8,573
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	159	17,310
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	80	104	11,313
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	100	128	13,997
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	70	90	9,854
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	160	217	23,662
	US TREASURY	2.6250	2020/11/15	2,080	2,099	228,043
	US TREASURY	1.8750	2020/12/15	1,440	1,443	156,764
	US TREASURY	2.3750	2020/12/31	1,460	1,471	159,809
	US TREASURY	1.3750	2021/01/31	2,110	2,103	228,431
	US TREASURY	2.0000	2021/02/28	1,450	1,456	158,191
	US TREASURY	2.2500	2021/03/31	1,490	1,502	163,136
	US TREASURY	3.1250	2021/05/15	1,780	1,818	197,501
	US TREASURY	2.0000	2021/05/31	1,600	1,608	174,705
	US TREASURY	2.1250	2021/06/30	1,550	1,562	169,660
	US TREASURY	2.1250	2021/08/15	2,080	2,097	227,788
	US TREASURY	2.0000	2021/08/31	1,670	1,680	182,554
	US TREASURY	2.1250	2021/09/30	1,620	1,634	177,535
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	2,040	2,055	223,250
	US TREASURY	2.6250	2021/12/15	1,230	1,255	136,381
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	1,170	1,182	128,418
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	1,630	1,643	178,540
	US TREASURY	2.3750	2022/03/15	1,180	1,201	130,457
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	1,200	1,204	130,794
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	1,470	1,475	160,285
	US TREASURY	1.7500	2022/06/15	1,180	1,185	128,704
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	1,180	1,196	129,906
	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	1,490	1,491	161,972
	US TREASURY	1.6250	2022/08/31	1,190	1,190	129,351
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	1,560	1,566	170,172
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	1,660	1,661	180,460
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	970	985	107,025
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	1,880	1,902	206,681
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	1,030	1,026	111,513
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	1,910	1,919	208,432
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	1,050	1,041	113,148

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	1,860	1,919	208,507
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	1,140	1,129	122,722
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,910	1,993	216,462
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	1,280	1,312	142,517
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	1,870	1,956	212,469
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	1,200	1,225	133,054
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	2,030	2,106	228,770
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	1,180	1,199	130,261
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	2,080	2,150	233,524
	US TREASURY	2.1250	2024/09/30	1,110	1,135	123,311
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	1,640	1,688	183,337
	US TREASURY	2.2500	2024/12/31	670	689	74,937
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	1,210	1,231	133,717
	US TREASURY	2.6250	2025/03/31	600	629	68,398
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	1,280	1,310	142,371
	US TREASURY	2.7500	2025/06/30	570	602	65,481
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	1,360	1,384	150,316
	US TREASURY	3.0000	2025/09/30	570	611	66,451
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	1,360	1,403	152,428
	US TREASURY	2.6250	2025/12/31	680	716	77,850
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	1,230	1,224	133,026
	US TREASURY	2.2500	2026/03/31	680	702	76,309
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	1,230	1,224	132,947
	US TREASURY	1.8750	2026/06/30	650	656	71,346
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	1,230	1,213	131,800
	US TREASURY	1.6250	2026/09/30	680	676	73,450
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	1,150	1,172	127,310
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	750	777	84,435
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	750	784	85,240
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	760	789	85,693
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	750	778	84,604
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	780	840	91,257
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	840	914	99,300
	US TREASURY	2.8750	2028/08/15	860	937	101,777
	US TREASURY	3.1250	2028/11/15	880	978	106,276
	US TREASURY	2.6250	2029/02/15	900	964	104,758
	US TREASURY	2.3750	2029/05/15	890	935	101,593
	US TREASURY	1.6250	2029/08/15	910	896	97,348

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	4.5000	2036/02/15	170	229	24,962
	US TREASURY	5.0000	2037/05/15	90	129	14,118
	US TREASURY	4.3750	2038/02/15	80	108	11,785
	US TREASURY	4.5000	2038/05/15	90	124	13,472
	US TREASURY	3.5000	2039/02/15	150	183	19,928
	US TREASURY	4.2500	2039/05/15	140	188	20,438
	US TREASURY	4.5000	2039/08/15	140	194	21,089
	US TREASURY	4.3750	2039/11/15	170	232	25,266
	US TREASURY	4.6250	2040/02/15	250	352	38,333
	US TREASURY	3.8750	2040/08/15	200	257	27,972
	US TREASURY	4.2500	2040/11/15	200	270	29,374
	US TREASURY	4.7500	2041/02/15	230	331	35,994
	US TREASURY	3.1250	2041/11/15	170	197	21,417
	US TREASURY	3.1250	2042/02/15	220	255	27,728
	US TREASURY	3.0000	2042/05/15	180	204	22,232
	US TREASURY	2.7500	2042/08/15	290	316	34,399
	US TREASURY	2.7500	2042/11/15	350	382	41,505
	US TREASURY	3.1250	2043/02/15	350	406	44,129
	US TREASURY	2.8750	2043/05/15	510	568	61,797
	US TREASURY	3.6250	2043/08/15	400	502	54,556
	US TREASURY	3.7500	2043/11/15	490	627	68,171
	US TREASURY	3.6250	2044/02/15	500	629	68,354
	US TREASURY	3.3750	2044/05/15	500	606	65,855
	US TREASURY	3.1250	2044/08/15	500	583	63,337
	US TREASURY	3.0000	2044/11/15	500	571	62,087
	US TREASURY	2.5000	2045/02/15	500	523	56,837
	US TREASURY	3.0000	2045/05/15	500	572	62,229
	US TREASURY	2.8750	2045/08/15	510	572	62,126
	US TREASURY	3.0000	2045/11/15	500	574	62,355
	US TREASURY	2.5000	2046/02/15	460	481	52,337
	US TREASURY	2.5000	2046/05/15	490	513	55,759
	US TREASURY	2.2500	2046/08/15	460	458	49,827
	US TREASURY	2.8750	2046/11/15	470	529	57,477
	US TREASURY	3.0000	2047/02/15	460	530	57,612
	US TREASURY	3.0000	2047/05/15	460	530	57,608
	US TREASURY	2.7500	2047/08/15	480	528	57,394
	US TREASURY	2.7500	2047/11/15	460	506	55,042
	US TREASURY	3.0000	2048/02/15	500	577	62,698

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						千円	邦貨換算金額
アメリカ			%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY		3.1250	2048/05/15	550	650	70,632
	US TREASURY		3.0000	2048/08/15	580	670	72,865
	US TREASURY		3.3750	2048/11/15	620	768	83,488
	US TREASURY		3.0000	2049/02/15	610	707	76,792
	US TREASURY		2.8750	2049/05/15	610	691	75,082
	US TREASURY		2.2500	2049/08/15	620	619	67,229
	US TREASURY		6.2500	2030/05/15	100	142	15,480
	US TREASURY		4.3750	2040/05/15	220	301	32,768
	US TREASURY		4.3750	2041/05/15	180	247	26,922
	US TREASURY		3.7500	2041/08/15	190	241	26,178
小計			—	—	—	—	11,925,668
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	82	6,772
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0000	2020/11/01	120	120	9,849
	CANADIAN GOVERNMENT		2.2500	2021/02/01	150	151	12,363
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2021/03/01	310	306	25,088
	CANADIAN GOVERNMENT		1.7500	2021/05/01	140	140	11,482
	CANADIAN GOVERNMENT		3.2500	2021/06/01	140	143	11,743
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2021/08/01	150	149	12,263
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2021/09/01	220	216	17,754
	CANADIAN GOVERNMENT		1.2500	2021/11/01	150	149	12,209
	CANADIAN GOVERNMENT		0.5000	2022/03/01	230	224	18,390
	CANADIAN GOVERNMENT		2.7500	2022/06/01	150	154	12,646
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0000	2022/09/01	300	295	24,202
	CANADIAN GOVERNMENT		1.7500	2023/03/01	210	211	17,314
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2023/06/01	180	180	14,732
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0000	2023/09/01	130	132	10,836
	CANADIAN GOVERNMENT		2.2500	2024/03/01	150	154	12,664
	CANADIAN GOVERNMENT		2.5000	2024/06/01	160	167	13,685
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2024/09/01	190	190	15,578
	CANADIAN GOVERNMENT		1.2500	2025/03/01	50	49	4,048
	CANADIAN GOVERNMENT		2.2500	2025/06/01	170	177	14,495
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2026/06/01	160	160	13,126
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0000	2027/06/01	180	174	14,249
	CANADIAN GOVERNMENT		8.0000	2027/06/01	40	58	4,779
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0000	2028/06/01	170	177	14,513
	CANADIAN GOVERNMENT		2.2500	2029/06/01	140	149	12,265
	CANADIAN GOVERNMENT		5.7500	2029/06/01	140	192	15,774

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	邦貨換算金額
カナダ			%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	80	78	6,403	
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	150	227	18,576	
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	150	228	18,682	
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	170	243	19,962	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	200	280	22,970	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	170	215	17,671	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	100	110	9,056	
小計			—	—	—	—	466,156
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	1.7500	2020/11/21	230	232	17,208	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/05/15	320	343	25,457	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	220	225	16,730	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	310	350	26,007	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	190	198	14,721	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	300	348	25,804	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	340	368	27,346	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	330	371	27,551	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	390	470	34,866	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	360	456	33,821	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	340	384	28,482	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	330	361	26,771	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	320	364	27,036	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	350	416	30,861	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	310	357	26,486	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	290	328	24,367	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	140	144	10,737	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	170	238	17,657	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	100	119	8,826	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	140	188	13,995	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	110	141	10,464	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	50	59	4,440	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	160	202	15,047	
	小計			—	—	—	—
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/06/01	100	101	8,072	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.2500	2021/10/01	100	99	7,948	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	100	104	8,337	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	150	156	12,472	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
							邦貨換算金額
シンガポール			%		千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	120	127	10,190	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	30	31	2,488	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	50	51	4,103	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	90	101	8,072	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	60	64	5,123	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	50	54	4,385	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	40	44	3,529	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	70	82	6,610	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	50	52	4,185	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	20	21	1,696	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	60	67	5,384	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	80	90	7,239	
小計			—	—	—	—	99,840
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	3.7500	2021/09/07	170	179	25,215	
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	200	296	41,561	
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	230	380	53,396	
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	230	339	47,618	
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	220	370	51,982	
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	160	206	28,982	
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	190	265	37,288	
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	170	262	36,825	
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	200	313	43,929	
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	210	396	55,658	
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	170	241	33,942	
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	160	172	24,239	
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	180	341	47,978	
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	190	307	43,203	
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	200	246	34,632	
	UK TREASURY	8.0000	2021/06/07	160	178	25,022	
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	130	191	26,878	
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	140	140	19,730	
	UK TREASURY	1.5000	2021/01/22	310	313	43,923	
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	200	212	29,877	
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	260	274	38,465	
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	190	199	28,029	
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	320	347	48,740	
	UK TREASURY	1.6250	2054/10/22	100	111	15,593	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						千円	邦貨換算金額
イギリス			%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
国債証券	UK TREASURY		1.6250	2071/10/22	120	142	19,947
	UK TREASURY		1.0000	2024/04/22	320	326	45,848
	UK TREASURY		1.7500	2022/09/07	280	289	40,639
	UK TREASURY		1.7500	2049/01/22	90	100	14,101
	UK TREASURY		1.7500	2057/07/22	200	233	32,793
	UK TREASURY		2.2500	2023/09/07	200	213	29,904
	UK TREASURY		2.7500	2024/09/07	140	154	21,723
	UK TREASURY		2.0000	2025/09/07	110	119	16,779
	UK TREASURY		0.8750	2029/10/22	130	131	18,493
	UK TREASURY		3.5000	2068/07/22	200	371	52,089
	UK TREASURY		3.2500	2044/01/22	280	395	55,555
	UK TREASURY		3.7500	2052/07/22	200	335	47,057
	UK TREASURY		3.5000	2045/01/22	270	400	56,135
	UK TREASURY		4.2500	2049/12/07	170	296	41,652
	UK TREASURY		0.5000	2022/07/22	310	309	43,495
	UK TREASURY		0.7500	2023/07/22	330	332	46,701
	UK TREASURY		1.7500	2037/09/07	300	328	46,117
	UK TREASURY		2.5000	2065/07/22	230	337	47,332
小計			—	—	—	—	1,559,090
デンマーク					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK		0.2500	2020/11/15	600	606	9,758
	KINGDOM OF DENMARK		3.0000	2021/11/15	870	935	15,058
	KINGDOM OF DENMARK		1.5000	2023/11/15	770	837	13,478
	KINGDOM OF DENMARK		1.7500	2025/11/15	760	866	13,947
	KINGDOM OF DENMARK		0.5000	2027/11/15	1,040	1,121	18,049
	KINGDOM OF DENMARK		0.5000	2029/11/15	470	508	8,193
	KINGDOM OF DENMARK		4.5000	2039/11/15	1,600	3,089	49,736
小計			—	—	—	—	128,222
ノルウェー					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.7500	2021/05/25	1,020	1,058	12,583
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.0000	2023/05/24	1,140	1,168	13,899
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.0000	2024/03/14	560	601	7,147
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2025/03/13	390	400	4,759
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.5000	2026/02/19	420	425	5,062
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2027/02/17	440	452	5,378
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.0000	2028/04/26	430	450	5,361
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2029/09/06	320	329	3,915
小計			—	—	—	—	58,108

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
							邦貨換算金額
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	千円
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT		5.0000	2020/12/01	1,140	1,202	13,545
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5000	2022/06/01	1,300	1,428	16,087
	SWEDISH GOVERNMENT		1.5000	2023/11/13	980	1,052	11,855
	SWEDISH GOVERNMENT		2.5000	2025/05/12	880	1,016	11,445
	SWEDISH GOVERNMENT		1.0000	2026/11/12	720	780	8,793
	SWEDISH GOVERNMENT		0.7500	2028/05/12	530	569	6,409
	SWEDISH GOVERNMENT		0.7500	2029/11/12	540	581	6,545
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5000	2039/03/30	510	810	9,131
小計			—	—	—	—	83,814
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		6.5000	2021/06/10	3,800	3,792	21,278
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.2500	2021/12/09	1,850	1,870	10,495
	MEX BONOS DESARR FIX RT		6.5000	2022/06/09	3,550	3,540	19,859
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.0000	2023/12/07	3,840	4,013	22,514
	MEX BONOS DESARR FIX RT		10.0000	2024/12/05	4,270	4,856	27,246
	MEX BONOS DESARR FIX RT		5.7500	2026/03/05	2,240	2,116	11,876
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.5000	2027/06/03	3,340	3,458	19,403
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5000	2029/05/31	2,540	2,815	15,794
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.7500	2031/05/29	1,750	1,849	10,374
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.7500	2034/11/23	1,220	1,288	7,228
	MEX BONOS DESARR FIX RT		10.0000	2036/11/20	900	1,147	6,435
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5000	2038/11/18	1,960	2,208	12,390
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.7500	2042/11/13	2,230	2,336	13,110
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.0000	2047/11/07	1,690	1,825	10,240
小計			—	—	—	—	208,248
マレーシア					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT		4.1600	2021/07/15	310	315	8,232
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.6200	2021/11/30	200	202	5,276
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.4180	2022/08/15	390	393	10,260
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.4800	2023/03/15	330	333	8,696
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.1810	2024/07/15	290	301	7,858
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.9550	2025/09/15	200	206	5,385
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.3920	2026/04/15	120	127	3,314
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.9000	2026/11/30	240	247	6,460
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.8920	2027/03/15	300	309	8,071
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.7330	2028/06/15	140	142	3,730
	MALAYSIA GOVERNMENT		3.8850	2029/08/15	140	145	3,788
	MALAYSIA GOVERNMENT		4.4980	2030/04/15	150	162	4,235

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額	
マレーシア			%		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	120	126	3,307	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/04/15	100	104	2,733	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	280	285	7,445	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	70	74	1,937	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	140	159	4,159	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	130	148	3,885	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	100	114	2,990	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	100	111	2,903	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	120	138	3,603	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.2480	2028/09/15	60	68	1,780	
小計			—	—	—	—	110,059
南アフリカ					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/03/31	600	601	4,418	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/02/28	1,490	1,510	11,103	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	2,940	3,274	24,070	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/01/31	2,070	1,925	14,150	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/02/28	1,220	1,027	7,552	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/03/31	1,330	1,218	8,956	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/02/28	1,310	1,221	8,976	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/03/31	1,440	1,034	7,601	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/01/31	1,560	1,386	10,191	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/01/31	1,220	1,112	8,173	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/02/28	1,160	806	5,927	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/01/31	1,760	1,547	11,374	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/02/28	2,780	2,441	17,942	
	小計			—	—	—	—
ポーランド					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2021/04/25	310	313	8,775	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	770	833	23,346	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/04/25	130	132	3,704	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	470	523	14,668	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2023/01/25	160	164	4,599	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	550	597	16,733	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	510	525	14,710	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	330	353	9,899	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	450	464	13,012	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	360	371	10,407	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	350	367	10,302	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ポーランド		%		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	130	172	4,844
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	210	222	6,223
小計		—	—	—	—	141,228
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド						
国債証券	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	70	72	8,673
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	140	150	18,091
	IRISH TREASURY	1.1000	2029/05/15	100	109	13,212
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	50	56	6,767
	IRISH TREASURY	1.3500	2031/03/18	70	78	9,500
	IRISH TREASURY	1.5000	2050/05/15	50	57	6,968
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	70	83	10,011
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	100	128	15,490
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	110	136	16,367
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	70	70	8,533
	IRISH TREASURY	0.9000	2028/05/15	100	107	12,970
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	100	116	13,997
	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	80	91	11,024
	TREASURY 5.4% 2025	5.4000	2025/03/13	130	169	20,334
小計		—	—	—	—	171,943
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/07/15	190	202	24,339
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	190	192	23,170
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	190	204	24,639
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	170	193	23,323
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	210	228	27,466
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	190	194	23,381
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	180	201	24,227
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	190	197	23,781
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	170	180	21,691
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	190	205	24,763
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	150	221	26,698
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	150	163	19,670
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	130	135	16,332
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	170	227	27,376
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	190	318	38,340
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	70	74	9,008
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	190	341	41,043

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	180	302	36,345
小計		—	—	—	—	455,599
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/09/28	200	218	26,263
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	160	177	21,362
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	200	227	27,425
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	160	176	21,208
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	120	123	14,833
	BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	180	205	24,705
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	130	135	16,338
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	200	212	25,620
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	120	156	18,886
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	190	206	24,810
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	160	172	20,721
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	220	325	39,145
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	180	194	23,397
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	160	174	21,011
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	140	154	18,629
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	100	147	17,803
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	80	91	10,984
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	90	125	15,132
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	240	409	49,303
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	60	70	8,473
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	100	125	15,139
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	210	366	44,117
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	120	208	25,063
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	130	159	19,216
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	70	87	10,527
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	60	85	10,320
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	60	86	10,367
小計		—	—	—	—	580,811
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	240	242	29,132
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/02/25	380	383	46,086
	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/04/25	450	478	57,552
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/05/25	360	363	43,730
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	460	494	59,515

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/02/25	350	354	42,691
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	560	609	73,367
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	370	375	45,223
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	470	509	61,344
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	400	407	49,078
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	650	703	84,682
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	540	643	77,382
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	360	367	44,255
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	410	461	55,501
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	450	499	60,155
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	300	306	36,852
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	450	472	56,865
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	370	511	61,496
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	390	422	50,779
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	460	574	69,171
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	430	452	54,498
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	400	414	49,905
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	360	393	47,376
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	500	619	74,536
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	400	431	51,914
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	410	442	53,220
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	430	659	79,299
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	400	421	50,765
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	90	90	10,862
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	500	632	76,110
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	550	641	77,159
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	390	673	81,038
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	300	343	41,324
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	350	588	70,827
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	370	423	51,000
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	320	530	63,871
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	250	311	37,428
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	430	782	94,136
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	320	517	62,304
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	320	427	51,386
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	260	312	37,586
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	200	395	47,645

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	150	310	37,410
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	130	170	20,537
小計		—	—	—	—	2,427,014
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2021/04/09	250	252	30,351
	BUNDESobligation	0.0000	2021/10/08	220	222	26,798
	BUNDESobligation	0.0000	2022/04/08	210	213	25,671
	BUNDESobligation	0.0000	2022/10/07	210	214	25,757
	BUNDESobligation	0.0000	2023/10/13	190	194	23,442
	BUNDESobligation	0.0000	2024/10/18	170	174	21,049
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/01/04	230	238	28,681
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	220	233	28,153
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.2500	2021/09/04	190	199	24,057
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	230	243	29,272
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2022/07/04	210	223	26,888
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	310	329	39,588
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	220	235	28,346
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	400	430	51,780
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	200	220	26,473
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	360	396	47,720
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	460	504	60,659
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	210	226	27,209
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	280	296	35,625
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	270	294	35,449
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	310	330	39,768
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	310	321	38,628
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	310	327	39,367
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	300	323	38,894
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	240	259	31,189
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	260	275	33,138
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	270	286	34,415
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	190	196	23,636
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	110	185	22,276
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	240	416	50,121
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	270	462	55,627
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	170	314	37,845
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	190	378	45,546

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	180	311	37,478
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	330	525	63,206
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	340	553	66,593
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	210	275	33,095
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	50	47	5,700
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/12/11	150	151	18,171
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2021/03/12	160	161	19,414
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2021/06/11	180	181	21,874
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2021/09/10	160	161	19,476
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	130	200	24,131
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	180	270	32,584
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	140	203	24,515
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	200	332	39,966
小計		—	—	—	—	1,539,643
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8500	2020/10/31	210	220	26,543
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/01/31	230	231	27,827
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/04/30	300	325	39,178
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7500	2021/07/30	260	265	31,896
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/10/31	240	241	29,113
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	270	307	36,938
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	250	254	30,624
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	220	224	27,043
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	260	306	36,932
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.3500	2023/07/30	240	244	29,438
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	260	306	36,911
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	210	253	30,491
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	250	293	35,287
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2024/07/30	140	142	17,103
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	280	318	38,377
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	270	293	35,312
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	270	340	40,981
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	260	292	35,149
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	230	256	30,913
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	280	387	46,580
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	270	291	35,016
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	240	262	31,583

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	260	284	34,178
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	250	272	32,805
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	260	283	34,127
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	220	312	37,648
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	300	453	54,506
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	270	296	35,656
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	190	193	23,247
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	290	334	40,208
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	270	441	53,066
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	220	267	32,208
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	120	138	16,612
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	240	369	44,404
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	230	396	47,748
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	250	426	51,259
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	170	316	38,090
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	210	288	34,758
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	150	200	24,145
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	130	207	24,925
小計		—	—	—	—	1,388,846
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2020/11/01	180	181	21,824
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/03/01	280	293	35,362
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2021/04/15	190	190	22,903
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/05/01	200	211	25,396
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2021/06/01	220	221	26,669
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/08/01	340	361	43,504
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2021/09/01	300	325	39,128
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3000	2021/10/15	190	198	23,837
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	390	406	48,956
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	670	689	82,961
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0000	2022/07/15	210	214	25,824
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	230	263	31,752
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	430	445	53,560
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	320	369	44,432
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	420	428	51,581
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	240	273	32,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	290	336	40,458

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	邦貨換算金額 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	0.6500	2023/10/15	410	414	49,845
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	150	200	24,107
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	280	326	39,340
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	380	402	48,383
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	240	275	33,112
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	430	469	56,456
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	330	403	48,567
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	420	437	52,628
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	440	471	56,712
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	260	318	38,347
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	420	440	52,968
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	240	245	29,573
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	220	239	28,796
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	220	237	28,519
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	320	452	54,485
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	260	279	33,642
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	300	391	47,138
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	240	274	32,983
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	230	267	32,130
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	340	465	56,055
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	310	374	45,095
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	90	90	10,859
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	360	534	64,255
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	260	265	31,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	250	373	44,882
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	190	209	25,176
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	300	427	51,392
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	160	193	23,293
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	180	191	23,052
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	330	431	51,861
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	180	207	24,980
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	270	400	48,205
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	90	105	12,675
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	260	386	46,506
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	210	311	37,481
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	200	242	29,143
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	200	221	26,644

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	190	237	28,615
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	150	199	23,979
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	120	129	15,533
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	140	199	24,005
小計		—	—	—	—	2,184,518
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/04/15	80	84	10,186
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2022/04/15	50	50	6,103
	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	70	74	8,954
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	50	53	6,444
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	70	71	8,595
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	90	99	12,029
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	70	87	10,546
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	60	64	7,745
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	70	73	8,866
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	60	63	7,627
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	100	125	15,093
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	50	52	6,366
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	60	65	7,829
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	40	45	5,487
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	50	75	9,097
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	40	50	6,034
小計		—	—	—	—	137,011
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/09/15	180	193	23,284
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	110	121	14,605
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	80	81	9,786
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	110	123	14,831
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2023/07/15	70	71	8,586
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	210	228	27,543
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	150	165	19,913
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	120	131	15,786
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	110	146	17,620
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	140	150	18,062
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	100	105	12,696
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	110	165	19,868
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	120	129	15,553

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	100	105	12,711
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	90	118	14,317
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	170	283	34,073
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	80	132	15,890
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	80	101	12,171
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	50	108	13,114
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	40	53	6,473
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	60	103	12,420
小計		—	—	—	—	339,312
ユーロ小計		—	—	—	—	9,224,702
合計		—	—	—	—	24,640,272

投資信託財産の構成

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	24,640,272	98.6
コール・ローン等、その他	350,494	1.4
投資信託財産総額	24,990,767	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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1シンガポール・ドル79.80円、1イギリス・ポンド140.33円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1メキシコ・ペソ5.61円、1マレーシア・リンギット26.10円、1南アフリカ・ランド7.35円、1ポーランド・ズロチ28.01円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産（24,831,126千円）の投資信託財産総額（24,990,767千円）に対する比率は99.4%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

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	25,045,361,169円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	197,283,556
公 社 債(評価額)	24,640,272,641
未 収 入 金	55,332,327
未 収 利 息	139,580,909
前 払 費 用	12,891,736
(B)負債	173,283,462
未 払 金	127,359,923
未 払 解 約 金	45,922,806
そ の 他 未 払 費 用	733
(C)純 資 産 総 額(A - B)	24,872,077,707
元 本	18,019,497,917
次 期 繰 越 損 益 金	6,852,579,790
(D)受 益 権 総 口 数	18,019,497,917口
1万口当たり基準価額(C / D)	13,803円

- (注1) 期首元本額 14,660,272,235円
期中追加設定元本額 4,854,647,139円
期中一部解約元本額 1,495,421,457円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパ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) 1,913,723,452円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 3,342,592,527円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 1,117,994,429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) 695,278,547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) 5,548,187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) 16,265,029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) 15,522,663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 8,537,605,753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) 821,539,249円
DCニッセイ外国債券インデックス 870,914,843円
DCニッセイターゲットデートファンド2055 28,348,797円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 492,962,365円
DCニッセイターゲットデートファンド2045 18,637,530円
DCニッセイターゲットデートファンド2035 38,575,285円
DCニッセイターゲットデートファンド2025 14,055,660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) 54,322,993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) 3,312,314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) 21,545,383円
DCニッセイターゲットデートファンド2060 1,986,946円
DCニッセイターゲットデートファンド2050 1,882,158円
DCニッセイターゲットデートファンド2040 3,194,198円
DCニッセイターゲットデートファンド2030 3,689,609円

損益の状況

当期 (2019年5月21日～2019年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	256,672,725円
受 取 利 息	256,711,110
支 払 利 息	△ 38,385
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	346,956,927
売 買 益	739,402,938
売 買 損	△ 392,446,011
(C)信 託 報 酬 等	△ 4,022,700
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	599,606,952
(E)前 期 繰 越 損 益 金	5,025,905,946
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,776,524,158
(G)解 約 差 損 益 金	△ 549,457,266
(H)合 計(D + E + F + G)	6,852,579,790
次 期 繰 越 損 益 金(H)	6,852,579,790

- (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。

・ 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。

・ M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

M S C I エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。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。

・ 東証R E I T指数（配当込み）

東証R E I T指数は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます）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・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標または標章に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。㈱東京証券取引所は、東証R E I T指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証R E I T指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証R E I T指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。㈱東京証券取引所は、東証R E I T指数の指数値および東証R E I T指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証R E I T指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。㈱東京証券取引所は、東証R E I T指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証R E I T指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、㈱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ありません。㈱東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。㈱東京証券取引所は、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、東証R E I T指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・ S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S & P先進国REITインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。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。

- ・ NOMURA-BPI総合

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

- ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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