

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	主にニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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目標とします。	
主要運用対象	<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	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	日本を除く世界主要先進国の株式
組入制限	<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	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	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。
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。	

<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

運 用 報 告 書

第 1 期

(決算日 2014年11月20日)


●受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第1期の決算を行いました。ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも是非ご継続頂き、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 携帯・PHS OK 0120-762-506 (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			(ご参考)			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
		税引前 分配金	期 中 騰落率	基準価額+ 累計分配金	ベンチマーク	期 中 騰落率				
(設 定 日) 2013年12月10日	円 10,000	円 —	% —	円 10,000		% —	% —	% —	% —	百万円 27
1期(2014年11月20日)	12,526	0	25.3	12,526	12,589	25.9	92.0	6.3	2.0	5,755

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。以下同じです。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークはMSCI Inc. が公表するMSCI コクサイ インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)で、設定時を10,000として、当社で独自に指数化したものです。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCI コクサイ 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、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

(注5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注6) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(設 定 日) 2013年12月10日	円 10,000	% —		% —	% —	% —	% —
12月末	10,485	4.9	10,491	4.9	95.0	3.2	1.7
2014年1月末	9,970	△ 0.3	9,973	△ 0.3	91.5	6.6	1.8
2月末	10,307	3.1	10,315	3.2	94.9	3.0	1.9
3月末	10,411	4.1	10,422	4.2	99.2	2.7	2.0
4月末	10,547	5.5	10,563	5.6	92.5	5.4	1.9
5月末	10,664	6.6	10,673	6.7	94.5	3.4	2.0
6月末	10,795	8.0	10,806	8.1	94.9	2.7	2.1
7月末	10,943	9.4	10,956	9.6	93.2	4.6	2.1
8月末	11,102	11.0	11,121	11.2	95.5	2.3	2.1
9月末	11,423	14.2	11,442	14.4	94.0	3.8	2.0
10月末	11,357	13.6	11,381	13.8	91.5	6.3	2.1
(期 末) 2014年11月20日	12,526	25.3	12,589	25.9	92.0	6.3	2.0

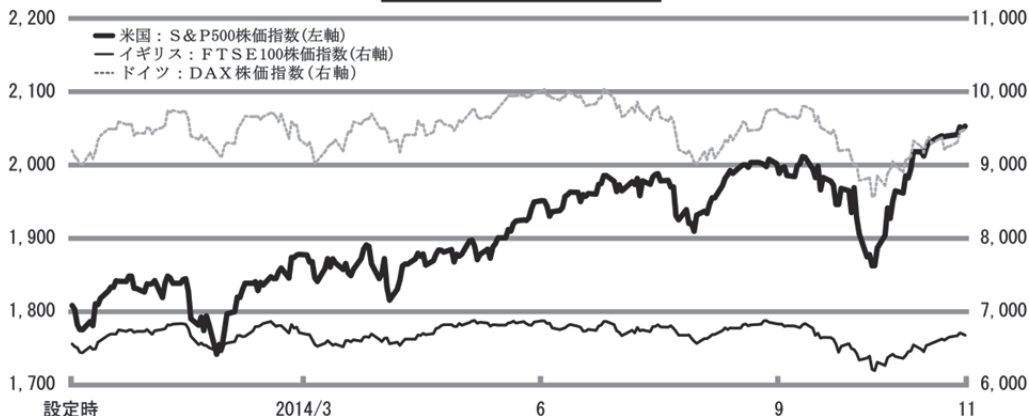
(注) 基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は設定日比です。

投資環境

(2013年12月10日から2014年11月20日まで)

海外株式市況

海外主要株価指数の推移



(注) 各指数は、ブルームバークのデータを使用しています。

当期末(2014年11月20日)の米国：S & P 500 株価指数は設定時と比べて+13.5%、イギリス：FTSE 100 株価指数は+1.8%、ドイツ：DAX 株価指数は+3.1%となりました。

当期の海外株式市場は、一時的な下落場面はあったものの、期を通じて見ると上昇しました。

期前半は、米国で発生した記録的な寒波により、消費の落ち込みが懸念されたことなどを受けて下落する場面もありましたが、良好な米経済指標や企業決算に支えられ、市場はおおむね上昇基調で推移しました。

その後、7月下旬から8月上旬にかけては、ウクライナ情勢の緊迫化に伴う地政学リスクの高まりにより、また9月下旬以降は、欧州を中心とした景気の先行き懸念や米国でのエボラウイルスの感染拡大懸念を背景として、株価は大きく下落しました。しかし、欧州中央銀行(ECB)による追加金融緩和に対する期待や堅調な米経済指標を受けて株価は上昇に転じ、当期末を迎えました。

運用経過

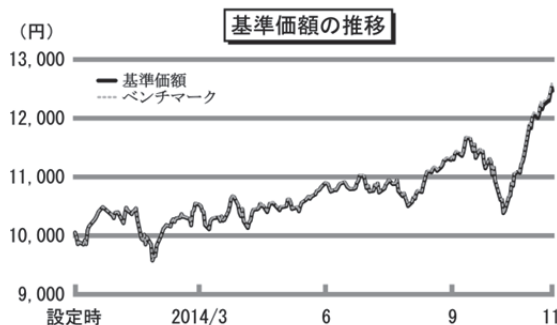
(2013年12月10日から2014年11月20日まで)

当ファンドは、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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目標に運用を行います。

当期も資金の流入などに対応して適宜売買を行い、ベンチマークとの連動性を維持するための調整を実施しました。

基準価額の推移

以上のような投資環境の結果、当期末の基準価額は12,526円(設定時比+2,526円)となりました。



(注) ベンチマークは、設定時の基準価額にあわせて再指数化したものです。

ベンチマークとの比較

当期の基準価額騰落率は+25.3%となり、信託報酬等の費用を控除した影響などからベンチマーク騰落率(+25.9%)を若干下回りました。

今後の運用方針

引き続き、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的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目標に運用を行います。

◆ 1万口(元本 10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	42 円 (18) (18) (5)
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 証 券)	1 (1) (0) (0) (0)
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0) (0)
(d) 保 管 費 用 等	8
合 計	53

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加、解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

$$(a) \text{ 信託報酬} = \frac{\text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \text{当期の日数}}{\text{年間の日数}}$$

$$(b) \text{ 売買委託手数料} = \frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$$

$$(c) \text{ 有価証券取引税} = \frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$$

$$(d) \text{ 保管費用等} = \frac{\text{期中の保管費用等}}{\text{期中の平均受益権口数}}$$

なお売買委託手数料、有価証券取引税および保管費用等は、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) 保管費用等には、監査費用が含まれています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◆ 親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2013年12月10日～2014年11月20日)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	千口 5,665,313	千円 6,739,226	千口 1,548,671	千円 1,882,206

(注) 単位未満は切り捨てています。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド

◆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	
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	16,991,376千円	
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	32,657,965千円	
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.52	

(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

(2013年12月10日～2014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

(2014年11月20日現在)

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	4,116,642 千口	5,755,890 千円

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は31,417,345千口です。

◆投資信託財産の構成

(2014年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5,755,890 千円	99.1 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	55,134	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	5,811,024	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118.21円、1カナダ・ドル104.20円、1オーストラリア・ドル101.78円、1香港・ドル15.24円、1シンガポール・ドル90.83円、1イギリス・ポンド185.29円、1イスラエル・シェケル30.75円、1スイス・フラン123.38円、1デンマーク・クローネ19.90円、1ノルウェー・クローネ17.38円、1スウェーデン・クローネ15.97円、1ユーロ148.14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(42,436,611千円)の投資信託財産総額(44,123,057千円)に対する比率は96.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2014年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,811,024,959円
コール・ローン等	7,199,962
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	5,755,890,126
未 収 入 金	47,934,871
(B) 負 債	55,201,857
未 払 解 約 金	47,605,043
未 払 信 託 報 酬	7,306,057
そ の 他 未 払 費 用	290,757
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	5,755,823,102
元 本	4,595,224,980
次 期 繰 越 損 益 金	1,160,598,122
(D) 受 益 権 総 口 数	4,595,224,980口
1万口当たり基準価額 (C/D)	12,526円

(注) 設定元本額 27,540,533円
 期中追加設定元本額 6,283,429,713円
 期中一部解約元本額 1,715,745,266円

◆損益の状況

当期 (2013年12月10日～2014年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	622円
受 取 利 息	622
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	813,770,660
売 買 益	912,952,797
売 買 損	△ 99,182,137
(C) 信 託 報 酬 等	△ 11,187,860
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	802,583,422
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金 *	358,014,700
(配 当 等 相 当 額)	(361)
(売 買 損 益 相 当 額)	(358,014,339)
(F) 合 計 (D+E)	1,160,598,122
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	1,160,598,122
追 加 信 託 差 損 益 金	358,014,700
(配 当 等 相 当 額)	(9,371,791)
(売 買 損 益 相 当 額)	(348,642,909)
分 配 準 備 積 立 金	802,583,422

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。設定時の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

◆分配金のお知らせ

※当頁の「-」表示は金額の発生がないことを示します。

当期の収益分配は見送らせていただきました。

(注) 分配金の計算過程は次の通りです。

計算期間末における信託報酬等控除後の配当等収益(59,362,536円)、信託報酬等控除後の有価証券売買等損益(743,220,886円)、追加信託差損益金(358,014,700円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は1,160,598,122円(1万口当たり2,525.66円)ですが、当期の収益分配は見送らせていただきました。

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

分配原資の内訳

(1万口当たり・税引前)

		第1期
当期分配金		-円
	当期の収益	-円
	当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額		2,525円

(注) 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。

◆お知らせ

2014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、委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に36.1%保有しています。

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

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14期

(計算期間：2014年5月21日～2014年11月20日)

●受益者の皆様へ

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCI KOKUSAI 指数(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界主要先進国の株式
組入制限	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

◆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
10期 (2012年11月20日)	6,832	13.5	6,757	13.3	98.1	1.7	—	10,103
11期 (2013年5月20日)	10,198	49.3	10,113	49.7	98.0	1.7	—	22,867
12期 (2013年11月20日)	10,799	5.9	10,689	5.7	96.2	1.7	1.7	23,323
13期 (2014年5月20日)	11,673	8.1	11,539	8.0	94.9	2.7	2.0	35,874
14期 (2014年11月20日)	13,982	19.8	13,847	20.0	92.0	6.3	2.0	43,928

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
(期首)	円	%		%	%	%	%
2014年5月20日	11,673	—	11,539	—	94.9	2.7	2.0
5月末	11,879	1.8	11,740	1.7	94.5	3.4	2.0
6月末	12,029	3.0	11,885	3.0	94.9	2.7	2.1
7月末	12,199	4.5	12,051	4.4	93.2	4.6	2.1
8月末	12,381	6.1	12,232	6.0	95.5	2.3	2.1
9月末	12,743	9.2	12,585	9.1	94.0	3.8	2.0
10月末	12,674	8.6	12,518	8.5	91.5	6.3	2.1
(期末)							
2014年11月20日	13,982	19.8	13,847	20.0	92.0	6.3	2.0

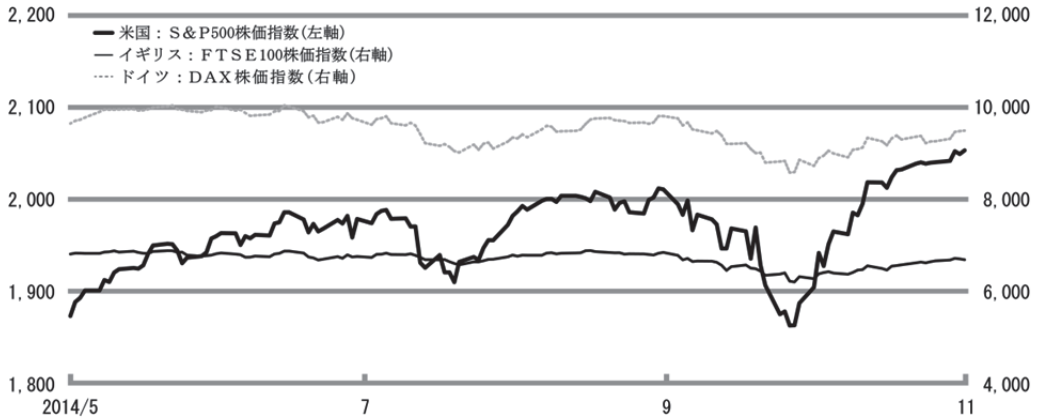
(注) 騰落率は期首比です。

投資環境

(2014年5月21日から2014年11月20日まで)

海外株式市況

海外主要株価指数の推移



(注) 各指数は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期末(2014年11月20日)の米国：S & P 500 株価指数は前期末(2014年5月20日)と比べて+9.6%、イギリス：FTSE 100 株価指数は-1.8%、ドイツ：DAX 株価指数は-1.6%となりました。

当期の海外株式市場は、期を通じて見ると米国が上昇する一方で、欧州は下落する展開となりました。

期前半は、欧州中央銀行(ECB)による追加金融緩和策の発表や米国の早期利上げシナリオの後退、加えて堅調な経済指標などが好感され、上昇基調でスタートしました。その後、ウクライナをめぐる地政学リスクの高まりに加え、ポルトガルの金融不安やアルゼンチンの債務問題悪化が投資家心理を冷やし、欧州市場を中心に上げ幅を縮めました。

期後半は、地政学リスクが後退したことや、米国ジャクソンホールで開催された経済シンポジウムにおいて、ドラギECB総裁が追加金融緩和の可能性を示唆したことを受けて、再び上昇基調をたどりました。10月前半は、ユーロ圏を中心とするグローバル景気の先行き不透明感や、エボラウィルス感染拡大懸念から大幅に下落しましたが、米国については低金利政策が長期間維持されるとの見方が高まったことや日銀の追加金融緩和が好感され、前期末より上昇して当期末を迎えました。一方、欧州については10月以降、ECBの追加緩和期待から株価は回復したものの、結局、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

運用経過

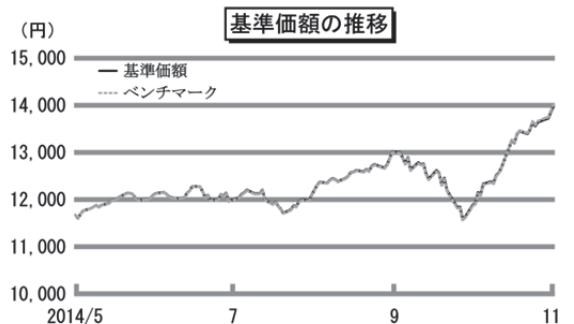
(2014年5月21日から2014年11月20日まで)

当マザーファンドは、日本を除く世界主要先進国の株式に投資を行うことにより、MSCI KOKUSAI指数(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

当期も資金の流入などに対応して適宜売買を行い、ベンチマークとの連動性を維持するための調整を実施しました。

基準価額の推移

以上のような投資環境の結果、当期末の基準価額は13,982円(前期末比+2,309円)となりました。



(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たものです。

ベンチマークとの比較

当期の基準価額騰落率は+19.8%となり、ベンチマーク騰落率(+20.0%)とほぼ同様の動きとなりました。

今後の運用方針

引き続き、MSCI KOKUSAI指数(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2014年5月21日～2014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 3,352 (933)	千米・ドル 15,522 (△ 17)	百株 3,413	千米・ドル 17,852
	カ ナ ダ	661 (19)	千カナダ・ドル 2,149	633	千カナダ・ドル 2,120
	オーストラリア	695 (20)	千オーストラリア・ドル 1,023	854	千オーストラリア・ドル 1,039
	香 港	1,920 (979)	千香港・ドル 4,825	1,833	千香港・ドル 4,578
	シンガポール	450 (51)	千シンガポール・ドル 130	411	千シンガポール・ドル 191
	イ ギ リ ス	3,689 (19,724)	千イギリス・ポンド 1,546 (△ 25)	30,584	千イギリス・ポンド 1,566
	イスラエル	382	千イスラエル・シェケル 834	40	千イスラエル・シェケル 421
	ス イ ス	85	千スイス・フラン 970 (△ 11)	133	千スイス・フラン 1,016
	デンマーク	72	千デンマーク・クローネ 2,329	47	千デンマーク・クローネ 981
	ノルウェー	258	千ノルウェー・クローネ 1,019	101	千ノルウェー・クローネ 961
	スウェーデン	146	千スウェーデン・クローネ 2,584	192	千スウェーデン・クローネ 2,624
	ユ ー ロ	アイルランド	881	千ユーロ 49	193
オランダ		178 (95)	357 (△ 78)	120	206

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
		ベルギー	20	118	13	89
		ルクセンブルグ	18	61	17	27
		フランス	520 (13)	1,065 (△ 14)	386	887
		ドイツ	236 (185)	847 (△ 11)	332	829
		ポルトガル	82	106	117	51
		スペイン	415 (5,456)	399 (65)	5,250	335
		イタリア	910 (△ 118)	329	414	186
		フィンランド	29	54	54	79
		オーストリア	47	133	302	179
そ の 他	0.70	3	1	9		

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

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

(2) 投資信託証券

			買 付		売 付		
			銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数
外 国	(アメリカ)	千口	千米・ドル	(アメリカ)	千口	千米・ドル	
	BOSTON PROPERTIES INC	0.011	1	BOSTON PROPERTIES INC	0.165	19	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	0.048	3	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	0.349	27	
	PROLOGIS INC	0.053	2	PROLOGIS INC	0.568	23	
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	—	—	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	2	27	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.033	4	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.096	14	
	EQUITY RESIDENTIAL	0.019	1	EQUITY RESIDENTIAL	0.212	13	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.897	162	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.097	18	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	132	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.054	6	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	0.389	9	GENERAL GROWTH PROPERTIES	0.466	11	
	HCP INC	—	—	HCP INC	0.591	24	
	HEALTH CARE REIT INC	0.049	3	HEALTH CARE REIT INC	0.309	20	

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		
	銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額
外	(アメリカ)	千口	千米・ドル	(アメリカ)	千口	千米・ドル
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	0.016	0.353	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1	34
	KIMCO REALTY CORP	0.430	9	KIMCO REALTY CORP	1	25
	MACERICH CO/THE	0.116	7	MACERICH CO/THE	0.334	21
	PLUM CREEK TIMBER CO	0.526	23	PLUM CREEK TIMBER CO	0.448	18
	PUBLIC STORAGE	0.063	10	PUBLIC STORAGE	0.120	20
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.109	18	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.182	30
	SL GREEN REALTY CORP	0.185	20	SL GREEN REALTY CORP	0.297	32
	UDR INC	3	116	UDR INC	0.198	5
	VENTAS INC	—	—	VENTAS INC	0.317	20
	VORNADO REALTY TRUST	0.029	3	VORNADO REALTY TRUST	0.204	21
	REALTY INCOME CORP	0.313	13	REALTY INCOME CORP	0.359	15
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.136	7	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.253	16
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	—	—	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	0.837	19
	AMERICAN TOWER REIT INC	0.251	23	AMERICAN TOWER REIT INC	0.239	23
	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	2	25	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	1	13
	WASHINGTON PRIME GROUP	—	—	WASHINGTON PRIME GROUP	1	32
		(1)				
	国	(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル	(オーストラリア)	
DEXUS PROPERTY GROUP		9 (△ 92)	10	DEXUS PROPERTY GROUP	14	17
GPT GROUP		38	152	GPT GROUP	5	22
GOODMAN GROUP		3	18	GOODMAN GROUP	3	18
STOCKLAND		6	24	STOCKLAND	3	13
WESTFIELD CORP		4	36	WESTFIELD CORP	1	12
MIRVAC GROUP		13	25	MIRVAC GROUP	10	19
WESTFIELD RETAIL TRUST		6 (△ 57)	19	WESTFIELD RETAIL TRUST	—	—
SCENTRE GROUP	— (88)	— (△ 16)	SCENTRE GROUP	13	47	
(香港)		千香港・ドル	(香港)		千香港・ドル	
LINK REIT	—	—	LINK REIT	6	305	
(イギリス)		千イギリス・ポンド	(イギリス)		千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC	1	12	BRITISH LAND CO PLC	1	12	
HAMMERSON PLC	11	71	HAMMERSON PLC	0.593	3	

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		
	銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額
外 国	(イギリス)	千口	千イリス・ポンド	(イギリス)	千口	千イリス・ポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	0.602	6	LAND SECURITIES GROUP PLC	0.843	8
	(ユーロ/フランス)		千ユーロ	(ユーロ/フランス)		千ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO SE	0.001	0.205	UNIBAIL-RODAMCO SE	0.108	22

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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3) 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	百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引	5,490	4,079	—	—

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 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3) 単位未満は切り捨てています。

◆主要な売買銘柄

(2014年5月21日～2014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
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.004	24,232	6,058,204	APPLE INC	3	47,343	12,564
BANK HAPOALIM BM	37	22,999	605	EXXON MOBIL CORP	3	34,319	10,530
TWITTER INC	4	20,274	4,986	MICROSOFT CORP	5	28,217	4,983
HENKEL KGAA-VORZUG	1	19,196	11,089	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	1	22,445	19,863
EXXON MOBIL CORP	1	19,000	10,326	GENERAL ELECTRIC CO	7	20,157	2,827
FACEBOOK INC-A	2	18,798	7,549	JOHNSON & JOHNSON	1	19,473	11,441
DEUTSCHE BANK AG	4	17,363	3,646	NESTLE SA	2	18,067	8,182
JOHNSON & JOHNSON	1	16,881	10,677	WELLS FARGO & CO	3	17,876	5,614
GOOGLE INC-CL C	0.284	16,517	58,160	CHEVRON CORP	1	17,838	13,391
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2	15,519	5,426	PROCTER & GAMBLE CO	1	17,713	8,959

(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

(2014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	69	68	1,084	128,216	資本財
ABBOTT LABORATORIES	177	169	737	87,121	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	183	181	1,186	140,314	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	73	71	600	70,979	ソフトウェア・サービス
ACE LTD	38	37	418	49,444	保険
ACTAVIS PLC	20	29	790	93,433	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACTIVISION BLIZZARD INC	56	58	114	13,563	ソフトウェア・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	56	53	377	44,637	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	—	24	86	10,256	商業・専門サービス
ADVANCE AUTO PARTS	9	9	130	15,450	小売
AES CORP	96	90	126	14,914	公益事業
AETNA INC	43	40	346	40,997	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	9	7	149	17,690	各種金融
AFLAC INC	53	51	303	35,856	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	43	40	164	19,499	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25	24	347	41,064	素材
AIRGAS INC	10	10	124	14,681	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	23	22	139	16,520	ソフトウェア・サービス
ALCOA INC	160	138	230	27,250	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	23	22	434	51,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	—	2	128	15,156	保険
ALLERGAN INC	35	33	719	85,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6	6	185	21,959	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	19	18	116	13,804	公益事業
ALLSTATE CORP	51	48	323	38,234	保険
ALLY FINANCIAL INC	—	38	89	10,544	各種金融
ALTERA CORP	41	40	144	17,107	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	223	222	1,091	129,020	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	42	44	1,453	171,809	小売
AMEREN CORPORATION	31	32	138	16,423	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	—	22	97	11,468	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	53	54	310	36,666	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	108	106	964	114,040	各種金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	159	151	818	96,788	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	25	25	133	15,723	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	25	23	300	35,547	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	26	26	235	27,811	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	—	36	127	15,114	各種金融
AMETEK INC	35	34	176	20,841	資本財
AMGEN INC	85	85	1,389	164,206	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	21	39	201	23,878	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	
ANADARKO PETROLEUM CORP	61	57	520	61,521	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	41	38	197	23,312	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	14	13	105	12,502	ソフトウェア・サービス
AON PLC	32	31	283	33,518	保険
APACHE CORP	49	44	320	37,934	エネルギー
APPLE INC	104	687	7,882	931,807	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	148	140	316	37,435	半導体・半導体製造装置
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18	20	116	13,821	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	79	75	393	46,500	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	—	15	89	10,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASHLAND INC	11	10	119	14,165	素材
AT&T INC	599	585	2,071	244,848	電気通信サービス
AUTODESK INC	27	27	161	19,065	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	15	13	135	16,008	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	56	54	459	54,350	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	4	3	226	26,814	小売
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	31	28	257	30,405	半導体・半導体製造装置
AVNET INC	—	21	94	11,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVON PRODUCTS INC	—	63	59	7,086	家庭用品・パーソナル用品
BAKER HUGHES INC	54	51	326	38,581	エネルギー
BALL CORP	21	17	111	13,228	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,234	1,187	2,025	239,458	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	139	129	516	61,108	各種金融
BARD (C.R.) INC	10	9	163	19,288	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	63	61	446	52,797	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	83	84	315	37,342	銀行
BE AEROSPACE INC	14	13	103	12,186	資本財
BECTON DICKINSON & CO	24	23	303	35,851	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	27	25	184	21,772	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	121	124	1,807	213,649	各種金融
BEST BUY CO INC	—	35	124	14,712	小売
BIOGEN IDEC INC	27	26	817	96,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16	18	153	18,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	15	15	536	63,461	各種金融
BOEING CO	80	77	1,023	120,960	資本財
BORGWARNER INC	31	28	164	19,503	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	168	157	205	24,337	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	187	187	1,105	130,682	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM CORP	68	62	260	30,810	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP -CL B	15	15	144	17,028	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	21	20	181	21,482	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21	18	135	15,995	運輸
CA Inc	42	46	140	16,614	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	50	50	171	20,312	エネルギー
CALPINE CORP	—	47	110	13,035	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	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	31	25	146	17,344	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	27	27	121	14,366	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	68	65	526	62,208	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	39	39	311	36,841	ヘルスケア機器・サービス
CAREFUSION CORP	31	28	163	19,275	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	31	28	154	18,311	小売
CARNIVAL CORP	49	48	199	23,608	消費者サービス
CATERPILLAR INC	74	66	675	79,871	資本財
CBRE GROUP INC	42	40	131	15,577	不動産
CBS CORP-CL B	69	58	309	36,596	メディア
CELANESE CORP-SERIES A	23	21	128	15,162	素材
CELGENE CORP	47	90	970	114,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	52	53	130	15,369	公益事業
CENTURYLINK INC	78	68	283	33,524	電気通信サービス
CERNER CORP	37	36	233	27,631	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7	6	175	20,741	素材
CHARLES SCHWAB CORP	140	136	388	45,958	各種金融
CHARTER COMMUNICATION-A	8	9	145	17,214	メディア
CHENIERE ENERGY INC	24	26	191	22,654	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	67	64	149	17,631	エネルギー
CHEVRON CORP	218	213	2,490	294,426	エネルギー
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	14	14	78	9,311	資本財
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3	3	235	27,791	消費者サービス
CHUBB CORP	28	28	287	33,953	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	19	18	142	16,802	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	32	30	314	37,232	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	11	10	122	14,431	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24	25	129	15,288	保険
CISCO SYSTEMS INC	624	577	1,536	181,576	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	29	27	132	15,717	銀行
CITIGROUP INC	352	343	1,842	217,849	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	24	19	128	15,193	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	18	16	166	19,720	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	36	36	309	36,613	各種金融
CMS ENERGY CORP	38	37	123	14,583	公益事業
COACH INC	35	35	124	14,759	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA CO	443	438	1,941	229,470	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	35	31	137	16,223	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	72	70	369	43,638	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	102	100	685	81,032	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	248	247	1,346	159,170	メディア
COMCAST CORP	46	44	240	28,453	メディア
COMERICA INC	27	25	123	14,566	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	18	18	114	13,546	ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	61	52	188	22,234	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
CONCHO RESOURCES INC	14	13	155	18,404	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	128	135	978	115,653	エネルギー
CONSOL ENERGY INC	29	29	118	14,005	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	33	34	217	25,652	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19	19	186	22,004	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	—	12	63	7,535	エネルギー
CORE LABORATORIES N.V.	5	6	87	10,351	エネルギー
CORNING INC	175	151	310	36,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	49	48	684	80,965	食品・生活必需品小売り
COVIDIEN PLC	53	51	501	59,321	ヘルスケア機器・サービス
CREE INC	—	15	55	6,571	半導体・半導体製造装置
CROWN HOLDINGS INC	26	21	102	12,146	素材
CSX CORP	124	118	436	51,542	運輸
CUMMINS INC	22	20	296	35,076	資本財
CVS HEALTH CORP	130	128	1,155	136,595	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	65	69	577	68,265	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	20	20	116	13,745	消費者サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	23	20	157	18,630	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	43	39	340	40,218	資本財
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	34	34	244	28,929	自動車・自動車部品
DELTA AIR LINES INC	—	27	121	14,360	運輸
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	26	23	123	14,603	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	48	45	295	34,968	エネルギー
DIRECTV	60	57	504	59,638	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	57	54	349	41,367	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	29	17	58	6,867	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	—	36	119	14,087	メディア
DISH NETWORK CORP	26	25	189	22,355	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	37	36	242	28,691	小売
DOLLAR TREE INC	26	26	162	19,249	小売
DOMINION RESOURCES INC/VA	60	63	461	54,519	公益事業
DOVER CORP	23	20	168	19,954	資本財
DOW CHEMICAL CO	141	135	696	82,281	素材
DR HORTON INC	—	39	98	11,657	耐久消費財・アパレル
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	30	25	180	21,296	食品・飲料・タバコ
DTE ENERGY COMPANY	20	21	173	20,505	公益事業
DUKE ENERGY CORP	73	76	616	72,849	公益事業
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	21	19	165	19,595	素材
EATON CORP PLC	56	55	373	44,206	資本財
EBAY INC	137	132	726	85,863	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	30	30	344	40,686	素材
EDISON INTERNATIONAL	37	35	222	26,285	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14	12	161	19,091	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	105	102	732	86,641	素材
ELECTRONIC ARTS INC	40	36	160	18,940	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	
ELI LILLY & CO	116	113	761	90,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMC CORP/MASSACHUSETTS	241	230	689	81,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMERSON ELECTRIC CO	79	79	508	60,119	資本財
ENDO INTERNATIONAL PLC	—	17	118	14,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENERGIZER HOLDINGS INC	—	7	97	11,531	家庭用品・パーソナル用品
ENSCO PLC	36	33	128	15,141	エネルギー
ENTERGY CORP	22	20	174	20,609	公益事業
EOG RESOURCES INC	64	61	605	71,612	エネルギー
EQT CORP	19	18	177	20,980	エネルギー
EQUIFAX INC	18	17	134	15,855	商業・専門サービス
EQUINIX INC	7	6	150	17,767	ソフトウェア・サービス
ESTEE LAUDER COS INC	31	26	195	23,135	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	—	6	109	12,885	保険
EXELON CORP	100	95	345	40,893	公益事業
EXPEDIA INC	12	12	108	12,830	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	31	28	126	14,975	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	92	87	696	82,302	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	500	486	4,651	549,856	エネルギー
F5 NETWORKS INC	10	9	121	14,402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	214	227	1,666	196,944	ソフトウェア・サービス
FAMILY DOLLAR STORES	15	13	106	12,574	小売
FASTENAL CO	38	35	157	18,617	資本財
FEDEX CORP	34	32	550	65,124	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	38	35	212	25,142	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	107	102	205	24,318	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	—	20	104	12,294	銀行
FIRSTENERGY CORP	56	51	192	22,715	公益事業
FISERV INC	34	30	213	25,277	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8	8	134	15,850	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	—	79	87	10,308	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	19	18	122	14,491	資本財
FLUOR CORP	22	21	142	16,889	資本財
FMC CORP	19	19	110	13,100	素材
FMC TECHNOLOGIES INC	35	30	166	19,624	エネルギー
FORD MOTOR CO	429	414	639	75,574	自動車・自動車部品
FOREST LABORATORIES INC	30	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FRANKLIN RESOURCES INC	52	50	284	33,587	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	127	121	340	40,290	素材
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	—	141	99	11,733	電気通信サービス
GAP INC	31	30	119	14,180	小売
GARMIN LTD	—	14	83	9,872	耐久消費財・アパレル
GENERAL DYNAMICS CORP	34	32	461	54,537	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,151	1,132	3,047	360,283	資本財
GENERAL MILLS INC	70	69	358	42,434	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	141	146	469	55,524	自動車・自動車部品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円・ドル	千円	
GENUINE PARTS CO	22	20	206	24,388	小売
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	—	67	61	7,314	保険
GILEAD SCIENCES INC	175	174	1,783	210,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	49	48	916	108,287	各種金融
GOOGLE INC-CL A	32	31	1,740	205,696	ソフトウェア・サービス
GOOGLE INC-CL C	32	33	1,777	210,110	ソフトウェア・サービス
H&R BLOCK INC	35	35	114	13,521	消費者サービス
HALLIBURTON CO	101	96	466	55,136	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	28	27	187	22,176	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	17	17	121	14,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	62	56	228	27,047	保険
HCA HOLDINGS INC	38	34	234	27,681	ヘルスケア機器・サービス
HELMERICH & PAYNE	15	13	108	12,783	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	13	11	157	18,613	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	17	18	174	20,628	食品・飲料・タバコ
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	58	54	121	14,407	運輸
HESS CORP	37	32	265	31,333	エネルギー
HEWLETT-PACKARD CO	224	215	799	94,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	36	94	11,131	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	24	23	103	12,264	エネルギー
HOME DEPOT INC	160	154	1,491	176,321	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	82	82	795	94,075	資本財
HORMEL FOODS CORP	—	20	112	13,326	食品・飲料・タバコ
HOSPIRA INC	25	21	129	15,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUMANA INC	19	17	244	28,927	ヘルスケア機器・サービス
IHS INC-CLASS A	9	9	121	14,374	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	48	44	423	50,012	資本財
ILLUMINA INC	14	14	277	32,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	37	33	211	24,962	資本財
INTEL CORP	564	562	1,931	228,294	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	13	13	300	35,484	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	118	108	1,755	207,542	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	—	12	118	13,989	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	52	47	257	30,494	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	70	60	120	14,266	メディア
INTUIT INC	32	31	283	33,554	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	4	4	228	27,047	ヘルスケア機器・サービス
INVECO LTD	63	54	215	25,417	各種金融
IRON MOUNTAIN INC	—	24	90	10,755	不動産
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21	20	96	11,359	資本財
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	14	13	110	13,051	運輸
JM SMUCKER CO	15	14	143	16,932	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	320	319	3,472	410,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	79	77	386	45,695	自動車・自動車部品
JOY GLOBAL INC	—	14	76	8,986	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	
JPMORGAN CHASE & CO	432	425	2,578	304,779	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	66	55	119	14,101	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	15	14	178	21,127	運輸
KELLOGG CO	31	31	210	24,900	食品・飲料・タバコ
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	14	13	215	25,441	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	125	114	151	17,966	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	42	41	470	55,577	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	80	78	320	37,888	エネルギー
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	17	14	149	17,647	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	23	20	167	19,851	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	28	26	150	17,831	小売
KRAFT FOODS GROUP INC	72	68	402	47,574	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	64	55	322	38,075	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	32	30	239	28,254	小売
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	12	12	146	17,285	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	14	11	116	13,794	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	23	19	155	18,366	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	48	46	293	34,748	消費者サービス
LENNAR CORP-CL A	—	23	108	12,860	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	50	52	126	14,931	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	—	23	114	13,555	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	44	25	116	13,819	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	42	80	362	42,900	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP	68	59	166	19,728	小売
LIBERTY MEDIA CORP	14	14	51	6,118	メディア
LIBERTY MEDIA CORP - C	—	26	95	11,259	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	37	32	183	21,746	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	33	31	137	16,285	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	11	12	276	32,735	ソフトウェア・サービス
LKQ CORP	40	40	117	13,868	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	29	29	554	65,543	資本財
LOEWS CORP	45	46	196	23,281	保険
LORILLARD INC	44	42	264	31,293	食品・飲料・タバコ
LOWE'S COS INC	122	115	720	85,145	小売
LYONDELLBASELL INDU-CL A	54	49	446	52,725	素材
M&T BANK CORP	14	14	180	21,375	銀行
MACY'S INC	47	42	262	31,016	小売
MALLINCKRODT PLC	—	13	117	13,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANPOWER GROUP	—	12	83	9,830	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	89	80	263	31,102	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	35	33	314	37,134	エネルギー
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	35	28	215	25,425	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	60	59	334	39,488	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	6	87	10,319	素材
MASCO CORP	52	49	116	13,717	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	
	百株	百株	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
MASTERCARD INC-CLASS A	118	114	964	114,063	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	44	42	133	15,748	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	41	37	107	12,682	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18	17	128	15,137	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	110	108	1,047	123,788	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	30	31	288	34,086	各種金融
MCKESSON CORP	25	25	531	62,811	ヘルスケア機器・サービス
MDU RESOURCES GROUP INC	29	—	—	—	公益事業
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	25	23	245	29,046	食品・飲料・タバコ
MEADWESTVACO CORP	28	22	100	11,848	素材
MEDTRONIC INC	112	110	795	94,073	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO INC	329	328	1,958	231,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	112	107	591	69,967	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	4	124	14,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	51	49	110	13,057	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	23	22	161	19,052	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27	27	116	13,787	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	124	120	398	47,124	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	916	891	4,298	508,179	ソフトウェア・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	8	8	120	14,217	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	22	18	141	16,685	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	186	188	738	87,254	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	58	58	695	82,198	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	16	17	188	22,282	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	24	23	232	27,494	各種金融
MORGAN STANLEY	175	170	603	71,320	各種金融
MOSAIC CO/THE	39	38	184	21,815	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	32	29	194	23,049	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP	24	23	120	14,251	エネルギー
MYLAN LABORATORIES	47	43	241	28,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NABORS INDUSTRIES LTD	—	35	56	6,709	エネルギー
NATIONAL-OILWELL INC	52	49	356	42,161	エネルギー
NAVIENT CORP	64	59	124	14,676	各種金融
NETAPP INC	40	40	167	19,838	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	6	6	234	27,770	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	81	78	123	14,608	銀行
NEWELL RUBBERMAID INC	42	37	135	15,965	耐久消費財・アパレル
NEWMONT MINING CORP	79	60	115	13,637	素材
NEWS CORP - CLASS A	—	54	82	9,786	メディア
NEXTERA ENERGY INC	44	46	485	57,386	公益事業
NIELSEN NV	31	36	153	18,151	商業・専門サービス
NIKE INC	79	77	747	88,325	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	36	38	159	18,816	公益事業
NOBLE CORP PLC	42	41	84	9,969	エネルギー
NOBLE ENERGY INC	46	43	236	27,956	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	
NORDSTROM INC	27	19	140	16,612	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	37	36	415	49,133	運輸
NORTHEAST UTILITIES	36	38	193	22,911	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	32	28	192	22,809	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	23	23	322	38,093	資本財
NRG ENERGY INC	41	41	130	15,369	公益事業
NUCOR CORP	42	39	214	25,355	素材
NVIDIA CORP	76	70	141	16,784	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	93	88	762	90,174	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	19	17	120	14,284	エネルギー
OGE ENERGY CORP	28	27	102	12,118	公益事業
OMNICOM GROUP	36	34	254	30,117	メディア
ONEOK INC	22	24	141	16,700	エネルギー
ORACLE CORP	419	403	1,652	195,338	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	13	12	220	26,013	小売
PACCAR INC	47	42	283	33,468	資本財
PALL CORP	17	17	163	19,288	資本財
PARKER HANNIFIN CORP	19	18	244	28,843	資本財
PAYCHEX INC	42	41	198	23,454	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	25	25	173	20,501	資本財
PEPCO HOLDINGS INC	—	32	89	10,562	公益事業
PEPSICO INC	168	167	1,648	194,865	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	15	15	252	29,848	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETSMART INC	—	12	96	11,424	小売
PFIZER INC	733	718	2,186	258,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	51	51	259	30,732	公益事業
PHARMACYCLICS INC	7	7	106	12,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	183	177	1,543	182,404	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	65	64	486	57,520	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	19	17	110	13,106	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17	16	279	33,011	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	60	59	521	61,621	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	9	8	128	15,174	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	16	16	337	39,942	素材
PPL CORPORATION	70	70	248	29,397	公益事業
PRAXAIR INC	33	33	424	50,169	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	16	16	389	46,085	資本財
PRICELINE GROUP INC/THE	5	5	684	80,942	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43	43	232	27,497	保険
PROCTER & GAMBLE CO	306	301	2,676	316,362	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	70	70	191	22,637	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	55	52	443	52,432	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56	56	228	27,068	公益事業
PULTE GROUP INC	—	46	98	11,624	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	10	10	130	15,377	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	
QEP RESOURCES INC-W/I	—	25	60	7,157	エネルギー
QUALCOMM INC	193	189	1,333	157,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA SERVICES INC	—	30	100	11,938	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	22	19	120	14,295	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	8	7	143	16,926	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	19	20	149	17,664	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	22	21	118	14,047	各種金融
RAYTHEON CO	35	35	370	43,785	資本財
REALOGY HOLDINGS CORP	21	22	97	11,476	不動産
RED HAT INC	24	24	151	17,938	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	9	9	377	44,668	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	193	177	179	21,169	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	42	38	152	17,978	商業・専門サービス
RESMED INC	—	18	97	11,566	ヘルスケア機器・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	39	37	245	29,007	食品・飲料・タバコ
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	—	19	110	13,070	商業・専門サービス
ROCK TENN COMPANY -CL A	9	18	105	12,522	素材
ROCKWELL AUTOMATION INC	18	17	190	22,508	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	17	17	145	17,197	資本財
ROPER INDUSTRIES INC	13	12	200	23,671	資本財
ROSS STORES INC	28	26	219	25,892	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23	21	148	17,532	消費者サービス
SAFEWAY INC	30	32	111	13,227	食品・生活必需品小売り
SALESFORCE.COM INC	67	67	412	48,724	ソフトウェア・サービス
SANDISK CORP	29	25	254	30,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP	15	15	179	21,263	電気通信サービス
SCANA CORP	23	22	124	14,741	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	150	146	1,393	164,765	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	12	12	90	10,744	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	39	37	245	28,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	—	27	104	12,305	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	30	—	—	—	各種金融
SEMPRA ENERGY	24	25	278	32,930	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	23	111	13,155	資本財
SERVICENOW INC	15	16	102	12,074	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10	9	238	28,186	素材
SIGMA-ALDRICH	15	15	205	24,255	素材
SIRIUS XM HOLDINGS INC	402	402	141	16,749	メディア
SOUTHERN CO	93	95	453	53,625	公益事業
SOUTHWESTERN ENERGY CO	45	43	145	17,251	エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	79	77	299	35,444	エネルギー
SPRINT CORP	110	—	—	—	電気通信サービス
ST JUDE MEDICAL INC	36	33	216	25,536	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	19	18	176	20,805	資本財
STAPLES INC	90	88	123	14,546	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	
STARBUCKS CORP	86	84	657	77,695	消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	27	24	186	22,044	消費者サービス
STATE STREET CORP	53	51	387	45,862	各種金融
STERICYCLE INC	12	11	151	17,932	商業・専門サービス
STRYKER CORP	37	39	357	42,247	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	69	64	255	30,218	銀行
SYMANTEC CORP	91	81	206	24,419	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	73	68	267	31,613	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	34	32	265	31,413	各種金融
TARGET CORP	72	69	504	59,657	小売
TE CONNECTIVITY LTD	51	47	291	34,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TERADATA CORP	23	21	96	11,404	ソフトウェア・サービス
TESLA MOTORS INC	9	9	240	28,406	自動車・自動車部品
TESORO CORP	—	16	120	14,288	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	125	121	633	74,850	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	39	37	160	18,930	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42	45	565	66,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	17	16	169	19,980	小売
TIME WARNER CABLE	33	32	465	55,053	メディア
TIME WARNER INC	105	101	817	96,652	メディア
TJX COS INC	82	81	507	60,047	小売
T-MOBILE US INC	—	30	84	9,977	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	—	25	84	10,027	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	15	20	110	13,109	保険
TOWERS WATSON & CO-CL A	8	9	111	13,159	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	17	18	141	16,676	小売
TRANSDIGM GROUP INC	6	6	126	14,953	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	40	37	389	46,086	保険
TRIMBLE NAVIGATION LTD	34	33	95	11,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	13	13	96	11,436	小売
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	16	13	140	16,576	自動車・自動車部品
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	67	61	205	24,291	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	155	152	535	63,245	メディア
TWITTER INC	—	38	153	18,119	ソフトウェア・サービス
TYCO INTERNATIONAL PLC	60	53	223	26,449	商業・専門サービス
TYSON FOODS INC-CL A	32	35	154	18,273	食品・飲料・タバコ
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	—	7	99	11,763	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	19	18	133	15,754	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	51	100	1,208	142,884	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	76	77	823	97,329	運輸
UNITED RENTALS INC	—	12	137	16,227	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	96	96	1,051	124,272	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	113	109	1,061	125,432	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	14	11	118	13,954	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	41	37	127	15,057	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
US BANCORP	198	198	873	103,214	銀行	
VALERO ENERGY CORP	63	61	309	36,590	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15	14	125	14,880	ヘルスケア機器・サービス	
VERISIGN INC	20	18	111	13,160	ソフトウェア・サービス	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	21	21	132	15,612	商業・専門サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	474	468	2,365	279,620	電気通信サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28	27	309	36,628	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VF CORP	42	39	285	33,738	耐久消費財・アパレル	
VIACOM INC-CLASS B	47	44	326	38,600	メディア	
VISA INC-CLASS A SHARES	57	56	1,400	165,519	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	—	9	79	9,391	ソフトウェア・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	18	17	118	14,022	素材	
WALGREEN CO	103	101	686	81,184	食品・生活必需品小売り	
WAL-MART STORES INC	177	178	1,517	179,433	食品・生活必需品小売り	
WALT DISNEY CO	190	185	1,670	197,455	メディア	
WASTE MANAGEMENT INC	58	54	264	31,209	商業・専門サービス	
WATERS CORP	12	11	132	15,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	116	93	149	17,632	エネルギー	
WELLPOINT INC	35	31	396	46,910	ヘルスケア機器・サービス	
WELLS FARGO & CO	563	560	2,988	353,312	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	25	25	254	30,103	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	73	68	124	14,719	ソフトウェア・サービス	
WEYERHAEUSER CO	77	64	220	26,031	不動産	
WHIRLPOOL CORP	9	9	172	20,435	耐久消費財・アパレル	
WHITING PETROLEUM CORP	18	15	84	9,933	エネルギー	
WHOLE FOODS MARKET INC	43	45	215	25,484	食品・生活必需品小売り	
WILLIAMS COS INC	81	79	439	51,959	エネルギー	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	26	26	112	13,250	保険	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	—	87	86	10,187	電気通信サービス	
WISCONSIN ENERGY CORP	26	28	139	16,539	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	10	11	104	12,314	ソフトウェア・サービス	
WW GRAINGER INC	7	7	192	22,731	資本財	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	18	17	138	16,365	消費者サービス	
WYNN RESORTS LTD	10	9	170	20,109	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	56	59	199	23,547	公益事業	
XEROX CORP	158	135	182	21,538	ソフトウェア・サービス	
XILINX INC	35	33	150	17,733	半導体・半導体製造装置	
XL GROUP PLC	47	39	139	16,480	保険	
XYLEM INC	26	25	95	11,286	資本財	
YAHOO! INC	112	111	564	66,774	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	52	50	376	44,559	消費者サービス	
ZIMMER HOLDINGS INC	23	20	221	26,227	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	68	62	270	32,013	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	34,515	35,387	213,506	25,238,580	
	銘 柄 数 <比 率>	481	530	—	<57.5%>	

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	
AGNICO EAGLE MINES LTD	—	26	77	8,029	素材
AGRIUM INC	21	19	223	23,239	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	51	52	218	22,796	食品・生活必需品小売り
ARC RESOURCES LTD	46	47	134	13,998	エネルギー
BANK OF MONTREAL	73	72	595	62,026	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	135	134	936	97,620	銀行
BARRICK GOLD CORP	152	139	196	20,488	素材
BAYTEX ENERGY CORP	—	27	82	8,583	エネルギー
BCE INC	38	35	194	20,217	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	75	69	394	41,086	不動産
CAMECO CORP	61	56	122	12,725	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	45	44	461	48,105	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	100	94	766	79,878	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	135	127	517	53,907	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	97	75	128	13,419	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21	20	471	49,164	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	14	11	151	15,763	小売
CATAMARAN CORP	26	27	155	16,166	ヘルスケア機器・サービス
CENOVUS ENERGY INC	112	94	260	27,135	エネルギー
CGI GROUP INC	30	29	123	12,884	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	—	37	127	13,292	各種金融
CRESCENT POINT ENERGY CORP	59	53	188	19,645	エネルギー
ELDORADO GOLD CORP	—	104	73	7,655	素材
ENBRIDGE INC	97	97	511	53,298	エネルギー
ENCANA CORP	106	95	192	20,077	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	—	2	166	17,344	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	88	76	135	14,132	素材
FORTIS INC	56	43	168	17,533	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	23	20	123	12,832	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	—	17	113	11,831	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	112	96	219	22,829	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	41	41	138	14,399	保険
HUSKY ENERGY INC	48	47	127	13,314	エネルギー
IMPERIAL OIL LTD	44	37	201	21,042	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	22	20	163	17,008	保険
INTER PIPELINE LTD	47	43	152	15,919	エネルギー
KEYERA CORP	—	13	124	13,016	エネルギー
LOBLAW COS LTD	13	28	175	18,239	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	29	25	300	31,309	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	230	215	472	49,241	保険
METHANEX CORP	—	14	93	9,754	素材
NATIONAL BANK OF CANADA	48	43	235	24,523	銀行
ONEX CORPORATION	22	18	120	12,528	各種金融
OPEN TEXT CORP	—	17	112	11,708	ソフトウェア・サービス
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	—	43	61	6,370	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
PEMBINA PIPELINE CORP	48	41	181	18,874	エネルギー	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	108	99	403	42,040	素材	
POWER CORP OF CANADA	69	59	187	19,557	保険	
POWER FINANCIAL CORP	—	39	137	14,308	保険	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	50	47	217	22,708	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	161	159	1,318	137,390	銀行	
SAPUTO INC	25	38	125	13,080	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	79	65	201	20,976	メディア	
SILVER WHEATON CORP	65	49	116	12,107	素材	
SNC-LAVALIN GROUP INC	23	21	93	9,731	資本財	
SUN LIFE FINANCIAL INC	82	73	306	31,899	保険	
SUNCOR ENERGY INC	183	168	654	68,147	エネルギー	
TALISMAN ENERGY INC	148	146	95	9,978	エネルギー	
TECK RESOURCES LTD-CL B	92	78	140	14,656	素材	
THOMSON REUTERS CORP	58	51	222	23,199	メディア	
TIM HORTONS INC	28	21	195	20,421	消費者サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	204	203	1,157	120,610	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	23	24	101	10,621	エネルギー	
TRANSCANADA CORP	89	83	482	50,238	エネルギー	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	37	37	598	62,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERMILION ENERGY INC	19	17	102	10,717	エネルギー	
YAMANA GOLD INC	137	125	56	5,862	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,070	4,117	17,807	1,855,592	
	銘柄 数 <比率>	56	67	—	<4.2%>	
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル			
AGL ENERGY LTD	89	112	150	15,328	公益事業	
AMCOR LTD	180	180	218	22,250	素材	
AMP LTD	470	400	228	23,245	保険	
ASCIANO LTD	238	211	128	13,059	運輸	
ASX LTD	49	48	173	17,632	各種金融	
AURIZON HOLDINGS LTD	364	379	181	18,468	運輸	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	322	319	1,016	103,441	銀行	
BHP BILLITON LTD	384	376	1,229	125,148	素材	
BRAMBLES LTD	248	237	231	23,555	商業・専門サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	116	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	185	186	1,501	152,831	銀行	
CROWN RESORTS LTD	77	75	106	10,851	消費者サービス	
CSL LIMITED	57	57	447	45,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	202	222	60	6,200	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	350	340	216	22,061	保険	
MACQUARIE GROUP LTD	42	39	234	23,884	各種金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	274	276	888	90,401	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	118	106	105	10,728	素材	
ORICA LTD	57	61	112	11,491	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED	167	160	212	21,643	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 千円		邦貨換算金額
(オーストラリア)	百株	百株	千円			
QBE INSURANCE GROUP LTD	160	159	175	17,868	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	—	23	122	12,428	ヘルスケア機器・サービス	
RIO TINTO LTD	59	57	331	33,778	素材	
SANTOS LTD	152	143	166	16,984	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	—	72	132	13,502	ヘルスケア機器・サービス	
SUNCORP GROUP LTD	192	176	257	26,240	保険	
TELSTRA CORP LTD	567	567	326	33,233	電気通信サービス	
WESFARMERS LIMITED	140	139	597	60,765	食品・生活必需品小売り	
WESTPAC BANKING CORP	361	359	1,178	119,938	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	87	93	360	36,708	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD	156	153	494	50,288	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,876 29	5,738 30	11,588 —	1,179,501 < 2.7% >	
(香港)			千香港・ドル			
AIA GROUP LTD	1,444	1,400	6,170	94,035	保険	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	623	565	1,518	23,135	銀行	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	203	174	2,393	36,476	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	305	276	1,841	28,057	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	257	278	1,422	21,678	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	481	391	882	13,456	不動産	
HANG SENG BANK LTD	113	119	1,536	23,418	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	—	177	912	13,908	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	920	888	1,618	24,661	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	178	136	2,286	34,848	各種金融	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	279	265	2,610	39,778	資本財	
LI & FUNG LTD	915	792	702	10,704	耐久消費財・アパレル	
MTR CORP	—	347	1,086	16,552	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	876	832	12,692	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	223	190	1,390	21,191	公益事業	
SANDS CHINA LTD	303	293	1,329	20,260	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	227	210	2,365	36,043	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	142	108	1,126	17,172	不動産	
WHARF HOLDINGS LTD	251	217	1,195	18,216	不動産	
WYNN MACAU LTD	—	229	616	9,389	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	6,872 16	7,939 20	33,837 —	515,678 < 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
CAPITALAND LTD	720	610	197	17,896	不動産	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	240	230	453	41,196	銀行	
GENTING SINGAPORE PLC	1,270	1,440	156	14,256	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	570	640	163	14,881	不動産	
KEPPEL CORP LTD	306	286	265	24,081	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	390	420	441	40,056	銀行	
SINGAPORE AIRLINES LTD	240	220	228	20,741	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
(シンガポール)	百株	百株	千円	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,130	1,120	440	39,979	電気通信サービス	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	190	180	420	38,208	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,056	5,146	2,766	251,298	
(イギリス)			—	<0.6%>		
			千イギリス・ポンド			
3I GROUP PLC	168	159	67	12,440	各種金融	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	—	127	56	10,475	各種金融	
AGGREKO PLC	39	35	55	10,307	商業・専門サービス	
ANGLO AMERICAN PLC	177	163	216	40,141	素材	
ARM HOLDINGS PLC	170	168	149	27,643	半導体・半導体製造装置	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	40	41	127	23,678	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC	142	143	682	126,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVIVA PLC	382	340	182	33,729	保険	
BABCOCK INTL GROUP PLC	53	70	78	14,554	商業・専門サービス	
BAE SYSTEMS PLC	400	375	173	32,190	資本財	
BARCLAYS PLC	1,807	1,900	448	83,063	銀行	
BG GROUP PLC	402	391	402	74,522	エネルギー	
BHP BILLITON PLC	254	242	394	73,079	素材	
BP PLC	2,122	2,079	915	169,551	エネルギー	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	217	211	785	145,619	食品・飲料・タバコ	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	139	128	115	21,411	メディア	
BT GROUP PLC	930	923	352	65,225	電気通信サービス	
BUNZL PLC	49	48	84	15,747	資本財	
BURBERRY GROUP PLC	58	56	90	16,722	耐久消費財・アパレル	
CAPITA PLC	100	85	90	16,783	商業・専門サービス	
CARNIVAL PLC	27	27	71	13,282	消費者サービス	
CENTRICA PLC	605	591	176	32,743	公益事業	
COBHAM PLC	—	180	52	9,770	資本財	
COMPASS GROUP PLC	222	200	211	39,244	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	22	—	—	—	素材	
DIAGEO PLC	287	285	539	99,961	食品・飲料・タバコ	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	—	198	56	10,393	保険	
DIXONS CARPHONE PLC	—	138	59	10,937	小売	
EXPERIAN PLC	143	127	127	23,623	商業・専門サービス	
FRIENDS LIFE GROUP LTD	225	201	67	12,589	保険	
G4S PLC	—	211	57	10,612	商業・専門サービス	
GKN PLC	225	240	78	14,522	自動車・自動車部品	
GLAXOSMITHKLINE PLC	556	551	811	150,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLENCORE PLC	1,263	1,219	400	74,224	素材	
HSBC HOLDINGS PLC	2,129	2,151	1,362	252,532	銀行	
IMI PLC	49	44	53	9,975	資本財	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	115	109	316	58,726	食品・飲料・タバコ	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	40	31	81	15,117	消費者サービス	
INTERTEK GROUP PLC	26	25	62	11,638	商業・専門サービス	
ITV PLC	548	493	100	18,712	メディア	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
JOHNSON MATTHEY PLC	27	28	88	16,458	素材
KINGFISHER PLC	333	307	93	17,369	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	760	691	169	31,401	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,774	6,478	508	94,232	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	—	27	57	10,657	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	221	213	101	18,861	小売
MEGGITT PLC	150	126	60	11,260	資本財
MORRISON WM SUPERMARKETS	356	328	59	11,105	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	405	414	398	73,781	公益事業
NEXT PLC	20	18	122	22,750	小売
OLD MUTUAL PLC	755	637	127	23,654	保険
PEARSON PLC	120	106	131	24,354	メディア
PERSIMMON PLC	44	41	60	11,292	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	300	291	439	81,388	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	—	11	49	9,207	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	74	72	380	70,518	家庭用品・パーソナル用品
REED ELSEVIER PLC	163	146	155	28,858	メディア
REXAM PLC	136	117	52	9,661	素材
RIO TINTO PLC	151	146	430	79,724	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	217	219	185	34,338	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	28,130	—	—	—	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	—	19,750	1	365	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	263	301	115	21,454	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	462	452	1,007	186,701	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	259	267	621	115,154	エネルギー
RSA INSURANCE GROUP PLC	—	133	62	11,520	保険
SABMILLER PLC	113	109	380	70,549	食品・飲料・タバコ
SAGE GROUP PLC	177	164	64	11,974	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	—	177	46	8,620	食品・生活必需品小売り
SEVERN TRENT PLC	33	32	68	12,685	公益事業
SHIRE PLC	70	67	297	55,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITH & NEPHEW PLC	131	108	117	21,754	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	64	62	75	13,987	資本財
SSE PLC	116	112	179	33,324	公益事業
STANDARD CHARTERED PLC	294	285	263	48,793	銀行
STANDARD LIFE PLC	339	307	127	23,569	保険
TESCO PLC	978	964	187	34,679	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC	37	37	64	11,949	資本財
TULLOW OIL PLC	138	123	58	10,784	エネルギー
UNILEVER PLC	151	146	385	71,403	食品・飲料・タバコ
UNITED UTILITIES GROUP PLC	94	87	79	14,791	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	3,003	3,033	693	128,470	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE	34	28	59	11,093	資本財
WHITBREAD PLC	24	23	102	19,052	消費者サービス
WOLSELEY PLC	39	35	123	22,797	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数		評 価 額
		外貨建金額			邦貨換算金額	
(イギリス)						
WPP PLC		百株 178	百株 165	千イギリスポンド 214	千円 39,713	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	59,301	52,131	19,233	3,563,684	
	銘柄 数 <比率>	76	84	—	<8.1%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シェケル		
BANK HAPOALIM BM		—	360	693	21,320	銀行
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		125	107	2,364	72,718	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	467	3,058	94,038	
	銘柄 数 <比率>	1	2	—	<0.2%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		267	260	564	69,637	資本財
ACTELION LTD-REG		13	12	136	16,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG		23	24	158	19,548	商業・専門サービス
ARYZTA AG		15	13	111	13,765	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		—	0.04	231	28,510	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		64	60	509	62,818	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG		192	185	467	57,692	各種金融
GEBERIT AG-REG		6	5	176	21,752	資本財
GIVAUDAN-REG		1	1	199	24,670	素材
HOLCIM LTD-REG		34	28	200	24,720	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		37	34	146	18,123	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		9	9	125	15,458	運輸
LONZA GROUP AG		—	8	89	11,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA		367	363	2,608	321,803	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		263	259	2,374	293,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG		80	79	2,294	283,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		10	10	138	17,064	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		0.90	0.82	170	21,053	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER		—	0.35	125	15,437	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		8	8	118	14,654	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG		5	4	218	26,940	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		6	5	110	13,609	保険
SWISS RE AG		43	41	333	41,115	保険
SWISSCOM AG		3	3	198	24,454	電気通信サービス
SYNGENTA AG		12	11	355	43,845	素材
TRANSOCEAN LTD		55	53	130	16,106	エネルギー
UBS AG		439	—	—	—	各種金融
UBS AG -2ND LINE OF SHARES		—	428	715	88,264	各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG		18	17	504	62,271	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	1,981	1,932	13,514	1,667,413	
	銘柄 数 <比率>	25	28	—	<3.8%>	
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S		1	1	1,633	32,499	運輸
CARLSBERG AS-B		16	16	849	16,895	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		15	15	774	15,421	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
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円		
DANSKE BANK A/S	93	83	1,346	26,789	銀行	
NOVO-NORDISK A/S	232	229	6,066	120,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	28	32	910	18,119	素材	
PANDORA A/S	—	14	713	14,190	耐久消費財・アパレル	
TDC A/S	160	154	741	14,761	電気通信サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	26	622	12,380	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	549	574	13,657	271,782	
	銘柄 数 <比率>	7	9	—	<0.6%>	
(ノルウェー)			千ノルウェー・クローネ			
DNB ASA	132	124	1,549	26,928	銀行	
NORSK HYDRO ASA	—	210	849	14,761	素材	
ORKLA ASA	161	130	705	12,253	食品・飲料・タバコ	
SEADRILL LTD	59	54	757	13,172	エネルギー	
STATOIL ASA	129	126	1,882	32,716	エネルギー	
TELENOR ASA	97	97	1,534	26,672	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	31	25	827	14,374	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	611	768	8,105	140,878	
	銘柄 数 <比率>	6	7	—	<0.3%>	
(スウェーデン)			千スウェーデン・クローネ			
ALFA LAVAL AB	53	51	786	12,565	資本財	
ASSA ABLOY AB	45	43	1,702	27,195	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	130	117	2,523	40,306	資本財	
ELECTROLUX AB	—	34	729	11,656	耐久消費財・アパレル	
HENNES & MAURITZ AB	109	108	3,333	53,239	小売	
HEXAGON AB-B SHS	35	37	939	14,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	29	29	705	11,270	各種金融	
INVESTOR AB	64	58	1,600	25,567	各種金融	
NORDEA BANK AB	353	351	3,241	51,766	銀行	
SANDVIK AB	162	143	1,123	17,945	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	192	190	1,779	28,412	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	82	65	1,031	16,479	資本財	
SKF AB	62	58	892	14,248	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB	76	74	1,275	20,365	家庭用品・パーソナル用品	
SVENSKA HANDELSBANKEN	61	61	2,142	34,214	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	111	110	2,109	33,682	銀行	
SWEDISH MATCH AB	—	30	734	11,722	食品・飲料・タバコ	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	374	359	3,281	52,405	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIASONERA AB	329	316	1,634	26,109	電気通信サービス	
VOLVO AB	204	188	1,585	25,321	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,479	2,433	33,154	529,473	
	銘柄 数 <比率>	18	20	—	<1.2%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
BANK OF IRELAND	2,824	3,512	105	15,660	銀行	
CRH PLC	99	97	170	25,323	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 千ユーロ	
(ユーロ/アイルランド) KERRY GROUP PLC-A	百株 19	百株 21	119	17,729	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 2,943	3,631	396	58,713	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >
(ユーロ/オランダ)					
AEGON NV	242	232	144	21,354	保険
AIRBUS GROUP NV	67	68	321	47,568	資本財
AKZO NOBEL NV	30	30	166	24,661	素材
ASML HOLDING NV	41	41	348	51,665	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	142	146	94	14,057	資本財
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	—	118	115	17,114	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	—	15	84	12,515	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	28	27	167	24,844	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV	464	449	516	76,558	銀行
KONINKLIJKE AHOLD NV	121	117	163	24,233	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV	19	22	116	17,330	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV	108	114	265	39,257	資本財
QIAGEN NV	—	39	74	11,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD HOLDINGS NV	17	20	73	10,922	商業・専門サービス
REED ELSEVIER NV	98	94	178	26,392	メディア
ROYAL KPN NV	376	403	108	16,062	電気通信サービス
UNILEVER NV	186	182	579	85,785	食品・飲料・タバコ
WOLTERS KLUWER NV	55	51	115	17,118	メディア
ZIGGO NV	20	—	—	—	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 2,024	2,178	3,634	538,480	
	銘 柄 数 < 比 率 >	16	18	—	< 1.2% >
(ユーロ/ベルギー)					
AGEAS	39	45	126	18,728	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	92	92	831	123,234	食品・飲料・タバコ
DELHAIZE GROUP	16	15	92	13,663	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	14	15	107	15,997	各種金融
KBC GROUP SA	33	33	144	21,421	銀行
SOLVAY SA	9	9	105	15,700	素材
UCB SA	15	16	105	15,645	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 221	228	1,514	224,392	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.5% >
(ユーロ/ルクセンブルグ)					
ALTICE SA	—	10	47	7,062	メディア
ARCELORMITTAL	139	134	131	19,503	素材
TENARIS SA	74	69	98	14,553	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 213	214	277	41,119	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.1% >
(ユーロ/フランス)					
ACCOR	26	26	94	13,998	消費者サービス
AIR LIQUIDE	37	40	403	59,791	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	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ALCATEL-LUCENT	328	362	92	13,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALSTOM RGPT	—	29	84	12,534	資本財
ARKEMA	10	11	63	9,409	素材
ATOS	—	13	71	10,533	ソフトウェア・サービス
AXA	219	215	405	60,072	保険
BNP PARIBAS	117	123	600	88,937	銀行
BOUYGUES	29	27	81	12,042	資本財
BUREAU VERITAS SA	36	38	73	10,833	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	20	20	113	16,790	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	80	77	192	28,450	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON	11	9	81	12,004	食品・生活必需品小売り
CHRISTIAN DIOR SA	8	7	116	17,237	耐久消費財・アパレル
CIE DE SAINT-GOBAIN	54	55	195	28,916	資本財
CREDIT AGRICOLE SA	138	128	135	20,092	銀行
DANONE	68	67	368	54,547	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	9	17	93	13,843	ソフトウェア・サービス
EDENRED	37	35	79	11,810	商業・専門サービス
EDF	26	30	70	10,497	公益事業
ESSILOR INTERNATIONA	26	25	227	33,696	ヘルスケア機器・サービス
GDF SUEZ	159	167	314	46,530	公益事業
GEMALTO	9	10	70	10,411	ソフトウェア・サービス
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	88	76	79	11,789	運輸
ILIAD SA	3	3	70	10,391	電気通信サービス
KERING	10	9	152	22,635	耐久消費財・アパレル
LAFARGE SA	26	23	132	19,596	素材
LEGRAND SA	38	36	148	22,040	資本財
L'OREAL SA	27	28	377	55,905	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	30	32	452	67,052	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	24	23	167	24,776	自動車・自動車部品
NATIXIS	140	143	77	11,412	銀行
ORANGE S.A.	246	223	290	43,079	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	27	26	242	35,919	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	—	51	47	6,986	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	26	26	151	22,508	メディア
RENAULT SA	24	24	146	21,678	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	33	34	177	26,308	資本財
SANOFI	139	136	1,045	154,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67	62	390	57,846	資本財
SOCIETE GENERALE	87	86	319	47,344	銀行
SODEXO	13	14	113	16,781	消費者サービス
TECHNIP SA	16	14	90	13,381	エネルギー
TOTAL SA	246	243	1,132	167,739	エネルギー
VALEO SA	10	10	98	14,518	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	—	60	86	12,859	公益事業
VINCI SA	60	58	260	38,623	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円		
VIVENDI SA		147	147	290	43,085	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,995	3,143	10,569	1,565,712		
	銘柄 数 <比 率>	44	48	—	<3.6%>		
(ユーロ/ドイツ)							
ADIDAS AG		27	28	178	26,476	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE		54	52	698	103,462	保険	
BASF SE		107	105	753	111,696	素材	
BAYER AG		96	94	1,080	160,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		42	40	343	50,884	自動車・自動車部品	
BEIERSDORF AG		13	14	100	14,847	家庭用品・パーソナル用品	
BRENNTAG AG		7	25	110	16,372	資本財	
COMMERZBANK AG		123	119	139	20,722	銀行	
CONTINENTAL AG		13	13	206	30,596	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG		112	110	695	103,008	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE BANK AG		126	164	403	59,826	各種金融	
DEUTSCHE BOERSE AG		27	26	146	21,651	各種金融	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		48	—	—	—	運輸	
DEUTSCHE POST AG		110	117	288	42,808	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG		345	367	474	70,251	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		47	51	96	14,234	不動産	
E.ON SE		220	235	308	45,753	公益事業	
FRESENIUS SE & CO KGAA		16	47	198	29,384	ヘルスケア機器・サービス	
GEA GROUP AG		29	29	108	16,068	資本財	
HEIDELBERGCEMENT AG		22	19	112	16,648	素材	
HENKEL AG & CO KGAA		37	20	153	22,786	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL KGAA-VORZUG		—	16	137	20,376	家庭用品・パーソナル用品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		149	147	115	17,138	半導体・半導体製造装置	
LINDE AG		22	22	332	49,303	素材	
MERCK KGAA		8	16	127	18,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METRO AG		—	25	66	9,806	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		21	20	320	47,456	保険	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		19	19	127	18,858	自動車・自動車部品	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG		31	32	109	16,173	メディア	
RWE AG		63	59	158	23,531	公益事業	
SAP SE		108	106	581	86,071	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS AG		91	90	825	122,363	資本財	
THYSSENKRUPP AG		65	59	116	17,299	素材	
VOLKSWAGEN AG		19	21	369	54,747	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,233	2,322	9,987	1,479,507		
	銘柄 数 <比 率>	32	33	—	<3.4%>		
(ユーロ/ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		443	337	111	16,477	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA		—	70	76	11,267	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	443	407	187	27,745		
	銘柄 数 <比 率>	1	2	—	<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			業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ/スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	60	68	112	16,623	運輸	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS-RTS	60	—	—	—	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	—	25	69	10,299	資本財	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	47	46	143	21,321	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	681	664	574	85,064	銀行	
BANCO DE SABADELL SA	431	423	91	13,570	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	213	224	96	14,369	銀行	
BANCO SANTANDER SA	1,337	1,335	909	134,734	銀行	
BANKIA SA	460	536	73	10,954	銀行	
CAIXABANK	213	216	92	13,728	銀行	
ENAGAS SA	—	27	74	11,023	公益事業	
FERROVIAL S.A.	68	65	102	15,214	資本財	
GAS NATURAL SDG SA	43	41	94	13,938	公益事業	
GRIFOLS SA	18	20	71	10,591	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	580	564	317	46,989	公益事業	
INDITEX SA	25	124	284	42,088	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	164	185	99	14,674	運輸	
RED ELECTRICA DE ESPANA	14	13	99	14,700	公益事業	
REPSOL SA	114	120	215	31,946	エネルギー	
TELEFONICA SA	497	475	579	85,794	電気通信サービス	
TELEFONICA SA-RTS	—	475	16	2,446	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,036 18	5,657 20	4,118 —	610,075 <1.4%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	152	145	242	35,954	保険	
ATLANTIA SPA	55	58	110	16,363	運輸	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	—	560	37	5,600	銀行	
BANCO POPOLARE SC	—	52	53	7,889	銀行	
ENEL SPA	801	761	281	41,675	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	301	292	482	71,413	エネルギー	
FIAT SPA	121	—	—	—	自動車・自動車部品	
INTESA SANPAOLO	1,447	1,445	330	49,028	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	22	22	92	13,650	耐久消費財・アパレル	
SAIPEM SPA	—	36	46	6,880	エネルギー	
SNAM SPA	249	273	113	16,762	公益事業	
TELECOM ITALIA SPA	1,898	1,801	164	24,371	電気通信サービス	
TERNA SPA	243	245	94	14,041	公益事業	
UNICREDIT SPA	534	518	287	42,658	銀行	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	139	129	75	11,134	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,966 12	6,343 14	2,412 —	357,423 <0.8%>	
(ユーロ/フィンランド)						
FORTUM OYJ	58	57	106	15,838	公益事業	
KONE OYJ	42	42	149	22,144	資本財	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	454	436	270	40,024	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMPO OYJ	55	56	213	31,696	保険	
UPM-KYMMENE OYJ	85	83	105	15,691	素材	
WARTSILA OYJ	26	24	90	13,420	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	723	699	937	138,815	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.3% >	
(ユーロ/オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	39	43	89	13,308	銀行	
IMMOFINANZ AG	261	—	—	—	不動産	
OMV AG	28	31	75	11,198	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	329	74	165	24,507	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ/その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	29	27	162	24,024	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	29	27	162	24,024	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	23,159	24,927	34,362	5,090,517	
	銘柄 数 < 比 率 >	145	157	—	< 11.6% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	144,599	141,564	—	40,398,440	
	銘柄 数 < 比 率 >	869	963	—	< 92.0% >	

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

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

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

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

(2) 外国(外貨建)投資信託証券

銘柄	口 数	当 期 末		
		評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千米・ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	1	236	27,957	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	3	315	37,274	
PROLOGIS INC	6	250	29,617	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	12	140	16,568	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	237	28,130	
EQUITY RESIDENTIAL	3	275	32,571	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.800	158	18,711	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	131	15,564	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	6	167	19,801	
HCP INC	5	237	28,033	
HEALTH CARE REIT INC	3	255	30,190	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	9	212	25,073	
KIMCO REALTY CORP	6	149	17,663	
MACERICH CO/THE	2	160	18,946	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	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	千米・ドル	千円
PLUM CREEK TIMBER CO	2	120	14,229
PUBLIC STORAGE	1	299	35,351
SIMON PROPERTY GROUP INC	3	603	71,385
SL GREEN REALTY CORP	1	147	17,471
UDR INC	3	110	13,018
VENTAS INC	3	238	28,227
VORNADO REALTY TRUST	2	220	26,035
REALTY INCOME CORP	2	133	15,783
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	118	14,059
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	4	105	12,528
AMERICAN TOWER REIT INC	4	452	53,494
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	10	95	11,231
小 計	口 数 ・ 金 額	107	5,574
	銘柄 数 < 比 率 >	26	<1.5%>
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル	
DEXUS PROPERTY GROUP	18	131	13,358
GPT GROUP	33	136	13,932
GOODMAN GROUP	31	173	17,640
STOCKLAND	38	158	16,109
WESTFIELD CORP	30	249	25,433
MIRVAC GROUP	76	133	13,618
SCENTRE GROUP	74	255	25,962
小 計	口 数 ・ 金 額	303	1,238
	銘柄 数 < 比 率 >	7	<0.3%>
(香港)		千香港・ドル	
LINK REIT	33	1,601	24,411
小 計	口 数 ・ 金 額	33	1,601
	銘柄 数 < 比 率 >	1	<0.1%>
(イギリス)		千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC	12	96	17,972
HAMMERSON PLC	11	69	12,790
LAND SECURITIES GROUP PLC	10	122	22,634
小 計	口 数 ・ 金 額	34	288
	銘柄 数 < 比 率 >	3	<0.1%>
(ユーロ/フランス)		千ユーロ	
UNIBAIL-RODAMCO SE	1	251	37,232
小 計	口 数 ・ 金 額	1	251
	銘柄 数 < 比 率 >	1	<0.1%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	251
	銘柄 数 < 比 率 >	1	<0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額	479	900,017
	銘柄 数 < 比 率 >	38	<2.0%>

(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相場場の仲値により邦貨換算したものです。

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国		百万円	百万円
	S&P 500 EMINI FUTURE	1,839	—
	DJ EURO STOXX 50	923	—

(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

(2014年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	40,398,440	91.6
投 資 信 託 証 券	900,017	2.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,824,599	6.4
投 資 信 託 財 産 総 額	44,123,057	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118.21円、1カナダ・ドル104.20円、1オーストラリア・ドル101.78円、1香港・ドル15.24円、1シンガポール・ドル90.83円、1イギリス・ポンド185.29円、1イスラエル・シェケル30.75円、1スイス・フラン123.38円、1デンマーク・クローネ19.90円、1ノルウェー・クローネ17.38円、1スウェーデン・クローネ15.97円、1ユーロ148.14円です。

(注2) 外貨建純資産(42,436,611千円)の投資信託財産総額(44,123,057千円)に対する比率は96.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国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

(2014年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	44,316,220,659円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,880,970,732
株 式(評価額)	40,398,440,068
投 資 信 託 証 券(評価額)	900,017,857
未 収 入 金	288,391,435
未 収 配 当 金	67,568,440
差 入 委 託 証 拠 金	780,832,127
(B) 負 債	387,285,548
未 払 金	208,467,397
未 払 解 約 金	178,818,151
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	43,928,935,111
元 本	31,417,345,029
次 期 繰 越 損 益 金	12,511,590,082
(D) 受 益 権 総 口 数	31,417,345,029口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	13,982円

(注1) 期首元本額 30,732,949,563円
 期中追加設定元本額 3,875,911,770円
 期中一部解約元本額 3,191,516,304円

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

DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	280,880,216円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	1,889,015,758円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,629,062,131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)	11,302,699,162円
ニッセイ厚生年金型バランス運用DB (適格機関投資家限定)	12,199,044,845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	4,116,642,917円

◆損益の状況

当期 (2014年5月21日～2014年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	413,328,619円
受 取 配 当 金	412,859,196
受 取 利 息	312,796
そ の 他 収 益 金	156,627
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,759,370,293
売 買 益	7,965,355,260
売 買 損	△ 1,205,984,967
(C) 先 物 取 引 等 損 益	153,430,510
取 引 益	183,509,276
取 引 損	△ 30,078,766
(D) 信 託 報 酬 等	△ 11,080,924
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	7,315,048,498
(F) 前期繰越損益金	5,141,120,519
(G) 追加信託差損益金	914,331,361
(H) 解約差損益金	△ 858,910,296
(I) 合 計 (E+F+G+H)	12,511,590,082
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	12,511,590,082

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

あなたのサクセス・パートナー



NISSAY
ASSET MANAGEMENT