

第1期末 (2018年11月20日)

基準価額	10,166円
純資産総額	123百万円
騰落率	1.7%
分配金	0円

<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(8資産均等型)

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2018年2月13日～2018年11月20日

第1期(決算日 2018年11月20日)

受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)」は、このたび第1期の決算を行いました。

当ファンドは、投資対象の異なる8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、債券およびリート(不動産投資信託)市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

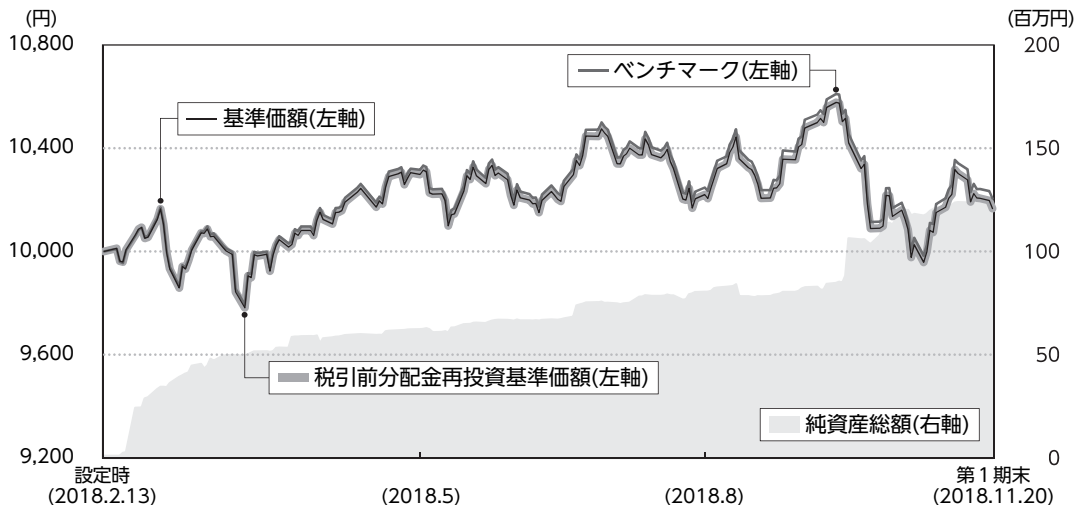
NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年2月13日～2018年11月20日

基準価額等の推移



設定時	10,000円	既払分配金	0円
第1期末	10,166円	騰落率 (分配金再投資ベース)	1.7%

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

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

(注3) ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、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）、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）、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下、円換算ベース）を8分の1ずつ組み合わせて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標準に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。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。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。MSCI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。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。東証REIT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REIT指数の商標または標準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REIT指数の

<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）

指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT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。(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT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REIT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。(株)東京証券取引所は、東証REIT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(株)東京証券取引所は、東証REIT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、(株)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。(株)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。(株)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二重を、東証REIT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、(株)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、責任を負いません。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。MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。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。J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）はJ.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（以下「EMBI+」）といえます）から格付がB格以下の債券等を除いたものです。EMBI+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。なお、「円換算ベース」とは、委託会社が独自に円換算したものです。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、為替市場において対円で米ドルが上昇したこと、主要な海外リート市場や国内リート市場が上昇したことが上昇要因となる一方で、国内株式市場が下落したことはマイナス要因となりましたが、期を通じて見ると設定時よ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	8分の1	12.2%	△ 4.2%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	8分の1	12.3	4.5
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	8分の1	12.6	△ 11.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	8分の1	12.5	0.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	8分の1	12.5	△ 0.2
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	8分の1	12.4	0.3
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	8分の1	12.8	11.0
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	8分の1	12.7	14.9

(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1期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	16円	0.160%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,209円です。
(投信会社)	(7)	(0.071)	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)	(7)	(0.072)	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)	(2)	(0.016)	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	2	0.016	
(株式)	(1)	(0.011)	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)	(0.002)	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)	(0.003)	
有価証券取引税	1	0.005	
(株式)	(0)	(0.005)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	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	11	0.108	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.008)	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)	(2)	(0.022)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	29	0.289	

(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まず。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

投資環境

■国内株式市況

当期の国内株式市場は下落しました。

設定時以降、米国の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となりました。4月になると、米中貿易摩擦への警戒感がやわらいだことや、シリア・北朝鮮の地政学リスクに対する懸念が後退したこともあり、国内株式市場は上昇しましたが、5月に入り、米保護主義政策やイタリアの政局混迷などを背景に下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国への不安などから国内株式市場は上下しながら推移しましたが、9月以降は、米中貿易摩擦への警戒感が一服し、為替が円安に推移したことから上昇しました。

10月になると、米株式市場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から国内株式市場は下落に転じ、下落基調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期を通じて見ると下落しました。設定時以降、米利上げペース加速に対する警戒感やトランプ大統領による保護貿易政策への懸念から株式市場は一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績等に支えられ、上昇基調が続きました。しかし10月に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念、中東情勢不安等の地政学リスクの高まりなどを背景として下落する展開となりました。

■新興国株式市況

当期の新興国株式市場は期を通じて見ると下落しました。設定時以降、貿易摩擦に対する懸念がくすぶる中、株式市場は不安定な動きとなりました。その後も、先進国における金融引き締めや米ドル高の進行、米中貿易摩擦に対する懸念などを背景として、期末にかけて下落基調が続きました。

■国内債券市況

当期の10年国債金利は上昇しました。

設定時以降、米金利の先高観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から、金利は低下基調となりました。しかし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、その後も円安・株高の進行などを背景に上昇傾向となりました。

10月以降は、日米の株価が大きく下落したことなどから国内長期金利は低下しましたが、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

■先進国債券市況

当期の米国10年国債金利は上昇しました。設定時以降、日欧の金融政策正常化に対する懸念などから上昇しました。3月になると、米保護主義政策への懸念などから金利は低下し、その後も、米中貿易摩擦懸念や新興国不安などから低下傾向となりました。9月には、米雇用統計における賃金上振れや新興国不安の一服などから金利は上昇しました。期末にかけては、株価の大幅下落により低下する場面などもありましたが、結局、設定時を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は低下しました。設定時以降、日銀の金融政策正常化に対する警戒などから、金利は上昇しました。しかし2月以降は、欧州景気の減速懸念や米保護主義政策を背景に低下傾向となり、その後も、イタリア政局の不透明感の高まりや米中貿易摩擦への懸念などを背景に、金利は上下する中、徐々に低下して当期末を迎えました。

■新興国債券市況

当期の新興国債券市場は、米ドル建て新興国債券金利が上昇（債券価格は下落）したことから下落しました。また、米国10年国債金利が上昇し、新興国債券の米国国債に対するスプレッド（上乗せ金利）も拡大しました。

設定時以降、ベースとなる米国10年国債金利が日欧の金融政策正常化への懸念等を背景に上昇したことから、新興国債券市場は下落しました。3月になると、米保護主義政策に対する懸念等から金利が低下し、その後も米中貿易摩擦や新興国不安等により低下傾向となりましたが、新興国不安等によってスプレッドが拡大する場面もあり、新興国債券市場は上下しながら推移しました。9月には、新興国不安の一服などから新興国債券市場は上昇しましたが、期末にかけては、株価の大幅下落を受けてスプレッドが拡大する場面などもあり、結局、当期の新興国債券市場は下落して当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル／円レートは上昇しました。設定時以降、米保護主義政策への警戒などから、米ドルは下落しました。その後も、世界的な株価の大幅下落などもあり、米ドルは下落を続けましたが、4月になると、政治・地政学リスクへの懸念が緩和したことなどから上昇に転じました。期末にかけては、米金利の上昇などを背景に上下する中で徐々に上昇しました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。設定時以降、世界的な株価下落や欧州景況感の悪化などにより下落しました。その後は、イタリアの財政や米中貿易摩擦に対する懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やイギリスの欧州連合（EU）離脱交渉の進展期待が高まる場面では上昇しましたが、おおむね下落傾向で推移しました。

■国内リート市況

当期の国内リート市場は上昇しました。

設定時以降、米利上げペースの加速懸念の高まりを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、値動きの激しい展開となりました。その後は、低水準で推移している長期金利、東京都心部のオフィス空室率低下や賃料上昇等の良好な外部環境が継続していることに加え、Jリートによる自己投資口取得や資産入れ替えなどの投資主価値向上に資する取り組みが評価されたことも材料となり、再び上昇基調に転じ、設定時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

当期の先進国リート市場は、設定時以降、米連邦準備制度理事会（FRB）による利上げペースの加速懸念を受けて米国株式市場が急落したことや米中通商問題、加えて米国によるシリア攻撃を背景とした地政学リスク等から軟調に推移しました。その後、期末にかけては米中貿易摩擦に対する懸念はあったものの、米長期金利が低下したことなどを背景に、先進国リート市場は上昇基調となりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる8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、債券およびリート（不動産投資信託）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（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。

<ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド>

新興国の米ドル建て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した。

<ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

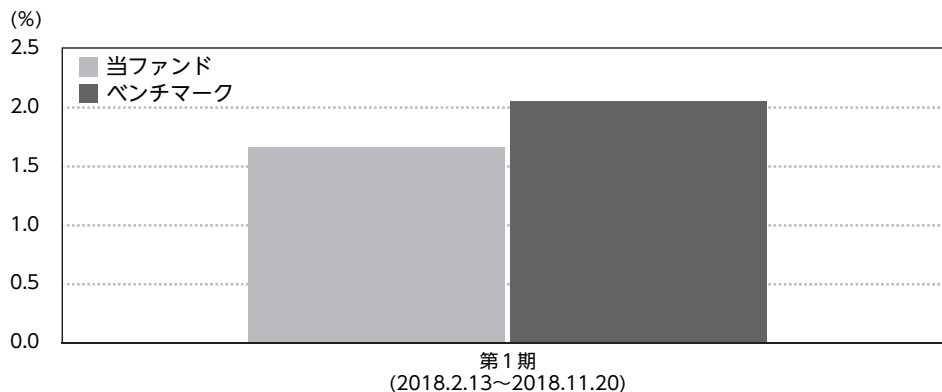
国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

日本を除く各国の金融商品取引所に上場している先進国のリートに投資することにより、ベンチマーク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、後掲の各マザーファンドの概要をご参照ください。以下同じです。

ベンチマークとの差異



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+1.7%となり、ベンチマーク騰落率（+2.1%）におおむね連動しました。

分配金

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

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2018年2月13日~2018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	165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8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、債券およびリート（不動産投資信託）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。

<ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド>

新興国の米ドル建て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>

日本を除く各国の金融商品取引所に上場している先進国のリートに投資することにより、ベンチマーク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1期末 2018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	12.2%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	12.3
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	12.6
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	12.5
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	12.5
ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	12.4
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	12.8
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	12.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

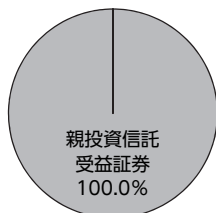
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

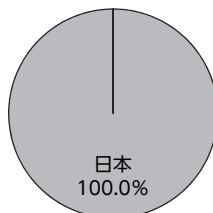
項目	第1期末 2018年11月20日
純資産総額	123,377,684円
受益権総口数	121,367,121口
1万口当たり基準価額	10,166円

(注) 当期間中における追加設定元本額は154,808,418円、同解約元本額は34,441,297円です。

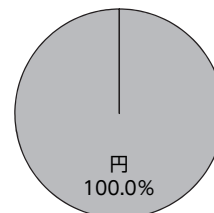
■資産別配分



■国別配分



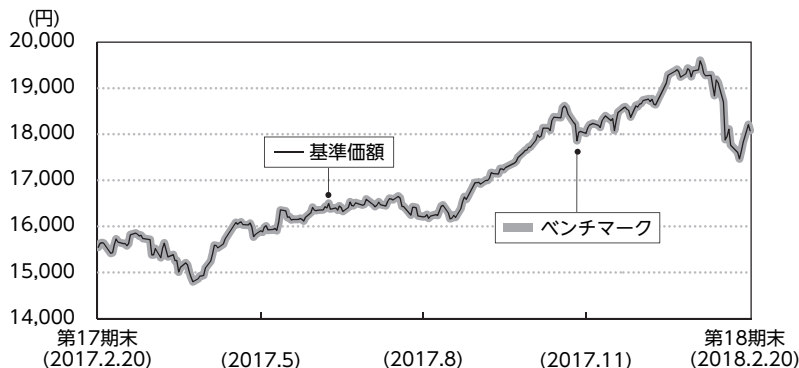
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2018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。

■ 上位銘柄

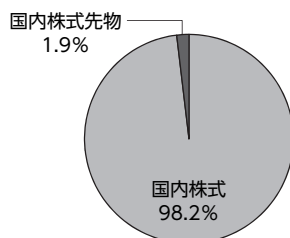
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.1
ソフトバンクグループ	円	1.5
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.4
ソニー	円	1.4
本田技研工業	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
キーエンス	円	1.2
任天堂	円	1.1
みずほフィナンシャルグループ	円	1.1
組入銘柄数		1,820

■ 1万口当たりの費用明細

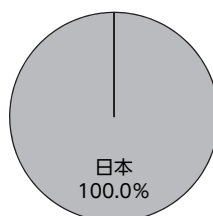
2017.2.21～2018.2.20

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

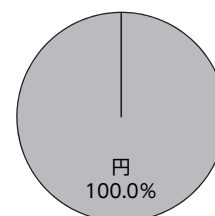
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



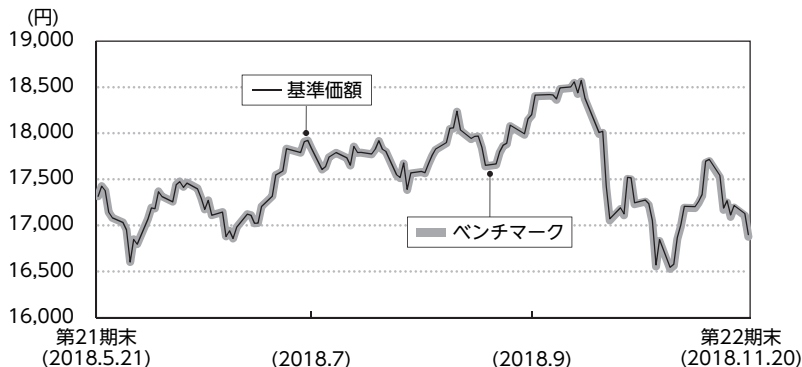
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2018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MSCI Inc.が公表するMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

■ 上位銘柄

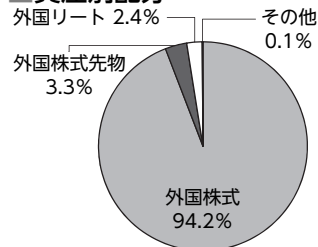
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	2.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.1%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	1.1%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0%
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	0.9%
FACEBOOK INC-A	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	0.8%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,301

■ 1万口当たりの費用明細

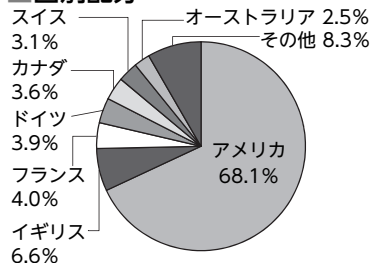
2018.5.22~2018.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	1 (1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	5 (4)
(その他)	(1)
合計	7

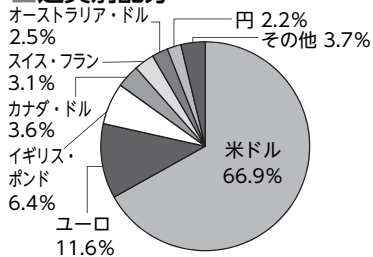
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



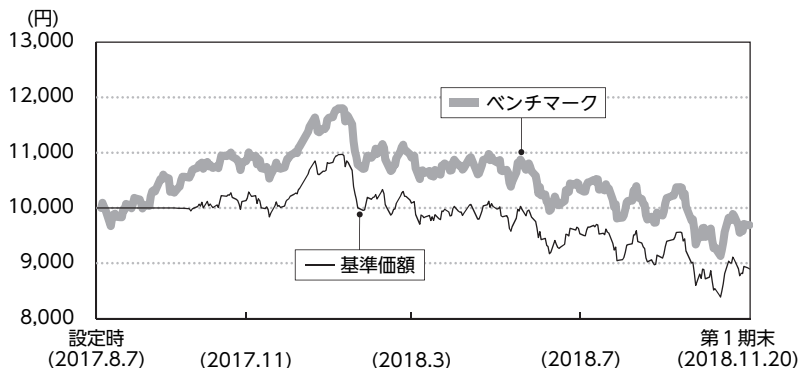
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2018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）で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

■上位銘柄

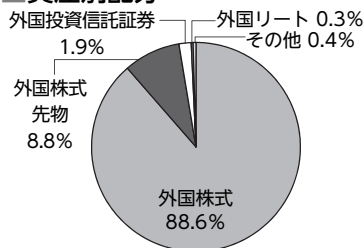
銘柄名	通貨	比率
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	4.4%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.9
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	3.7
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	米ドル	3.7
NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ・ランド	1.8
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	香港ドル	1.7
CHINA MOBILE LTD/HK	香港ドル	1.3
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	米ドル	1.2
BAIDU INC - SPON ADR	米ドル	1.1
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	香港ドル	1.1
組入銘柄数		844

■1万口当たりの費用明細

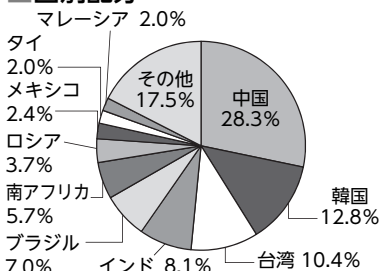
2017.8.7～2018.11.20

項目	金額
売買委託手数料	33円
(株式)	(30)
(先物・オプション)	(2)
(投資信託証券)	(2)
有価証券取引税	8
(株式)	(8)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	148
(保管費用)	(136)
(その他)	(12)
合計	189

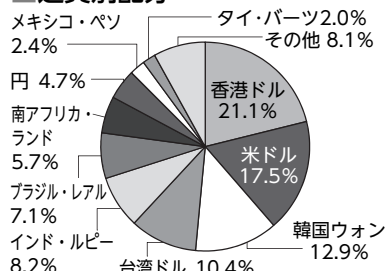
■資産別配分



■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（2018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、野村証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、野村証券株式会社の知的財産です。野村証券株式会社は、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

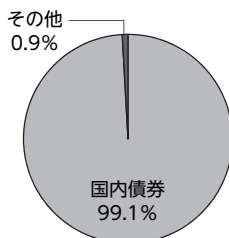
銘柄名	通貨	比率
第343回 利付国債(10年)	円	0.9%
第339回 利付国債(10年)	円	0.9
第342回 利付国債(10年)	円	0.9
第344回 利付国債(10年)	円	0.9
第340回 利付国債(10年)	円	0.9
第312回 利付国債(10年)	円	0.9
第349回 利付国債(10年)	円	0.9
第346回 利付国債(10年)	円	0.8
第345回 利付国債(10年)	円	0.8
第341回 利付国債(10年)	円	0.8
組入銘柄数		422

■ 1万口当たりの費用明細

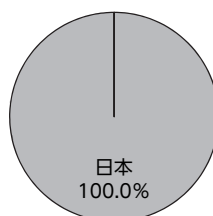
2017.3.11~2018.3.12

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

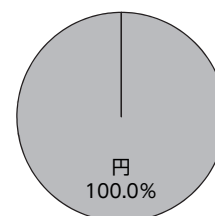
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



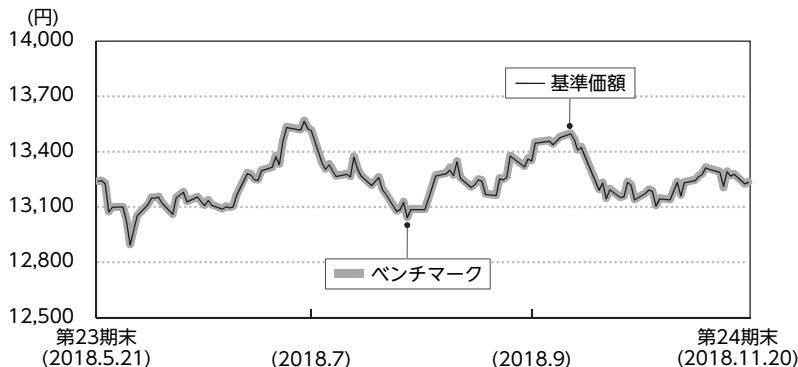
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2018年3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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。

■ 上位銘柄

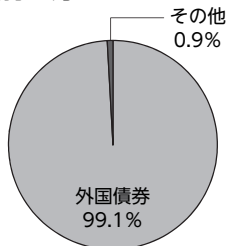
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.625% 2020/11/15	米ドル	1.0%
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.625% 2020/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.0% 2023/2/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.375% 2020/1/31	米ドル	0.9
US TREASURY 3.5% 2020/5/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.0% 2021/11/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.125% 2021/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.625% 2022/11/15	米ドル	0.8
組入銘柄数		590

■ 1万口当たりの費用明細

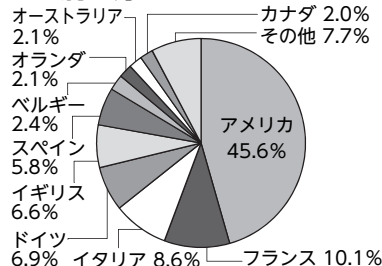
2018.5.22~2018.11.20

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

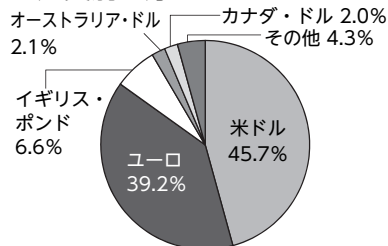
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



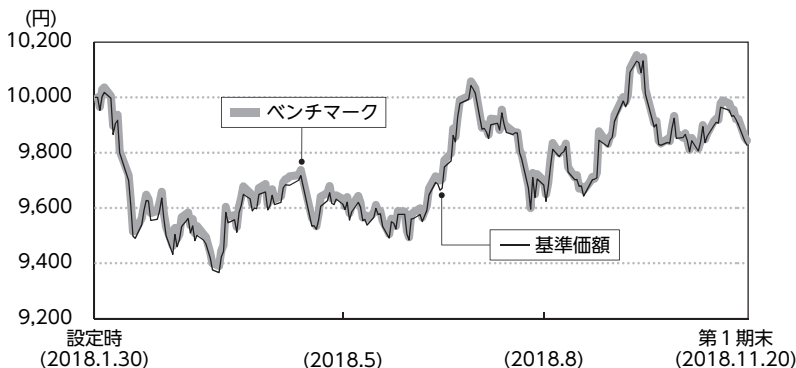
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2018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JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下、円換算ベース）で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の中により邦貨換算しています。JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）はJPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（以下「EMB I+」といいます）から格付がB格以下の債券等を除いたものです。EMB I+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された固定・変動利付債券等やローンを対象としています。JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、JPMorganはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。JPMorganからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。

■ 上位銘柄

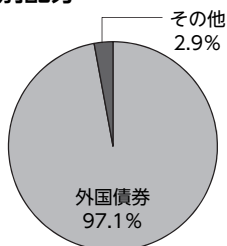
銘柄名	通貨	比率
RUSSIAN FEDERATION 5.25% 2047/6/23	米ドル	4.1%
CROATIA 6.0% 2024/1/26	米ドル	2.9
REPUBLIC OF INDONESIA 5.25% 2047/1/8	米ドル	2.7
REPUBLIC OF INDONESIA 5.875% 2024/1/15	米ドル	2.4
FED REPUBLIC OF BRAZIL 6.0% 2026/4/7	米ドル	2.4
REPUBLIC OF INDONESIA 4.875% 2021/5/5	米ドル	2.3
RUSSIAN FEDERATION 4.875% 2023/9/16	米ドル	2.3
RUSSIAN FEDERATION 5.0% 2020/4/29	米ドル	2.3
REPUBLIC OF INDONESIA 4.75% 2026/1/8	米ドル	2.3
RUSSIAN FEDERATION 4.75% 2026/5/27	米ドル	2.2
組入銘柄数		63

■ 1万口当たりの費用明細

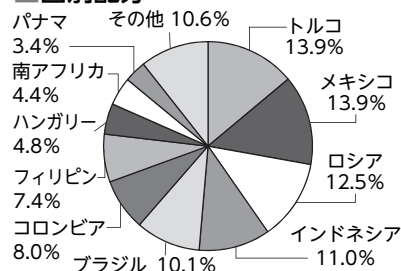
2018.1.30～2018.11.20

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

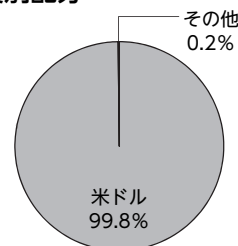
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



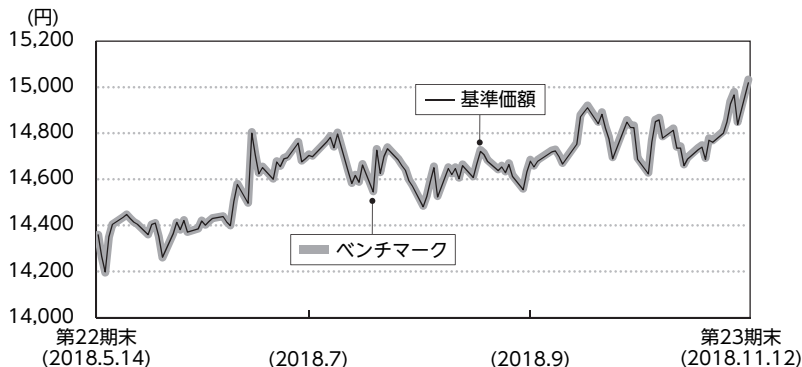
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2018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) ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。東証REIT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・ノウハウおよび東証REIT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。また、株式会社東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の正確性、完全性を保証するものではなく、その算出・公表の誤謬・遅延等に関して責任を負いません。株式会社東京証券取引所は、当商品に関する義務を持たず、当商品の運用成績に関して一切責任を有しません。

■ 上位銘柄

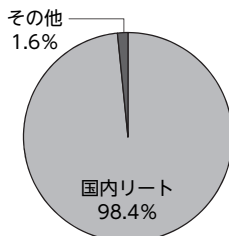
銘柄名	通貨	比率
日本ビルファンド投資法人	円	7.4%
ジャパンリアルエステイト投資法人	円	6.9
野村不動産マスターファンド投資法人	円	4.9
日本リテールファンド投資法人	円	4.6
ユナイテッド・アーバン投資法人	円	4.4
オリックス不動産投資法人	円	4.0
日本プロロジスリート投資法人	円	3.6
大和ハウスリート投資法人	円	3.5
アドバンス・レジデンス投資法人	円	3.3
GLP投資法人	円	3.2
組入銘柄数		61

■ 1万口当たりの費用明細

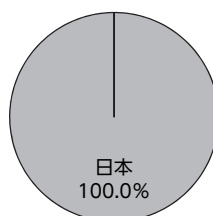
2018.5.15~2018.11.12

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

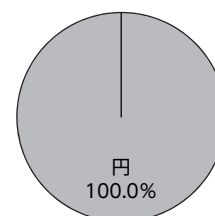
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



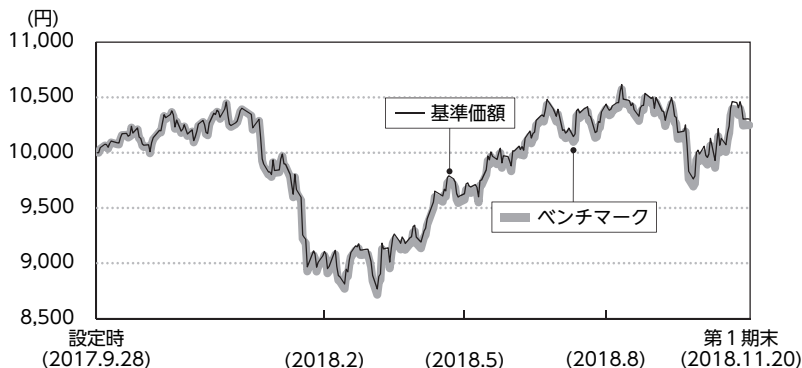
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2018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



(注) ベンチマークは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）で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。S&P先進国REITインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ I」）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SPDJ I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、SPDJ I、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。

■ 上位銘柄

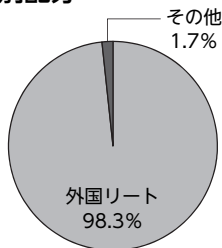
銘柄名	通貨	比率
SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	5.2%
PROLOGIS INC	米ドル	3.9
PUBLIC STORAGE	米ドル	2.8
WELLTOWER INC	米ドル	2.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC	米ドル	2.3
EQUITY RESIDENTIAL	米ドル	2.3
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	ユーロ	2.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	米ドル	2.2
VENTAS INC	米ドル	2.0
LINK REIT	香港ドル	1.9
組入銘柄数		295

■ 1万口当たりの費用明細

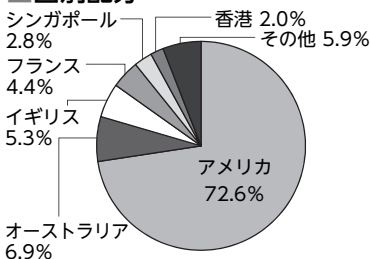
2017.9.28～2018.11.20

項目	金額
売買委託手数料	4円
(株式)	(0)
(投資信託証券)	(4)
有価証券取引税	5
(投資信託証券)	(5)
その他費用	19
(保管費用)	(11)
(その他)	(8)
合計	28

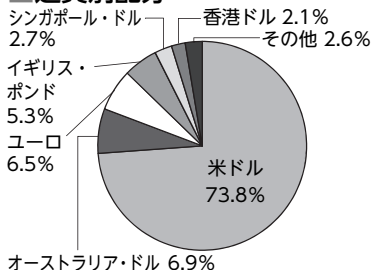
■ 資産別配分



■ 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（2018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)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2018年2月13日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2018年11月20日)	10,166	0	1.7	10,166	10,205	2.1	34.6	1.8	36.8	25.7	123

(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、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、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）、MSCIエマーゼン・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、JPモルガン・エマーゼン・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下、円換算ベース）を8分の1ずつ組み合わせて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数値の公表、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の商標または標準に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。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。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。MSCI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。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。東証REIT指数は、株式会社東京証券取引所（以下「㈩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REIT指数の商標または標準に関するすべての権利は㈩東京証券取引所が有しています。㈩東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT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。㈩東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT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REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をしません。㈩東京証券取引所は、東証REIT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㈩東京証券取引所は、東証REIT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、㈩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。㈩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。㈩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REIT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、㈩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）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ I」）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SPDJ I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、SPDJ I、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。MSCIエマーゼン・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。JPモルガン・エマーゼン・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）はJPモルガン・エマーゼン・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（以下「EMBI+」）といいますが、格付がB格以下の債券等を除いたものです。EMBI+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付

<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）

債券等やローンを対象としています。J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。なお、「円換算ベース」とは、委託会社が独自に円換算したものです。以下同じです。

- (注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。
- (注6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。
- (注7) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
(設定日)2018年2月13日	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—
2月末	10,104	1.0	10,110	1.1	35.3	1.9	36.6	25.0
3月末	9,983	△0.2	9,994	△0.1	34.6	1.9	37.0	25.4
4月末	10,191	1.9	10,208	2.1	35.4	1.9	36.5	25.1
5月末	10,142	1.4	10,161	1.6	34.4	2.2	36.8	25.4
6月末	10,198	2.0	10,220	2.2	34.2	1.8	37.0	25.7
7月末	10,374	3.7	10,399	4.0	36.4	1.2	36.6	24.8
8月末	10,359	3.6	10,392	3.9	35.0	1.9	35.7	25.0
9月末	10,558	5.6	10,589	5.9	35.9	1.6	36.8	24.5
10月末	10,082	0.8	10,111	1.1	33.6	1.4	38.0	26.0
(期末)2018年11月20日	10,166	1.7	10,205	2.1	34.6	1.8	36.8	25.7

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は設定日比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2018年2月13日～2018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	11,664	20,951	2,786	5,006
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	11,997	20,558	3,049	5,298
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	22,191	21,249	4,720	4,485
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	21,215	20,492	5,238	5,062
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15,334	20,230	3,695	4,893
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	20,717	20,148	5,099	4,974
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	14,090	20,121	3,655	5,286
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	20,925	20,196	5,722	5,686

(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	12,778,825千円	36,838,139千円	452,403千円	378千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,067,041千円	128,776,082千円	1,270,168千円	361千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.24	0.28	0.35	1.04

(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2月13日～2018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

2018年11月20日現在

種類	当期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	8,877	15,103
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	8,947	15,120
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	17,471	15,545
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	15,976	15,440
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11,639	15,403
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	15,618	15,348
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	10,434	15,751
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	15,202	15,665

(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33,015,590千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが88,596,175千口、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドが1,844,866千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが91,553,091千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが13,426,526千口、ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンドが1,012,672千口、ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンドが11,518,929千口、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドが1,958,293千口です。

投資信託財産の構成

2018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	15,103	12.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	15,120	12.2
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	15,545	12.6
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	15,440	12.5
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15,403	12.4
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	15,348	12.4
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	15,751	12.7
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	15,665	12.7
コール・ローン等、その他	364	0.3
投資信託財産総額	123,742	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1香港ドル14.38円、1シンガポール・ドル82.17円、1ニュージーランド・ドル77.08円、1台湾ドル3.64円、1イギリス・ポンド144.81円、1イスラエル・シケル30.43円、1スイス・フラン113.42円、1トルコ・リラ21.20円、1デンマーク・クローネ17.28円、1ノルウェー・クローネ13.28円、1スウェーデン・クローナ12.51円、1メキシコ・ペソ5.54円、1フィリピン・ペソ2.14円、100チリ・ペソ16.85円、100コロンビア・ペソ3.55円、1インド・ルピー1.59円、100インドネシア・ルピア0.78円、1ブラジル・レアル29.94円、1チェコ・コルナ4.96円、100韓国ウォン10.00円、1人民元16.24円、1マレーシア・リンギット26.90円、1南アフリカ・ランド8.02円、1タイ・バーツ3.41円、1ポーランド・ズロチ29.79円、100ハンガリー・フォリント40.15円、1ユーロ128.98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（146,483,125千円）の投資信託財産総額（150,189,252千円）に対する比率は97.5%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（1,564,539千円）の投資信託財産総額（1,661,836千円）に対する比率は94.1%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（17,731,935千円）の投資信託財産総額（17,866,645千円）に対する比率は99.2%です。
 ニッセイ新興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（992,826千円）の投資信託財産総額（995,253千円）に対する比率は99.8%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（2,008,922千円）の投資信託財産総額（2,098,061千円）に対する比率は95.8%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	123,742,796円
コール・ローン等	44,026
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド（評価額）	15,103,173
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド（評価額）	15,120,598
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）	15,545,932
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド（評価額）	15,440,109
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	15,403,951
ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド（評価額）	15,348,294
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド（評価額）	15,751,240
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）	15,665,004
未収入金	320,469
(B)負債	365,112
未払解約金	316,158
未払信託報酬	46,151
その他未払費用	2,803
(C)純資産総額(A-B)	123,377,684
元本	121,367,121
次期繰越損益金	2,010,563
(D)受益権総口数	121,367,121口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,166円

(注) 設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 154,808,418円
 期中一部解約元本額 34,441,297円

損益の状況

当期 (2018年2月13日～2018年11月20日)

項目	当期
(A)有価証券売買損益	△ 348,716円
売	2,655,310
買	△ 3,004,026
(B)信託報酬等	△ 116,795
(C)当期損益金(A+B)	△ 465,511
(D)追加信託差損益金*	2,476,074
(売買損益相当額)	(2,476,074)
(E)合計(C+D)	2,010,563
次期繰越損益金(E)	2,010,563
追加信託差損益金	2,476,074
(売買損益相当額)	(2,476,074)
繰越欠損金	△ 465,511

(注1) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (B)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) (D)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。設定時の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

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	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	2,010,563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)	2,010,563円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	165.66円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

代表取締役社長に西啓介が就任いたしました。

(2018年3月25日)

■自社による当ファンドの設定解約状況

当期 設定元本	当期 解約元本	当期末残高			取引の理由
		元本	評価額	比率	
百万円	百万円	百万円	百万円	%	
1	-	1	1	0.8	当初設定時における取得

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

■約款変更

信託報酬率の上限引き下げに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

(2018年8月21日)

■自社および関連会社の実質保有比率

2018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	55.9
ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド	98.5

(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	13.6
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	97.9

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、債券およびリート（不動産投資信託）市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(8資産均等型)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ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」「ニッセイ新興国債券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」 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
	ニッセイ新興国債券 インデックスマザーファンド	新興国の米ドル建て公社債
	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	日本を除く各国の金融商品取引所に上場している先進国のリート

<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）

運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(8資産均等型)	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の8分の1ずつとします。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ外国株式 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。
	ニッセイ新興国債券 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。
	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。	
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。	

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 18 期

(計算期間：2017年2月21日～2018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。



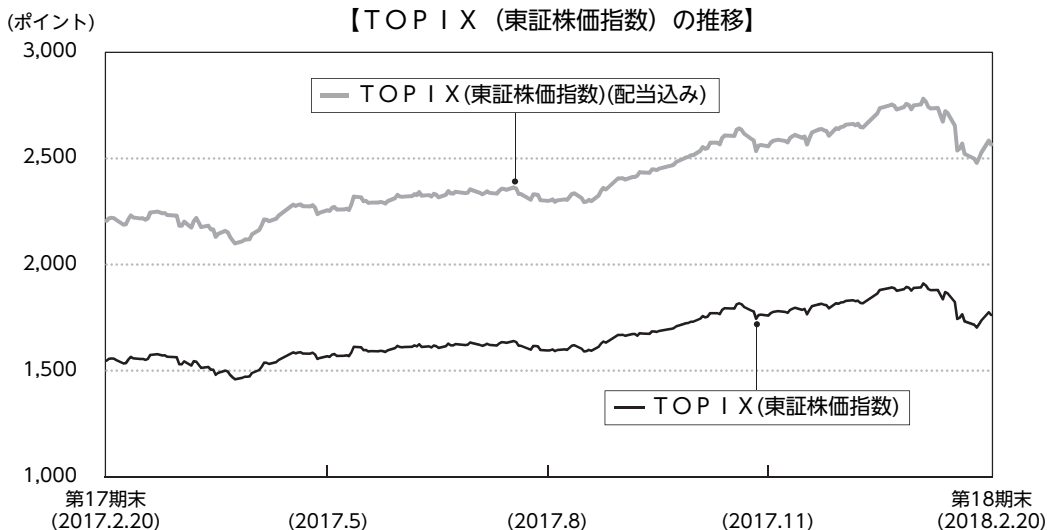
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年2月21日～2018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おおむね上昇しました。

期初以降、株価は為替市場の変動を背景にもみ合いとなりましたが、トランプ米政権の政策実現性に対する不透明感や、シリア・北朝鮮情勢の緊迫化などの地政学リスクに対する警戒感から、徐々に下落しました。

4月下旬には欧州政治に対する不透明感が薄らいだことや、トランプ米大統領が予告した税制改革案への期待、さらに北朝鮮情勢に対する懸念がやや後退したことなどを受け、株価は上昇基調に転じました。8月に北朝鮮が核弾頭の小型化に成功したとする報道から地政学リスクが強く意識され株価は下落しましたが、9月中旬には米国と北朝鮮の軍事衝突を回避できるとの見方が広がり、解散総選挙をめぐる思惑なども相まって株価は上昇しました。

11月中旬以降は米税制改革への思惑などから上下しつつもおおむね上昇基調で推移しましたが、2月に入ると米金利上昇などを受けた米国株の急落と円高を受けて大きく下落しました。結局、期を通じて見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

当期の基準価額は、国内株式市場が上昇したことから同様の動きとなりました。期初以降、トランプ米政権の政策実現性に対する不透明感や、北朝鮮情勢の緊迫化などの地政学リスクに対する警戒感などから株価が下落したため、基準価額も下落しましたが、4月下旬には地政学リスクに対する警戒感の後退などから上昇に転じました。その後、上下しましたが、9月以降は堅調な企業業績などからおおむね上昇しました。

11月中旬以降は米税制改革への思惑などを受けた株価変動により、基準価額は上下しつつも、おおむね上昇しました。2月に入ると米金利上昇などを起因とする米国株の急落や、円高を受けて大きく下落しましたが、期を通じて見ると上昇し、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。

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+16.3%となり、ベンチマーク騰落率（+16.3%）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。

■ お知らせ

■ 約款変更

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

(2017年8月18日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2014年 2月20日)	11,293	24.9	11,401	25.1	98.6	1.4	31,810
15期(2015年 2月20日)	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3	42,826
16期(2016年 2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年 2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998
18期(2018年 2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868

(注1) ベンチマークはTOPIX(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。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	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)2017年 2月20日	15,544	-	15,699	-	97.7	2.3
2月末	15,431	△ 0.7	15,584	△ 0.7	97.5	2.6
3月末	15,338	△ 1.3	15,493	△ 1.3	95.2	4.7
4月末	15,535	△ 0.1	15,690	△ 0.1	97.5	2.4
5月末	15,914	2.4	16,065	2.3	97.4	2.7
6月末	16,373	5.3	16,541	5.4	97.6	2.5
7月末	16,441	5.8	16,611	5.8	98.3	1.8
8月末	16,435	5.7	16,603	5.8	96.3	3.6
9月末	17,148	10.3	17,324	10.4	95.9	2.9
10月末	18,081	16.3	18,268	16.4	97.5	2.6
11月末	18,353	18.1	18,539	18.1	96.4	3.6
12月末	18,636	19.9	18,830	19.9	98.1	2.1
2018年 1月末	18,834	21.2	19,030	21.2	97.8	2.1
(期末)2018年 2月20日	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2017年2月21日～2018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)	0.002 (0.002)	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	0.004	

(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（16,939円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年2月21日～2018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
		4,833 (△4,545)	8,639,552	3,087	4,302,187

(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) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
国内		証券	千円	証券	千円
		— (2,400)	—	2,400	630

(注1) ()内は割当、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内 株式先物取引	百万円 14,508	百万円 14,632	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2017年2月21日～2018年2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
トヨタ自動車	38	264,789	6,931	日本電信電話	22	118,822	5,376
三菱UFJフィナンシャル・グループ	203	157,126	772	三菱UFJフィナンシャル・グループ	151	113,549	750
キーエンス	2	131,795	59,907	東芝	410	101,490	247
ソフトバンクグループ	13	123,528	8,886	トヨタ自動車	13	83,348	6,266
日本電信電話	20	107,113	5,125	KDDI	22	67,116	3,036
本田技研工業	28	103,003	3,639	三井住友フィナンシャルグループ	14	62,677	4,413
三井住友フィナンシャルグループ	21	99,723	4,595	ソニー	12	52,734	4,218
ソニー	19	92,724	4,779	ファナック	2	48,494	24,247
みずほフィナンシャルグループ	420	85,404	203	野村ホールディングス	68	46,518	678
日本郵政	64	83,888	1,310	武田薬品工業	7	45,131	6,098

(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。

(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
-	-	-	-	フージャースホールディングス	2,400	630	263

(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。

組入有価証券明細表

2018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	0.800	0.900	3,505
日本水産	25	25	13,450
マルハニチロ	3	4	14,049
カネコ種苗	0.800	0.900	1,434
サカタのタネ	2	3	12,144
ホクト	2	2	4,749
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	2	7	1,106
日鉄鉱業	0.600	0.600	4,248
三井松島産業	1	1	1,652
国際石油開発帝石	104	107	143,075
日本海洋掘削	0.700	0.800	1,744
石油資源開発	3	3	9,110
K&Oエナジーグループ	1	1	2,216
建設業(3.1%)			
ショーボンドホールディングス	2	2	15,498
ミライト・ホールディングス	6	6	11,186
タマホーム	-	1	1,997
サンヨーホームズ	1	-	-
ベステラ	-	0.800	1,477
インベスターズクラウド	-	1	3,826
ダイセキ環境ソリューション	0.800	1	1,399
安藤・間	14	17	13,491
東急建設	7	8	10,225
コムシスホールディングス	7	7	21,801
ミサワホーム	2	1	1,672
高松コンストラクショングループ	1	1	4,117
東建コーポレーション	0.800	0.800	9,544
ソネック	-	1	1,404
ヤマウラ	2	1	1,384
大成建設	101	22	119,340
大林組	59	66	79,520
清水建設	61	67	68,782
飛鳥建設	19	20	3,737
長谷工コーポレーション	23	25	40,507
松井建設	2	2	2,018

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
銭高組	3	0.300	1,710
鹿島建設	87	98	98,784
不動テトラ	16	16	3,276
大木建設	-	0.700	749
鉄建建設	12	1	4,004
西松建設	23	5	14,030
三井住友建設	76	16	10,032
大豊建設	7	8	4,976
前田建設工業	12	15	20,066
佐田建設	2	2	1,412
ナカノフドー建設	-	2	1,401
奥村組	16	3	17,353
東鉄工業	2	2	8,842
浅沼組	7	8	3,680
戸田建設	23	26	21,138
熊谷組	31	3	11,235
青木あすなろ建設	1	1	1,525
北野建設	4	5	2,305
植木組	5	0.500	1,359
三井ホーム	3	3	2,109
矢作建設工業	2	3	2,556
ピーエス三菱	3	2	2,249
日本ハウスホールディングス	4	4	2,658
大東建託	7	8	148,040
新日本建設	2	2	2,659
NIPPPO	5	5	13,101
東亜道路工業	4	0.400	1,688
前田道路	6	7	16,233
日本道路	6	0.600	3,516
東亜建設工業	1	1	3,972
若築建設	11	1	2,020
東洋建設	5	7	3,815
五洋建設	22	26	20,750
大林道路	2	-	-
世紀東急工業	2	3	2,121
福田組	3	0.700	4,641
住友林業	13	14	26,554

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本基礎技術	3	3	3	1,397
日成ビルド工業	6	3	3	4,072
巴コーポレーション	3	2	2	1,629
パナホーム	7	-	-	-
大和ハウス工業	58	65	260,563	
ライト工業	3	4	5,061	
積水ハウス	62	72	137,468	
日特建設	2	2	1,449	
北陸電気工事	1	1	1,374	
ユアテック	3	3	3,038	
西部電気工業	0.500	-	-	
四電工	3	0.500	1,387	
中電工	2	2	8,581	
関電工	8	8	10,700	
きんでん	13	14	25,988	
東京エネシス	2	2	3,005	
トーエネック	3	0.600	1,881	
住友電設	1	1	4,105	
日本電設工業	3	3	7,398	
協和エクシオ	7	8	22,736	
新日本空調	1	1	2,754	
NDS	0.400	0.300	1,371	
九電工	3	4	22,044	
三機工業	4	4	5,499	
日揮	18	19	46,107	
中外炉工業	6	0.700	1,656	
ヤマト	-	1	1,510	
太平電業	3	1	3,946	
高砂熱学工業	5	6	12,108	
三晃金属工業	-	0.300	1,242	
朝日工業社	0.500	0.500	1,812	
明星工業	3	4	3,080	
大気社	2	2	10,846	
ダイダシ	3	1	3,499	
日比谷総合設備	2	2	5,065	
東芝プラントシステム	3	4	10,286	
OSJBホールディングス	6	9	3,028	
東洋エンジニアリング	12	2	2,613	
千代田化工建設	14	14	15,494	
新興プランテック	4	4	4,373	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
食料品(4.2%)				
日本製粉	5	6	10,850	
日清製粉グループ本社	21	24	51,200	
昭和産業	8	1	5,043	
鳥越製粉	1	1	1,767	
中部飼料	2	2	4,860	
フィード・ワン	12	13	3,229	
東洋精糖	-	1	1,353	
日本甜菜製糖	1	1	2,626	
三井製糖	1	1	6,824	
塩水港精糖	4	5	1,438	
日新製糖	0.800	0.900	1,978	
森永製菓	3	4	23,876	
中村屋	0.500	0.500	2,400	
江崎グリコ	5	5	29,792	
名糖産業	-	1	1,568	
井村屋グループ	-	0.800	3,376	
不二家	11	1	3,291	
山崎製パン	14	16	34,572	
モロゾフ	3	0.300	2,037	
亀田製菓	1	1	6,204	
寿スピリッツ	1	1	11,647	
カルビー	8	9	33,260	
森永乳業	18	4	17,520	
六甲バター	0.900	1	2,305	
ヤクルト本社	10	11	91,273	
明治ホールディングス	11	13	105,193	
雪印メグミルク	4	4	13,392	
プリマハム	13	14	9,254	
日本ハム	14	17	40,698	
林兼産業	1	-	-	
丸大食品	10	11	5,522	
S Foods	1	1	5,999	
伊藤ハム米久ホールディングス	11	12	11,968	
サッポロホールディングス	6	7	23,396	
アサヒグループホールディングス	37	41	231,088	
キリンホールディングス	85	95	266,819	
宝ホールディングス	14	14	19,697	
オエノンホールディングス	5	5	2,262	
養命酒製造	0.600	0.600	1,387	

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
コカ・コーラ ホトラーズジャパンホールディングス	6	14	14	52,710
コカ・コーライーストジャパン	7	-	-	-
サントリー食品インターナショナル	13	15	15	75,772
ダイドーグループホールディングス	0.900	1	1	6,470
伊藤園	5	6	6	29,700
キーコーヒー	1	2	2	4,312
ユニカフェ	1	-	-	-
日清オイリオグループ	11	2	2	6,840
不二製油グループ本社	5	5	5	17,037
かどや製油	-	0.200	0.200	1,312
J-オイルミルズ	0.900	1	1	3,700
キッコーマン	14	15	15	65,875
味の素	41	45	45	90,371
キューピー	10	11	11	33,211
ハウス食品グループ本社	7	7	7	28,272
カゴメ	7	8	8	29,800
焼津水産化学工業	-	1	1	1,429
アリアケジャパン	1	1	1	14,490
ピエトロ	0.700	0.800	0.800	1,341
エバラ食品工業	0.600	0.700	0.700	1,509
ニチレイ	9	9	9	25,241
東洋水産	9	10	10	45,834
日清食品ホールディングス	7	8	8	64,641
永谷園ホールディングス	2	2	2	3,120
一正蒲鉾	1	1	1	1,495
フジッコ	1	2	2	5,145
ロック・フィールド	2	2	2	4,489
日本たばこ産業	110	123	123	386,534
ケンコーマヨネーズ	0.700	1	1	4,797
わらべや日洋ホールディングス	1	1	1	3,396
なとり	1	1	1	2,142
ピクルスコーポレーション	-	0.800	0.800	1,452
北の達人コーポレーション	-	5	5	4,195
ユーグレナ	6	7	7	7,499
ミヨシ油脂	8	1	1	1,409
理研ビタミン	0.600	0.800	0.800	3,224
繊維製品(0.7%)				
片倉工業	2	2	2	3,316
グンゼ	14	1	1	8,790
東洋紡	74	7	7	16,016
ユニチカ	51	6	6	4,272

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
富士紡ホールディングス	0.900	1	1	5,046
倉敷紡績	19	21	21	7,182
シキボウ	10	1	1	1,400
日本毛織	5	5	5	6,425
ダイドーリミテッド	-	3	3	1,416
帝国繊維	1	2	2	4,481
帝人	15	17	17	37,060
東レ	135	150	150	164,797
サカイオーベックス	-	0.500	0.500	1,383
住江織物	5	0.500	0.500	1,483
日本フェルト	2	2	2	1,425
イチカワ	4	4	4	1,500
アツギ	15	1	1	1,698
セーレン	4	4	4	9,782
ソトー	1	1	1	1,387
東海染工	9	0.900	0.900	1,391
小松精練	2	3	3	2,969
ワコールホールディングス	11	5	5	18,069
ホギメディカル	1	1	1	11,037
レナウン	10	-	-	-
クラウドディアホールディングス	-	2	2	1,400
T S Iホールディングス	7	7	7	5,912
マツオカコーポレーション	-	0.400	0.400	1,470
三陽商会	10	1	1	2,574
オンワードホールディングス	12	12	12	11,271
ゴールドウイン	0.800	0.600	0.600	7,164
デサント	4	4	4	8,187
キング	2	0.100	0.100	65
ヤマトインターナショナル	3	2	2	1,392
パルプ・紙(0.3%)				
特種東海製紙	1	1	1	4,631
王子ホールディングス	73	87	87	61,770
日本製紙	8	9	9	20,041
三菱製紙	2	3	3	2,115
北越紀州製紙	10	11	11	8,085
中越パルプ工業	7	0.800	0.800	1,574
大王製紙	7	8	8	12,665
阿波製紙	1	2	2	1,454
レンゴー	17	20	20	18,210
トーモク	6	1	1	2,522
ザ・バック	1	1	1	5,385

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
化学(7.2%)				
クラレ	31	34	66,065	
旭化成	116	129	173,525	
共和レザー	1	1	1,383	
昭和電工	12	13	70,104	
住友化学	137	153	102,816	
住友精化	0.800	0.900	4,950	
日産化学工業	10	12	48,158	
ラサ工業	9	0.700	1,700	
クレハ	1	1	13,572	
多木化学	-	0.300	1,315	
テイカ	3	1	4,385	
石原産業	3	3	5,387	
片倉コープアグリ	-	1	1,377	
日東エフシー	-	0.100	79	
日本曹達	11	14	9,142	
東ソー	54	30	68,250	
トクヤマ	29	6	18,690	
セントラル硝子	19	4	10,248	
東亜合成	11	12	14,762	
大阪ソーダ	8	1	5,268	
関東電化工業	4	5	6,150	
デンカ	39	7	29,260	
信越化学工業	33	34	391,672	
日本カーバイド工業	8	0.700	1,576	
堺化学工業	7	1	4,361	
エア・ウォーター	15	17	36,405	
大陽日酸	14	16	25,200	
日本化学工業	7	0.800	2,536	
日本パーカライズिंग	9	10	20,171	
高圧ガス工業	2	3	2,706	
四国化成工業	3	3	4,539	
戸田工業	4	0.400	1,486	
ステラ ケミファ	0.900	1	2,967	
保土谷化学工業	0.600	0.700	3,353	
日本触媒	2	3	24,717	
大日精化工業	8	1	7,424	
カネカ	25	28	30,044	
三菱瓦斯化学	17	17	44,665	
三井化学	85	18	62,181	
J S R	18	20	49,742	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東京応化工業	3	3	14,706	
大阪有機化学工業	1	1	2,035	
三菱ケミカルホールディングス	125	139	151,440	
KHネオケム	2	3	9,904	
ダイセル	25	28	33,432	
住友ベークライト	16	17	15,181	
積水化学工業	42	43	85,036	
日本ゼオン	16	17	27,195	
アイカ工業	6	5	23,751	
宇部興産	94	10	36,172	
積水樹脂	2	3	7,948	
タキロンシーアイ	4	4	3,011	
旭有機材	6	1	2,583	
日立化成	10	10	24,833	
ニチバン	2	1	3,250	
リケンテクノス	4	4	2,407	
大倉工業	4	5	2,885	
積水化成成品工業	2	2	3,023	
群栄化学工業	0.400	0.500	1,757	
タイガースポリマー	1	-	-	
ミライアル	1	0.700	1,418	
ダイキアクシス	1	-	-	
ダイキョーニシカワ	3	4	7,564	
森六ホールディングス	-	0.800	2,476	
日本化薬	12	13	18,630	
カーリットホールディングス	2	1	2,213	
日本精化	1	1	2,102	
扶桑化学工業	1	1	4,297	
A D E K A	8	8	17,568	
日油	15	8	23,488	
新日本理化	7	5	1,459	
ハリマ化成グループ	1	1	1,419	
花王	47	48	384,194	
第一工業製薬	4	4	3,156	
ニイタカ	-	0.500	924	
三洋化成工業	1	1	6,799	
有機合成薬品工業	-	4	1,406	
大日本塗料	11	2	3,772	
日本ペイントホールディングス	14	16	59,280	
関西ペイント	19	21	57,770	
中国塗料	5	5	6,436	

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
日本特殊塗料	1	1	2,619
藤倉化成	2	2	1,747
太陽ホールディングス	1	1	7,864
D I C	7	8	31,406
サカタインクス	3	4	5,817
東洋インキSCホールディングス	18	21	13,650
T & K T O K A	1	1	1,919
富士フィルムホールディングス	36	41	179,838
資生堂	35	36	234,315
ライオン	23	27	58,926
高砂香料工業	1	1	3,840
マンダム	1	3	14,898
ミルボン	1	2	10,959
ファンケル	4	4	16,392
コーセー	3	3	70,210
コタ	-	0.900	1,740
シーズ・ホールディングス	2	2	16,254
シーボン	0.200	0.400	1,372
ポーラ・オルビスホールディングス	1	8	39,355
ノエビアホールディングス	1	1	10,582
アジュバンコスメジャパン	1	1	1,410
エステー	1	1	3,106
アグロ カネショウ	1	0.800	1,892
コニシ	2	3	6,141
長谷川香料	2	2	5,317
星光PMC	1	1	1,404
小林製薬	5	5	39,368
荒川化学工業	1	1	3,448
メック	1	1	2,489
日本高純度化学	0.500	0.600	1,540
タカラバイオ	4	5	10,389
J C U	0.600	1	5,760
デクセリアルズ	4	5	6,981
アース製薬	1	1	7,875
イハラケミカル工業	2	-	-
北興化学工業	-	2	1,508
大成ラミック	0.500	0.600	1,896
クミアイ化学工業	3	9	5,868
日本農薬	4	5	3,120
アキレス	1	1	3,199
有沢製作所	3	3	3,121

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日東電工	13	15	125,715
レック	0.600	1	3,762
きもと	5	-	-
藤森工業	1	1	6,205
前澤化成工業	1	1	1,633
J S P	0.900	1	3,954
エフピコ	1	1	9,504
天馬	1	1	3,307
信越ポリマー	3	4	5,088
東リ	4	4	1,896
ニフコ	3	3	27,036
日本バルカー工業	1	1	5,088
ユニ・チャーム	37	42	126,798
医薬品(4.6%)			
協和発酵キリン	22	24	57,734
武田薬品工業	69	73	431,430
アステラス製薬	190	203	310,897
大日本住友製薬	13	14	25,269
塩野義製薬	25	28	157,829
田辺三菱製薬	21	24	55,563
わかもと製薬	-	5	1,410
あすか製薬	2	2	4,972
日本新薬	4	5	32,708
ビオフェルミン製薬	0.400	0.500	1,461
中外製薬	18	20	115,920
科研製薬	3	3	22,248
エーザイ	22	23	132,933
ロート製薬	9	10	33,027
小野薬品工業	42	46	142,038
久光製薬	5	5	43,365
持田製薬	1	1	10,906
参天製薬	34	37	65,100
扶桑薬品工業	0.600	0.700	1,974
日本ケミファ	0.300	-	-
ツムラ	6	7	24,885
日医工	4	5	8,964
キッセイ薬品工業	3	3	10,792
生化学工業	3	3	7,987
栄研化学	1	1	7,928
日水製薬	0.300	-	-
鳥居薬品	1	1	3,301

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
JCRファーマ	1	1	1	7,462
東和薬品	0.900	1	1	6,890
富士製薬工業	0.600	0.700	0.700	3,206
沢井製薬	3	4	4	20,360
ゼリア新薬工業	3	4	4	9,021
第一三共	54	56	56	219,882
キョーリン製薬ホールディングス	4	5	5	11,434
大幸薬品	0.900	1	1	2,098
ダイト	1	1	1	4,182
大塚ホールディングス	40	41	41	208,554
大正製薬ホールディングス	4	4	4	43,164
ペプチドリーム	3	8	8	41,607
石油・石炭製品(0.7%)				
日本コークス工業	15	16	16	1,898
昭和シェル石油	16	18	18	25,585
ニチレキ	2	2	2	3,410
東燃ゼネラル石油	30	-	-	-
ユシロ化学工業	1	1	1	2,101
ビーピー・カストロール	0.900	0.800	0.800	1,420
富士石油	4	4	4	2,209
MORESCO	0.700	0.700	0.700	1,359
出光興産	8	16	16	66,566
JXTGホールディングス	206	316	316	207,680
コスモエネルギーホールディングス	5	5	5	22,794
ゴム製品(0.9%)				
横浜ゴム	11	11	11	30,751
東洋ゴム工業	9	11	11	22,885
ブリヂストン	62	70	70	336,770
住友ゴム工業	17	20	20	43,329
藤倉ゴム工業	-	1	1	1,404
オカモト	6	7	7	7,735
フコク	0.800	0.900	0.900	943
ニッタ	1	2	2	8,270
住友理工	3	3	3	4,104
三ツ星ベルト	5	5	5	5,870
バンダー化学	3	3	3	4,666
ガラス・土石製品(1.0%)				
日東紡績	15	2	2	7,441
旭硝子	92	20	20	92,060
日本板硝子	8	10	10	8,970
日本山村硝子	8	8	8	1,472

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本電気硝子	38	8	8	29,326
オハラ	-	0.800	0.800	2,424
住友大阪セメント	35	39	39	18,759
太平洋セメント	112	12	12	50,125
日本ヒューム	1	2	2	1,610
日本コンクリート工業	4	4	4	1,956
三谷セキサン	0.900	1	1	2,516
アジアパイルホールディングス	2	2	2	1,700
東海カーボン	17	18	18	33,876
日本カーボン	9	1	1	5,810
東洋炭素	1	1	1	4,634
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	1	6,432
TOTO	13	15	15	86,184
日本碍子	23	24	24	49,005
日本特殊陶業	16	17	17	46,172
MARUWA	0.700	0.700	0.700	5,936
品川リフラクトリーズ	5	0.500	0.500	1,547
黒崎播磨	4	0.400	0.400	2,012
ヨータイ	-	0.500	0.500	426
東京窯業	6	3	3	1,357
ニッカトー	3	1	1	1,458
フジミインコーポレーテッド	1	1	1	4,730
エーアンドエーマテリアル	-	1	1	1,379
ニチアス	10	11	11	14,916
ニチハ	2	3	3	13,065
鉄鋼(1.1%)				
新日鐵住金	83	87	87	224,731
神戸製鋼所	32	35	35	43,439
中山製鋼所	2	2	2	1,911
合同製鐵	1	1	1	2,244
ジェイエフイーホールディングス	50	52	52	133,995
日新製鋼	8	5	5	8,445
東京製鐵	9	10	10	9,072
共英製鋼	2	2	2	4,342
大和工業	3	4	4	13,503
東京鐵鋼	4	0.800	0.800	1,420
大阪製鐵	1	1	1	2,757
淀川製鋼所	2	2	2	9,091
東洋鋼鈑	4	5	5	3,565
丸一鋼管	6	6	6	23,460
モリ工業	0.600	0.600	0.600	2,403

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大同特殊鋼	31	3	20,440
日本高周波鋼業	—	1	1,378
日本冶金工業	15	16	5,394
山陽特殊製鋼	11	2	5,605
愛知製鋼	1	1	5,186
日立金属	18	21	30,236
日本金属	1	0.500	1,373
大太平洋金属	12	1	3,858
新日本電工	10	11	4,586
栗本鐵工所	0.900	1	2,115
三菱製鋼	13	1	3,728
日亜鋼業	4	3	1,415
日本精線	2	0.300	1,486
シンニッタン	0.200	0.700	584
新家工業	8	0.600	1,479
非鉄金属(1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	3	3	2,630
日本軽金属ホールディングス	42	57	16,645
三井金属鉱業	51	5	27,295
東邦亜鉛	10	1	6,523
三菱マテリアル	11	12	43,344
住友金属鉱山	48	25	128,275
DOWAホールディングス	21	5	19,950
古河機械金属	29	3	7,372
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	5,852
東邦チタニウム	3	3	5,369
UACJ	24	3	7,839
古河電気工業	6	6	37,115
住友電気工業	70	73	123,730
フジクラ	24	23	18,272
昭和電線ホールディングス	22	2	2,455
東京特殊電線	—	0.300	958
タツタ電線	3	3	2,792
カナレ電気	0.600	0.600	1,324
平河ヒューテック	1	1	1,436
リョービ	11	2	6,840
アーレスティ	2	2	2,316
アサヒホールディングス	2	3	6,973
金属製品(0.7%)			
稲葉製作所	1	1	1,485
宮地エンジニアリンググループ	—	0.600	1,440

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トーカロ	1	1	7,756
アルファ	—	0.700	1,321
SUMCO	19	18	50,976
川田テクノロジーズ	0.400	0.400	2,476
RS Technologies	—	0.300	2,049
東洋製罐グループホールディングス	13	13	20,890
ホッカンホールディングス	5	5	1,950
コロナ	1	1	1,482
横河ブリッジホールディングス	3	3	8,913
高田機工	5	0.300	1,332
三和ホールディングス	18	18	27,824
文化シャッター	5	5	5,747
三協立山	2	2	4,141
アルインコ	1	1	1,604
LIXILグループ	25	28	77,076
日本ファイルコン	2	2	1,445
ノーリツ	3	4	8,681
長府製作所	2	2	5,431
リンナイ	3	3	34,335
ダイニチ工業	1	1	1,403
日東精工	2	2	1,714
三洋工業	—	0.500	1,074
岡部	3	4	3,968
ジーテクト	1	2	4,642
東プレ	3	3	11,488
高周波熱錬	3	3	4,180
東京製網	1	1	2,788
サンコール	2	1	1,427
モリテックスチール	4	1	1,479
パイオラックス	0.900	2	8,499
エイチワン	—	1	1,978
日本発条	17	19	20,767
アドバネクス	0.700	—	—
立川ブラインド工業	—	1	1,436
三益半導体工業	1	1	2,937
機械(5.6%)			
日本ドライケミカル	0.500	0.600	1,522
日本製鋼所	6	6	21,792
三浦工業	7	8	25,457
タクマ	6	6	8,679
ツガミ	5	5	7,470

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
オークマ	12	2	15,088	
東芝機械	11	11	8,426	
アマダホールディングス	25	30	43,065	
アイダエンジニアリング	5	5	7,025	
滝澤鉄工所	8	0.600	1,300	
富士機械製造	5	5	12,708	
牧野フライス製作所	9	10	10,750	
オーエスジー	8	9	22,509	
ダイジェット工業	7	0.700	1,509	
旭ダイヤモンド工業	5	5	7,418	
DMG森精機	11	10	23,209	
ソディック	4	4	6,054	
ディスコ	2	2	64,260	
日東工器	1	1	3,474	
日進工具	-	0.500	1,720	
パンチ工業	-	1	2,027	
豊和工業	2	1	1,689	
OKK	10	1	1,405	
石川製作所	1	0.500	1,485	
東洋機械金属	2	1	1,425	
津田駒工業	8	5	1,325	
島精機製作所	2	2	16,575	
オプトラン	-	1	5,446	
NCホールディングス	1	1	1,395	
フリュー	0.400	1	1,520	
ヤマシンフィルタ	-	2	3,277	
日阪製作所	2	2	3,068	
やまびこ	3	3	6,380	
平田機工	-	0.500	4,890	
ペガサスミシン製造	1	1	1,417	
ナプテスコ	9	10	47,952	
三井海洋開発	1	2	5,716	
レオン自動機	1	1	3,904	
SMC	5	6	283,836	
新川	1	1	1,798	
ホソカワミクロン	3	0.700	5,418	
ユニオンツール	0.800	0.900	3,676	
オイレス工業	2	2	5,967	
日精エー・エス・ビー機械	0.600	0.700	5,229	
サトーホールディングス	2	2	9,204	
技研製作所	-	1	2,837	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本エアーテック	1	1	1,391	
日精樹脂工業	1	1	2,700	
オカダアイオン	-	0.800	1,328	
小松製作所	85	95	383,374	
住友重機械工業	54	11	49,155	
日立建機	8	9	41,896	
日工	-	0.500	1,248	
巴工業	0.800	0.800	1,556	
井関農機	19	2	4,486	
TOWA	1	1	2,397	
丸山製作所	7	0.800	1,445	
北川鉄工所	0.900	0.900	2,521	
ローツェ	0.700	1	2,337	
タカキタ	-	1	1,342	
クボタ	89	106	210,367	
荏原実業	0.900	0.700	1,467	
三菱化工機	6	0.700	1,562	
月島機械	3	3	5,573	
帝国電機製作所	1	1	2,350	
新東工業	4	4	5,757	
澁谷工業	1	1	7,429	
アイチコーポレーション	2	3	2,478	
小森コーポレーション	4	5	6,870	
鶴見製作所	1	1	3,333	
住友精密工業	3	-	-	
酒井重工業	-	0.400	1,654	
荏原製作所	8	8	32,157	
石井鐵工所	0.200	0.700	1,410	
西島製作所	1	2	2,000	
北越工業	2	2	2,554	
ダイキン工業	24	27	342,630	
オルガノ	4	0.700	2,327	
トーヨーカネツ	9	0.800	2,852	
栗田工業	10	10	34,186	
椿本チエイン	11	12	10,836	
木村化工機	-	2	1,238	
アネスト岩田	3	3	3,636	
ダイフク	8	10	66,458	
サムコ	-	1	1,390	
加藤製作所	1	0.900	2,388	
油研工業	-	0.500	1,507	

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
タダノ	9	9	16,310	
フジテック	5	6	8,895	
CKD	5	5	13,909	
キトー	2	1	3,112	
平和	5	6	13,139	
理想科学工業	1	2	4,290	
SANKYO	4	5	19,600	
日本金銭機械	1	1	2,271	
マースエンジニアリング	1	1	3,190	
福島工業	1	1	5,826	
ダイコク電機	0.700	0.900	1,565	
竹内製作所	3	3	8,124	
アマノ	5	6	17,537	
JUKI	2	2	4,721	
サンデンホールディングス	11	2	3,964	
蛇の目マシン工業	1	1	1,380	
マックス	3	3	4,467	
グローリー	5	5	23,718	
新晃工業	1	2	3,924	
大和冷機工業	2	3	3,942	
セガサミーホールディングス	17	19	30,810	
日本ピストンリング	0.700	0.700	1,677	
リケン	0.800	0.900	5,445	
TPR	2	2	6,655	
ツバキ・ナカシマ	2	2	6,170	
ホシザキ	3	6	60,884	
大豊工業	1	1	2,505	
日本精工	36	40	65,242	
NTN	41	45	21,986	
ジェイテクト	18	21	35,701	
不二越	18	18	12,222	
日本トムソン	5	6	4,863	
THK	12	12	56,978	
ユーシン精機	0.800	0.900	3,100	
前澤給装工業	0.800	0.800	1,500	
イーグル工業	1	2	4,687	
日本ピラー工業	1	2	3,432	
キッツ	8	8	7,744	
日立工機	4	-	-	
マキタ	11	25	130,806	
日立造船	14	15	8,792	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
三菱重工業	298	33	145,017	
IHI	136	15	52,744	
スター精密	3	3	6,768	
電気機器(13.8%)				
日清紡ホールディングス	9	12	19,360	
イビデン	12	12	21,465	
コニカミノルタ	41	46	45,147	
ブラザー工業	23	24	62,581	
ミネベアミツミ	32	36	89,350	
日立製作所	426	476	395,175	
東芝	397	-	-	
三菱電機	189	198	362,423	
富士電機	54	60	48,960	
東洋電機製造	0.800	0.800	1,346	
安川電機	20	23	111,780	
シンフォニアテクノロジー	11	13	4,836	
明電舎	16	17	7,021	
オリジン電気	4	0.800	1,521	
山洋電気	5	1	8,310	
デンヨー	1	1	3,292	
東芝テック	11	14	9,156	
芝浦メカトロニクス	5	3	1,446	
マブチモーター	5	5	29,535	
日本電産	23	23	386,869	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	-	0.700	1,901	
東光高岳	0.900	1	1,600	
ダブル・スコープ	1	2	4,448	
ダイヘン	10	11	9,097	
田淵電機	3	-	-	
ヤーマン	0.200	2	4,956	
JVCケンウッド	13	14	5,278	
ミマキエンジニアリング	-	1	1,648	
第一精工	-	0.900	2,571	
日新電機	3	4	4,972	
大崎電気工業	4	4	3,326	
オムロン	18	21	129,343	
日東工業	2	3	5,836	
IDEC	2	2	7,002	
ジーエス・ユアサコーポレーション	34	36	21,276	
サクサホールディングス	5	-	-	
メルコホールディングス	1	1	3,560	

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
日本電気	244	25	82,304
富士通	171	204	130,539
沖電気工業	7	8	11,616
岩崎通信機	14	1	1,398
電気興業	5	1	3,564
サンケン電気	10	12	10,116
ナカヨ	3	-	-
アイホン	1	1	1,888
ルネサスエレクトロニクス	9	10	11,814
セイコーエプソン	26	29	61,035
ワコム	13	15	8,531
アルバック	3	4	28,474
E I Z O	1	1	9,126
ジャパンディスプレイ	33	40	8,791
日本信号	4	5	5,890
京三製作所	4	5	3,850
能美防災	2	2	6,112
ホーチキ	1	1	2,781
エレコム	1	1	3,981
日本無線	1	-	-
パナソニック	202	226	373,734
シャープ	-	13	48,369
アンリツ	12	14	19,008
富士通ゼネラル	6	6	12,408
日立国際電気	4	-	-
ソニー	125	132	700,660
T D K	10	10	95,992
帝国通信工業	7	1	1,352
タムラ製作所	7	7	6,004
アルプス電気	16	17	47,845
池上通信機	3	9	1,494
パイオニア	26	33	6,752
日本電波工業	1	2	1,416
鈴木	2	1	1,480
日本トリム	0.400	0.400	2,336
ローランド ディー. ジー.	0.900	1	2,675
フォスター電機	2	2	6,702
クラリオン	9	10	3,470
S M K	5	6	2,658
ヨコオ	1	1	2,888
ティアック	26	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホシデン	5	5	7,465
ヒロセ電機	2	3	49,184
日本航空電子工業	6	5	7,870
T O A	2	2	3,057
マクセルホールディングス	2	3	8,307
古野電気	2	2	1,783
ユニデンホールディングス	7	5	1,490
アルパイン	4	4	10,264
スミダコーポレーション	1	2	3,168
アイコム	1	1	3,038
リオン	0.800	0.800	2,316
本多通信工業	-	1	1,837
船井電機	2	2	1,536
横河電機	19	19	43,956
新元元工業	7	0.700	5,887
アズビル	5	5	27,818
東亜ディーケーケー	-	1	1,446
日本光電工業	7	8	23,845
チノー	1	0.800	1,326
共和電業	3	3	1,398
日本電子材料	2	2	1,420
堀場製作所	3	3	30,615
アドバンテスト	12	11	24,002
小野測器	1	1	1,363
エスベック	1	1	4,627
パナソニック デバイスSUNX	1	-	-
キーエンス	8	9	609,936
日置電機	0.900	1	3,535
シスメックス	13	15	134,134
日本マイクロニクス	3	3	3,753
メガチップス	1	1	5,920
O B A R A G R O U P	1	1	7,992
澤藤電機	6	0.700	1,537
コーセル	2	2	4,455
イリソ電子工業	0.600	1	11,560
新日本無線	-	1	1,398
オプテックスグループ	1	1	9,104
千代田インテグレ	0.900	1	2,428
アイ・オー・データ機器	-	1	1,445
レーザーテック	2	4	17,507
スタンレー電気	12	15	62,624

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
岩崎電気	6	0,900	1,486
ウシオ電機	10	12	17,472
岡谷電機産業	3	-	-
ヘリオス テクノ ホールディング	2	1	1,691
日本セラミック	1	2	5,870
遠藤照明	1	1	1,456
古河電池	2	1	1,456
双信電機	4	-	-
山一電機	1	1	2,595
図研	1	1	2,323
日本電子	6	7	5,712
カシオ計算機	14	15	24,168
ファナック	18	18	516,342
日本シイエムケイ	3	3	3,272
エンプラス	0.800	0.900	3,303
大真空	-	1	1,427
ローム	8	8	98,167
浜松ホトニクス	13	14	61,128
三井ハイテック	2	2	5,272
新光電気工業	6	7	6,765
京セラ	29	32	201,630
太陽誘電	8	8	15,744
村田製作所	18	20	313,456
ユーシン	2	3	2,256
双葉電子工業	2	3	7,084
北陸電気工業	-	0.800	1,334
ニチコン	5	6	8,208
日本ケミコン	15	1	4,473
KOA	2	2	6,280
市光工業	4	3	3,453
小糸製作所	10	11	88,060
ミツバ	3	3	4,856
SCREENホールディングス	3	3	35,446
キャノン電子	1	1	4,671
キャノン	95	106	421,785
リコー	53	59	70,387
MUTOHホールディングス	5	0.600	1,506
東京エレクトロン	11	13	267,432
輸送用機器(9.0%)			
トヨタ紡織	6	5	13,403
芦森工業	-	0.600	1,429

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニプレス	3	3	9,842
豊田自動織機	16	16	108,800
モリタホールディングス	3	3	6,380
三櫻工業	2	2	1,947
デンソー	43	44	274,164
東海理化電機製作所	4	5	11,996
三井造船	64	7	14,256
川崎重工業	138	15	61,677
名村造船所	5	5	3,722
サノヤスホールディングス	4	-	-
日本車輛製造	6	7	2,177
三菱ロジスネクスト	2	2	2,188
近畿車輛	-	0.500	1,372
日産自動車	212	233	261,042
いすゞ自動車	51	57	99,962
トヨタ自動車	215	240	1,755,672
日野自動車	25	28	41,148
三菱自動車工業	65	73	61,205
エフテック	0.900	1	1,697
レシップホールディングス	0.300	0.900	802
GMB	1	-	-
ファルテック	0.900	-	-
武蔵精密工業	2	2	7,927
日産車体	7	7	7,861
新明和工業	7	8	8,135
極東開発工業	3	3	6,175
日信工業	4	4	7,552
トピー工業	1	1	5,136
ティラド	7	0.700	2,772
曙ブレーキ工業	8	9	2,925
タチエス	3	3	6,395
NOK	8	10	24,051
フタバ産業	5	6	5,770
KYB	20	2	11,529
大同メタル工業	2	2	3,302
プレス工業	9	10	6,919
ミクニ	3	2	1,727
カルソニックカンセイ	12	-	-
太平洋工業	3	4	6,002
ケーヒン	4	4	9,793
河西工業	2	2	3,489

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アイシン精機	16	16	100,734	
マツダ	56	62	93,362	
今仙電機製作所	1	1	2,176	
本田技研工業	159	178	674,865	
スズキ	35	39	234,070	
S U B A R U	55	61	229,887	
安永	0.700	1	2,541	
ヤマハ発動機	25	28	96,040	
ショーワ	4	5	7,527	
T B K	2	2	1,406	
エクセディ	2	2	8,184	
豊田合成	5	7	18,684	
愛三工業	3	3	4,343	
盟和産業	-	1	1,362	
ヨロズ	1	2	3,730	
エフ・シー・シー	2	3	9,680	
シマノ	7	8	124,400	
タカタ	3	-	-	
テイ・エス テック	4	4	19,274	
ジャムコ	1	1	2,393	
精密機器(1.6%)				
テルモ	27	30	167,200	
クリエートメディック	-	1	1,389	
日機装	6	6	8,445	
島津製作所	22	23	63,279	
J M S	4	0.100	62	
長野計器	1	1	1,960	
ブイ・テクノロジー	0.400	0.500	11,895	
東京計器	6	1	1,558	
オーバル	3	4	1,430	
東京精密	3	3	15,786	
マニー	2	2	9,468	
ニコン	31	34	73,968	
トプコン	8	10	25,143	
オリンパス	28	29	124,342	
理研計器	1	1	4,235	
タムロン	1	1	3,963	
H O Y A	36	40	222,818	
シード	-	0.300	1,411	
ノーリツ鋼機	1	2	4,408	
エー・アンド・デイ	2	2	1,383	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
シチズン時計	19	23	19,753	
リズム時計工業	7	0.800	1,788	
大研医器	1	1	1,421	
メニコン	1	2	6,893	
松風	0.900	1	1,441	
セイコーホールディングス	13	3	8,962	
ニプロ	12	13	21,577	
その他製品(2.2%)				
スノーピーク	0.400	1	1,432	
パラマウントベッドホールディングス	1	2	12,096	
S H O - B I	2	3	1,490	
ニホンフラッシュ	0.900	0.900	2,331	
前田工織	1	2	4,010	
永大産業	-	3	1,710	
アートネイチャー	1	2	1,581	
ダンロップスポーツ	1	-	-	
バンダイナムコホールディングス	19	20	73,185	
共立印刷	3	-	-	
S H O E I	0.800	0.900	4,104	
フランスベッドホールディングス	2	2	2,389	
パイロットコーポレーション	3	3	19,320	
萩原工業	0.500	1	1,962	
トッパン・フォームズ	3	4	5,132	
フジシールインターナショナル	4	4	15,576	
タカラトミー	6	8	9,271	
廣済堂	3	2	1,406	
A s - m e エステール	1	-	-	
アーク	9	11	1,423	
タカノ	1	1	1,452	
プロネクサス	1	1	2,500	
ホクシン	5	7	1,401	
ウッドワン	-	1	1,458	
大建工業	1	1	3,963	
凸版印刷	50	56	52,696	
大日本印刷	51	25	59,259	
図書印刷	3	1	1,440	
共同印刷	5	0.600	1,908	
N I S S H A	3	4	11,713	
光村印刷	5	-	-	
宝印刷	0.900	1	1,848	
アシックス	17	19	33,233	

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
ツツミ	0.700	0.700	1,493
小松ウオール工業	0.600	0.700	1,760
ヤマハ	12	13	62,842
河合楽器製作所	0.700	0.700	2,723
フリナップ	2	1	1,515
ピジョン	10	12	52,860
キングジム	1	1	1,595
リンテック	4	4	14,382
イトーキ	3	4	2,952
任天堂	10	12	572,912
三菱鉛筆	1	3	8,200
タカラスタンダード	3	4	7,531
コクヨ	9	9	18,306
グローブライド	0.900	0.900	2,093
岡村製作所	6	6	10,018
美津濃	10	2	6,390
電気・ガス業(1.5%)			
東京電力ホールディングス	150	158	65,969
中部電力	58	60	85,597
関西電力	72	80	106,494
中国電力	24	27	34,140
北陸電力	17	19	16,334
東北電力	44	46	64,681
四国電力	16	17	21,787
九州電力	39	43	53,917
北海道電力	16	19	13,134
沖縄電力	2	3	9,225
電源開発	14	15	43,718
エフオン	1	1	1,282
イーレックス	0.700	3	2,501
東京瓦斯	190	42	115,077
大阪瓦斯	172	38	83,808
東邦瓦斯	45	9	32,389
北海道瓦斯	4	5	1,495
広島ガス	3	4	1,619
西部瓦斯	20	2	6,739
静岡ガス	5	5	5,084
メタウォーター	1	1	3,410
陸運業(4.0%)			
SBSホールディングス	1	2	2,538
東武鉄道	95	21	70,914

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	28	6	18,144
東京急行電鉄	96	53	93,558
京浜急行電鉄	49	27	53,901
小田急電鉄	28	29	66,493
京王電鉄	50	11	54,001
京成電鉄	13	13	48,921
富士急行	5	2	7,603
新京成電鉄	1	0.300	674
東日本旅客鉄道	34	35	369,350
西日本旅客鉄道	17	17	136,057
東海旅客鉄道	14	17	355,947
西武ホールディングス	24	25	47,918
鴻池運輸	2	2	5,320
西日本鉄道	21	5	16,065
ハマキョウレックス	1	1	4,627
サカイ引越センター	0.600	1	5,320
近鉄グループホールディングス	179	18	79,054
阪急阪神ホールディングス	22	25	100,000
南海電気鉄道	38	8	24,804
京阪ホールディングス	40	8	28,602
神戸電鉄	4	0.400	1,582
名古屋鉄道	65	14	40,515
山陽電気鉄道	6	1	3,906
日本通運	69	7	53,354
ヤマトホールディングス	31	32	90,096
山九	23	4	25,008
丸運	-	4	1,432
丸全昭和運輸	6	7	3,577
センコーグループホールディングス	8	11	8,158
トナミホールディングス	4	0.500	2,555
ニッコンホールディングス	6	7	19,091
福山通運	11	2	12,312
セイノーホールディングス	12	14	25,069
神奈川中央交通	2	0.500	1,857
日立物流	3	4	10,639
丸和運輸機関	0.400	1	3,645
C&Fロジホールディングス	1	2	3,160
九州旅客鉄道	13	15	52,438
SGホールディングス	-	13	30,590
海運業(0.2%)			
日本郵船	151	15	36,910

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
商船三井	94	11	40,222	
川崎汽船	68	8	23,142	
N S ユナイテッド海運	8	0.900	2,037	
飯野海運	9	9	5,395	
乾汽船	1	1	1,405	
空運業(0.6%)				
日本航空	32	34	139,930	
ANAホールディングス	330	36	158,350	
パスコ	1	2	680	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	0.500	0.500	3,490	
日新	7	1	4,467	
三菱倉庫	12	6	16,614	
三井倉庫ホールディングス	10	11	3,894	
住友倉庫	13	13	9,555	
澁澤倉庫	5	1	1,914	
東陽倉庫	-	4	1,440	
日本トランスシティ	4	5	2,200	
ケイヒン	8	0.800	1,384	
中央倉庫	1	1	1,439	
安田倉庫	1	1	1,625	
東洋埠頭	2	0.800	1,408	
宇徳	2	3	1,449	
上組	21	11	28,001	
キムラユニティー	-	1	1,465	
キューソー流通システム	0.600	0.500	1,279	
郵船ロジスティクス	1	-	-	
近鉄エクスプレス	3	3	7,311	
エーアイティー	1	1	1,504	
内外トランスライン	1	-	-	
日本コンセプト	-	0.300	461	
情報・通信業(7.2%)				
N E C ネットズエスアイ	1	2	5,722	
システナ	1	1	7,088	
デジタルアーツ	0.800	1	3,705	
新日鉄住金ソリューションズ	2	3	9,045	
コア	1	1	1,319	
ソフトクリエイトホールディングス	-	0.900	1,358	
T I S	5	6	24,927	
電算システム	-	0.700	1,347	
グリー	10	10	6,916	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
コーエーテックモホールディングス	4	3	7,385	
三菱総合研究所	0.700	0.800	2,748	
ボルテージ	1	1	1,513	
電算	0.500	0.600	1,532	
A G S	0.900	-	-	
ファインデックス	1	2	1,442	
ヒト・コミュニケーションズ	0.800	0.700	1,320	
K L a b	3	3	6,099	
ポルトワイン・ビートルホールディングス	1	1	3,246	
ネクソン	19	21	82,568	
アイスタイル	2	4	7,350	
エムアップ	2	1	1,474	
エイチーム	1	1	3,437	
テクノスジャパン	1	1	1,699	
コロプラ	4	6	6,249	
モバイルクリエイト	-	3	1,423	
ブロードリーフ	4	4	6,134	
ハーツユナイテッドグループ	0.900	1	1,562	
メディアドゥホールディングス	0.500	0.700	1,391	
ブイキューブ	1	-	-	
サイバーリンクス	1	1	1,458	
フィックスターズ	-	0.400	2,892	
VOYAGE GROUP	-	1	1,376	
オプティム	0.200	0.600	1,436	
ティーガイア	1	1	5,646	
豆蔵ホールディングス	1	1	1,702	
テクマトリックス	0.600	1	2,043	
ガホー・オンライン・エンターテイメント	36	52	19,235	
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	12,810	
ザッパラス	2	3	1,404	
インターネットイニシアティブ	2	3	7,478	
さくらインターネット	1	2	1,757	
GMOクラウド	-	0.600	1,404	
S R Aホールディングス	0.900	1	3,360	
朝日ネット	2	2	1,406	
フリービット	-	1	1,368	
コムチュア	0.400	1	3,470	
サイバーコム	-	1	1,450	
メディカル・データ・ビジョン	-	0.700	1,907	
g u m i	1	2	2,393	
モバイルファクトリー	-	1	1,400	

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	株数	評価額
	千株	千株	千円	
P C Iホールディングス	－	0.400	1,280	
パイプドHD	1	1	1,380	
オープンドア	－	0.800	1,707	
アカツキ	－	0.400	2,492	
L I N E	2	5	26,196	
シンクロ・フード	－	0.300	1,434	
AOI TYO HOLDINGS	1	1	2,033	
マクロミル	－	1	5,292	
野村総合研究所	13	13	60,775	
サイバネットシステム	1	1	1,436	
C Eホールディングス	1	1	1,424	
インテジホールディングス	1	2	2,637	
東邦システムサイエンス	1	1	1,375	
ソースネクスト	－	2	1,863	
フォーカスシステムズ	2	1	1,398	
クレスコ	0.500	0.400	1,512	
フジ・メディア・ホールディングス	18	20	37,740	
オービック	6	6	52,277	
ジャストシステム	2	3	7,737	
TDCソフト	1	1	1,381	
ヤフー	125	140	73,464	
トレンドマイクロ	9	9	57,095	
日本オラクル	2	3	26,133	
アルファシステムズ	0.600	0.600	1,433	
フューチャー	2	2	3,281	
CAC Holdings	1	1	1,677	
ソフトバンク・テクノロジー	0.400	0.800	1,556	
トーセ	1	0.700	1,383	
オービックビジネスコンサルタント	0.900	1	6,350	
伊藤忠テクノソリューションズ	4	4	18,458	
アイティフォー	2	2	1,780	
東計電算	－	0.400	1,330	
エクスネット	－	1	1,417	
大塚商会	4	5	55,970	
サイボウズ	2	2	1,411	
電通国際情報サービス	1	1	3,330	
デジタルガレージ	2	3	11,130	
イーエムシステムズ	0.700	0.700	1,740	
ウェザーニューズ	0.600	0.700	2,292	
C I J	2	2	1,402	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.800	0.800	1,392	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日本エンタープライズ	4	6	1,401	
WOWOW	0.800	0.900	3,100	
スカラ	1	1	1,451	
イマジカ・ロボット ホールディングス	1	1	1,843	
ネットワンシステムズ	7	7	12,513	
アルゴグラフィックス	0.800	0.900	3,123	
マーベラス	3	3	3,055	
エイベックス	3	3	5,914	
日本ユニシス	4	5	11,853	
兼松エレクトロニクス	1	1	3,732	
東京放送ホールディングス	11	11	27,506	
日本テレビホールディングス	16	17	36,569	
朝日放送	1	1	1,704	
テレビ朝日ホールディングス	4	5	11,829	
スカパーJSATホールディングス	11	14	7,266	
テレビ東京ホールディングス	1	1	4,283	
日本BS放送	－	1	1,356	
ビジョン	－	0.500	1,408	
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,384	
ワイヤレスゲート	0.700	1	1,454	
コネクシオ	1	1	3,274	
日本通信	14	17	2,030	
日本電信電話	140	139	668,902	
KDDI	173	175	462,176	
光通信	2	2	35,719	
NTTドコモ	131	143	393,278	
エムティーアイ	2	2	1,638	
GMOインターネット	6	7	13,724	
カドカワ	5	5	6,805	
学研ホールディングス	6	0.700	3,640	
ゼンリン	2	2	7,866	
昭文社	1	1	1,389	
インプレスホールディングス	8	6	1,464	
アイネット	1	1	1,740	
松竹	12	1	19,799	
東宝	11	12	45,312	
東映	7	0.700	7,777	
エヌ・ティ・ティ・データ	10	60	66,802	
ビジネスブレイン太田昭和	－	0.800	1,530	
D T S	1	2	7,590	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6	9	39,375	

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	千株	千円
		千株	千株	千円
シーイーシー	1	1	1	3,804
カプコン	4	4	4	18,270
アイ・エス・ビー	-	1	1	1,483
ジャステック	1	1	1	1,382
S C S K	4	4	4	19,237
日本システムウエア	0.800	0.600	0.600	1,549
アイネス	2	2	2	2,705
T K C	1	1	1	8,154
富士ソフト	2	2	2	10,570
N S D	3	3	3	6,870
コナミホールディングス	7	7	7	44,477
福井コンピュータホールディングス	0.500	0.600	0.600	1,468
J B C Cホールディングス	1	1	1	1,603
ミロク情報サービス	1	1	1	5,355
ソフトバンクグループ	78	88	88	785,136
卸売業(4.8%)				
高千穂交易	1	1	1	1,466
伊藤忠食品	0.400	0.500	0.500	2,965
エレマテック	0.700	0.900	0.900	2,101
J A L U X	0.600	0.600	0.600	1,851
あらた	0.800	1	1	4,955
トーメンデバイス	0.600	0.500	0.500	1,424
東京エレクトロン デバイス	0.800	0.700	0.700	1,491
フィールズ	1	1	1	1,792
双日	103	115	115	39,963
アルフレッサ ホールディングス	20	21	21	51,472
横浜冷凍	4	4	4	5,231
ラサ商事	2	1	1	1,414
アルコニックス	1	2	2	5,170
神戸物産	0.900	1	1	5,596
ペッパーフードサービス	-	1	1	4,630
あい ホールディングス	3	3	3	9,346
ディーブイエックス	-	1	1	1,369
ダイワボウホールディングス	15	1	1	7,378
マクニカ・富士エレホールディングス	3	3	3	10,490
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3	3	3	3,781
八洲電機	1	1	1	1,380
U K Cホールディングス	1	1	1	2,984
ジュテックホールディングス	-	1	1	1,410
大光	-	1	1	1,378
O C H Iホールディングス	0.900	1	1	1,432

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
TOKAIホールディングス	7	10	10	11,783
三洋貿易	1	1	1	2,611
ビューティガレージ	-	0.600	0.600	1,330
ウイン・パートナーズ	1	1	1	2,326
シップヘルスケアホールディングス	3	4	4	15,231
コメダホールディングス	2	3	3	7,840
富士興産	2	2	2	1,372
協栄産業	8	0.700	0.700	1,395
小野建	1	1	1	3,330
佐鳥電機	1	1	1	1,540
エコートレーディング	1	1	1	1,409
伯東	1	1	1	1,942
コンドーテック	1	1	1	1,483
ナガイレーベン	2	2	2	7,207
三菱食品	1	2	2	6,604
松田産業	1	1	1	2,718
第一興商	2	2	2	16,008
メディバルホールディングス	17	19	19	42,061
萩原電気	0.600	0.700	0.700	2,387
アズワン	1	1	1	10,440
尾家産業	1	1	1	1,419
シモジマ	1	1	1	1,362
ドウシシャ	2	2	2	5,040
小津産業	-	0.600	0.600	1,342
高速	1	1	1	1,454
黒田電気	2	-	-	-
丸文	1	1	1	1,762
ハピネット	1	1	1	2,207
橋本総業ホールディングス	0.800	0.800	0.800	1,492
日本ライフライン	1	5	5	19,656
エクセル	0.800	0.800	0.800	2,215
マルカキカイ	-	0.700	0.700	1,491
I DOM	4	5	5	4,248
日本エム・ディ・エム	1	1	1	1,337
進和	1	1	1	2,748
エスケイジャパン	4	-	-	-
ダイトロン	-	0.900	0.900	2,145
シークス	1	1	1	5,652
田中商事	1	1	1	1,425
オーハシテクニカ	1	1	1	2,024
白銅	0.800	0.700	0.700	1,687

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
伊藤忠商事	128	143	295,421	
丸紅	172	160	130,004	
長瀬産業	10	11	22,007	
蝶理	1	1	2,287	
豊田通商	19	21	88,399	
三共生興	2	3	1,706	
兼松	37	8	11,835	
三井物産	158	165	323,558	
日本紙パルプ商事	9	1	4,330	
日立ハイテクノロジーズ	6	6	34,816	
カメイ	2	2	4,097	
東都水産	0.300	0.700	1,390	
OUGホールディングス	-	0.500	1,339	
スターゼン	0.700	0.800	4,184	
山善	6	7	9,180	
椿本興業	-	0.400	1,322	
住友商事	110	123	224,288	
内田洋行	0.900	0.900	2,862	
三菱商事	131	136	418,092	
第一実業	4	0.900	2,929	
キャノンマーケティングジャパン	5	5	16,447	
西華産業	6	1	3,174	
佐藤商事	1	1	1,961	
菱洋エレクトロ	1	1	3,384	
東京産業	2	2	1,425	
ユアサ商事	1	1	7,172	
神鋼商事	0.500	0.400	1,468	
小林産業	4	4	1,408	
阪和興業	18	3	18,036	
正栄食品工業	-	1	4,411	
カナデン	1	1	2,591	
菱電商事	3	1	2,588	
フルサト工業	1	1	1,967	
岩谷産業	19	4	17,522	
すてきなイスグループ	8	1	1,450	
昭光通商	12	12	1,488	
極東貿易	-	3	1,374	
イワキ	-	3	1,251	
三愛石油	4	5	7,815	
稲畑産業	4	4	7,364	
明和産業	3	2	1,405	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ワキタ	3	4	5,254	
東邦ホールディングス	5	5	14,610	
サンゲツ	6	6	14,869	
ミツウロコグループホールディングス	2	2	2,144	
シナネンホールディングス	0.800	0.900	2,416	
伊藤忠エネクス	3	4	4,360	
サンリオ	5	5	10,802	
サンワ テクノス	1	1	2,613	
リョーサン	2	2	9,812	
新光商事	1	2	4,046	
トーホー	0.800	0.900	2,239	
三信電気	1	1	3,421	
東陽テクニカ	2	2	2,136	
モスフードサービス	2	2	8,398	
加賀電子	1	1	4,953	
ソーダニッカ	2	2	1,386	
立花エレテック	1	1	2,852	
PALTA C	2	2	13,959	
三谷産業	3	3	1,411	
西本Wismettacホールディングス	-	0.400	1,672	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	-	0.900	1,350	
ヤマタネ	0.900	1	1,987	
丸紅建材リース	-	6	1,404	
日鉄住金物産	1	1	9,165	
泉州電業	-	0.600	1,717	
トラスコ中山	4	4	11,652	
オートバックスセブン	6	7	16,325	
モリト	-	1	1,544	
加藤産業	2	3	11,625	
イノテック	2	1	2,177	
イエローハット	1	1	5,976	
J Kホールディングス	2	2	1,788	
日伝	0.700	1	3,464	
北沢産業	6	5	1,430	
杉本商事	1	1	2,032	
因幡電機産業	2	2	13,000	
パイテックホールディングス	1	0.900	1,519	
東テク	-	0.600	1,441	
ミスミグループ本社	19	22	71,505	
タキヒヨー	3	0.600	1,384	
蔵王産業	-	0.800	1,492	

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	千株	千円
		千株	千株	千円
スズケン	8		8	38,492
ジェコス	1		1	1,609
ルネサスイーストン	2		1	1,404
小売業(4.7%)				
ローソン	6		4	35,868
サンエー	1		1	8,340
カワチ薬品	1		1	3,870
エービーシー・マート	3		3	24,804
ハードオフコーポレーション	—		1	1,392
アスクル	2		1	6,749
ゲオホールディングス	2		3	7,200
アダストリア	2		3	6,705
ジーフット	—		1	1,438
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	—		1	1,390
くらコーポレーション	1		1	6,941
キャンドウ	0.900		0.900	1,580
パルグループホールディングス	0.900		1	3,105
エディオン	6		7	10,092
サーラコーポレーション	2		3	2,308
ワッツ	1		—	—
ハローズ	0.600		0.700	1,772
あみやき亭	0.400		0.400	2,116
ひらまつ	2		2	1,522
ゲンキー	0.400		—	—
大黒天物産	0.400		0.500	2,650
ハニーズホールディングス	1		1	1,926
ファーマライズホールディングス	2		2	1,428
アルペン	1		1	3,748
クオール	2		2	5,066
ジンズ	1		1	6,968
ビックカメラ	10		11	18,678
DCMホールディングス	10		10	11,340
Monotaro	6		6	24,771
DDホールディングス	0.900		0.400	1,432
きちり	1		1	1,417
アークランドサービスホールディングス	0.500		1	3,595
J.フロント リテイリング	22		23	45,691
ドトール・日レスホールディングス	3		3	8,707
マツモトキョシホールディングス	3		8	35,964
ブロンコビリー	0.900		1	3,300
スタートトゥデイ	16		19	58,368

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
物語コーポレーション	0.500		0.600	5,736
ココカラファイン	1		2	14,120
三越伊勢丹ホールディングス	34		36	46,172
Hamee	—		0.700	1,355
ウエルシアホールディングス	1		5	24,726
クリエイトSDホールディングス	2		2	7,882
チムニー	0.500		0.600	1,735
シュッピン	—		1	1,482
ネクステージ	—		2	2,284
ジョイフル本田	2		2	10,077
鳥貴族	0.500		0.700	2,058
キリン堂ホールディングス	1		0.700	1,312
ホットランド	1		1	1,453
すかいらーく	7		12	17,980
綿半ホールディングス	0.800		0.700	2,716
ヨシックス	0.900		—	—
エイト・スーパーマーケットホールディングス	5		6	7,286
ブックオフコーポレーション	1		1	1,433
あさひ	1		1	1,981
日本調剤	0.600		0.700	2,422
コスモス薬品	0.900		1	19,950
セブン&アイ・ホールディングス	73		81	368,100
薬王堂	0.900		0.800	2,784
クリエイト・レストランツホールディングス	4		5	6,526
ツルハホールディングス	4		4	65,142
サンマルクホールディングス	1		1	4,438
フェリシモ	—		1	1,393
トリドールホールディングス	2		2	8,436
TOKYO BASE	—		0.400	1,706
サツドラホールディングス	—		0.700	1,390
パロックジャパンリミテッド	1		1	1,448
スリのアオキホールディングス	1		1	9,105
スノーグローバルホールディングス	—		1	8,683
LIXILビバ	—		1	4,062
メディカルシステムネットワーク	2		2	1,396
総合メディカル	0.800		0.800	4,800
はるやまホールディングス	1		—	—
ノジマ	2		3	8,683
カップパ・クリエイト	2		2	3,060
ライトオン	1		1	1,473
ジーンズメイト	4		—	—

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
良品計画	2	2	2	93,080
三城ホールディングス	2	0.800	0.800	420
アドヴァン	1	2	2	2,202
アルビス	0.500	0.400	0.400	1,206
コナカ	2	2	2	1,490
ハウス オブ ローゼ	0.800	0.800	0.800	1,412
G-7ホールディングス	-	0.600	0.600	1,445
イオン北海道	2	2	2	1,646
コジマ	-	4	4	1,412
ヒマラヤ	1	1	1	1,398
コーナン商事	2	2	2	7,159
エコス	1	1	1	1,432
ワタミ	2	2	2	3,003
マルシェ	1	1	1	1,388
ドンキホーテホールディングス	11	12	12	74,466
西松屋チェーン	3	4	4	5,353
ゼンショーホールディングス	9	10	10	22,603
幸楽苑ホールディングス	1	1	1	2,241
サイゼリヤ	2	2	2	9,019
V Tホールディングス	5	6	6	3,656
魚力	0.900	1	1	1,417
ユナイテッドアローズ	2	2	2	10,044
ハイデイ日高	1	2	2	6,940
京都きもの友禅	1	1	1	1,418
コロワイド	5	6	6	15,931
ピーシーデポコーポレーション	2	2	2	2,169
壱番屋	1	1	1	6,342
トップカルチャー	2	2	2	1,415
P L A N T	1	1	1	1,383
スギホールディングス	3	4	4	24,897
スクロール	3	3	3	1,401
ヨンドシーホールディングス	1	2	2	5,386
エニ・ファミリーマートホールディングス	7	6	6	48,732
木曽路	2	2	2	6,561
S R Sホールディングス	2	2	2	2,187
千趣会	3	3	3	2,142
タカキュー	-	6	6	1,419
ケーヨー	3	3	3	2,253
上新電機	4	2	2	8,763
日本瓦斯	3	3	3	16,218
ロイヤルホールディングス	2	3	3	9,887

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東天紅	7	0.700	0.700	1,320
いなげや	1	2	2	3,975
島忠	4	4	4	16,497
チヨダ	2	2	2	6,366
ライフコーポレーション	1	1	1	4,353
リンガーハット	2	2	2	5,889
MrMa x HD	-	2	2	1,843
テンアライド	3	2	2	1,392
AOKIホールディングス	3	3	3	6,532
オークワ	2	3	3	3,264
コメリ	2	3	3	9,060
青山商事	3	3	3	16,391
しまむら	2	2	2	30,176
はせがわ	2	2	2	1,415
高島屋	29	31	31	34,348
松屋	3	3	3	6,048
イチ・ツー・オー リテイリング	9	9	9	19,439
近鉄百貨店	7	0.700	0.700	2,772
パルコ	1	1	1	2,812
丸井グループ	18	18	18	37,736
アクシアル リテイリング	1	1	1	6,856
イオン	72	75	75	141,375
イズミ	3	3	3	25,200
平和堂	3	4	4	9,616
フジ	1	2	2	5,188
ヤオコー	2	2	2	13,134
ゼビオホールディングス	2	2	2	5,848
ケーズホールディングス	8	8	8	24,775
O l y m p i cグループ	1	2	2	1,428
Genky DrugStores	-	0.800	0.800	2,704
アインホールディングス	2	2	2	17,108
元気寿司	0.600	0.500	0.500	1,384
ヤマダ電機	58	65	65	44,472
アーランドサカモト	3	3	3	5,933
ニトリホールディングス	7	7	7	135,712
グルメ杵屋	1	1	1	1,158
愛眼	6	2	2	1,415
ケーヨーホールディングス	1	-	-	-
吉野家ホールディングス	6	6	6	12,550
松屋フーズ	0.800	0.900	0.900	3,487
サガミチェーン	2	2	2	3,624

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
関西スーパーマーケット	1	1	1,713	
王将フードサービス	1	1	7,042	
プレナス	2	2	4,686	
ミニストップ	1	1	3,074	
アークス	3	3	9,849	
パローホールディングス	3	4	13,500	
藤久	0.700	0.800	1,341	
ベルク	0.800	0.900	5,571	
大 庄	0.900	1	1,728	
ファーストリテイリング	2	3	140,943	
サンドラッグ	3	8	40,711	
サックスパー ホールディングス	1	1	2,077	
やまや	0.700	-	-	
ベルーナ	4	4	6,168	
銀行業(7.4%)				
島根銀行	0.900	1	1,412	
じもとホールディングス	12	13	2,468	
めびきフィナンシャルグループ	84	101	45,269	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2	2	7,308	
九州フィナンシャルグループ	28	32	19,902	
ゆうちょ銀行	49	55	81,271	
富山第一銀行	4	5	2,540	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	114	118	73,299	
西日本フィナンシャルホールディングス	11	13	17,768	
新生銀行	167	16	29,422	
あおぞら銀行	111	11	52,026	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,328	1,380	1,083,140	
りそなホールディングス	205	214	134,192	
三井住友トラスト・ホールディングス	36	38	169,420	
三井住友フィナンシャルグループ	140	147	705,926	
第四銀行	21	2	11,856	
北越銀行	1	2	4,830	
千葉銀行	68	70	62,930	
群馬銀行	39	39	26,321	
武蔵野銀行	2	3	11,129	
千葉興業銀行	4	5	2,700	
筑波銀行	7	8	3,013	
七十七銀行	27	6	16,585	
青森銀行	14	1	5,115	
秋田銀行	11	1	3,799	
山形銀行	10	2	5,297	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
岩手銀行	1	1	6,013	
東邦銀行	16	17	6,965	
東北銀行	9	1	1,478	
みちのく銀行	9	1	2,349	
ふくおかフィナンシャルグループ	71	79	45,267	
静岡銀行	48	52	57,512	
十六銀行	24	2	7,638	
スルガ銀行	17	20	38,760	
八十二銀行	33	35	22,797	
山梨中央銀行	11	12	5,256	
大垣共立銀行	23	3	8,735	
福井銀行	15	1	4,464	
北國銀行	19	2	9,515	
清水銀行	0.600	0.700	2,103	
富山銀行	0.300	0.400	1,596	
滋賀銀行	16	18	10,116	
南都銀行	1	2	6,980	
百五銀行	16	18	9,964	
京都銀行	31	7	45,225	
紀陽銀行	6	7	13,179	
三重銀行	0.800	0.900	2,139	
ほくほくフィナンシャルグループ	11	13	20,371	
広島銀行	52	28	24,508	
山陰合同銀行	10	11	11,982	
中国銀行	12	13	18,360	
鳥取銀行	0.600	0.800	1,406	
伊予銀行	18	27	24,356	
百十四銀行	19	21	7,476	
四国銀行	14	3	4,644	
阿波銀行	15	16	10,608	
大分銀行	10	1	4,576	
宮崎銀行	12	1	4,569	
佐賀銀行	11	1	3,055	
十八銀行	11	12	3,396	
沖縄銀行	1	1	8,360	
琉球銀行	3	3	6,194	
セブン銀行	65	73	27,634	
みずほフィナンシャルグループ	2,380	2,655	535,248	
山口フィナンシャルグループ	17	19	24,415	
長野銀行	0.700	0.700	1,324	
名古屋銀行	1	1	6,456	

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
北洋銀行	28	29	10,944	
愛知銀行	0.600	0.700	3,794	
第三銀行	1	1	1,837	
中京銀行	0.700	0.900	2,093	
大光銀行	6	0.700	1,677	
愛媛銀行	2	2	3,472	
みなと銀行	1	1	3,769	
京葉銀行	14	17	8,432	
関西アーバン銀行	2	2	3,836	
栃木銀行	9	10	4,312	
北日本銀行	0.500	0.600	1,830	
東和銀行	33	3	4,678	
福島銀行	19	1	1,452	
大東銀行	9	-	-	
トモニホールディングス	14	16	7,824	
フィデアホールディングス	17	19	3,781	
池田泉州ホールディングス	18	20	8,756	
証券、商品先物取引業(1.0%)				
F P G	6	6	9,737	
S B Iホールディングス	19	22	55,669	
ジャフコ	2	2	15,204	
大和証券グループ本社	164	167	121,041	
野村ホールディングス	358	336	223,741	
岡三証券グループ	15	17	11,849	
丸三証券	5	6	6,479	
東洋証券	6	7	2,177	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20	21	16,999	
光世証券	7	1	1,429	
水戸証券	5	6	2,391	
いちよし証券	3	4	5,301	
松井証券	10	9	10,416	
だいちこう証券ビジネス	2	2	1,402	
マネックスグループ	18	20	8,031	
カブドットコム証券	13	12	4,762	
極東証券	2	2	4,074	
岩井コスモホールディングス	1	2	2,768	
藍澤証券	3	3	2,963	
マネーパートナーズグループ	1	1	700	
保険業(2.2%)				
かんぽ生命保険	6	7	20,623	
S O M P Oホールディングス	36	38	159,059	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アニコム ホールディングス	1	1	4,942	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	52	51	173,586	
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	16	31,781	
第一生命ホールディングス	105	110	242,437	
東京海上ホールディングス	71	73	370,796	
T & Dホールディングス	63	60	109,112	
アドバンスクリエイト	0.500	0.700	1,382	
その他金融業(1.2%)				
全国保証	4	5	26,880	
アルヒ	-	1	2,470	
クレディセゾン	13	14	27,764	
アクリーティブ	2	4	1,396	
芙蓉総合リース	2	2	15,950	
興銀リース	3	3	10,308	
東京センチュリー	3	3	23,946	
日本証券金融	7	8	5,328	
アイフル	29	32	12,332	
ポケットカード	1	-	-	
リコーリース	1	1	5,377	
イオンフィナンシャルサービス	11	13	34,736	
アコム	35	39	18,706	
ジャックス	10	2	6,105	
オリエントコーポレーション	37	42	7,317	
日立キャピタル	4	5	15,400	
アプラスフィナンシャル	10	13	1,412	
オリックス	124	130	249,394	
三菱UFJリース	44	49	33,579	
日本取引所グループ	54	57	107,567	
イー・ギャランティ	0.500	0.500	1,902	
NECキャピタルソリューション	0.700	0.800	1,712	
不動産業(2.4%)				
いちご	16	27	12,778	
日本駐車場開発	21	23	4,347	
ヒューリック	36	40	49,939	
三栄建築設計	-	0.800	1,733	
スター・マイカ	-	0.700	1,318	
野村不動産ホールディングス	11	13	34,060	
三重交通グループホールディングス	3	4	2,080	
サムティ	1	1	3,204	
日本商業開発	1	1	2,097	
プレサンスコーポレーション	2	2	4,473	

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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ユニゾホールディングス	1	2	6,900	
THEグローバル社	2	1	1,410	
日本管理センター	1	1	2,298	
サンセイランディック	1	1	1,432	
フージャースホールディングス	2	4	3,647	
オープンハウス	2	3	21,440	
東急不動産ホールディングス	42	47	38,265	
飯田グループホールディングス	14	16	32,534	
ムゲンエステート	-	1	1,586	
ハウスドゥ	-	0.500	1,387	
シーアールイー	0.800	0.900	1,484	
ケイアイスター不動産	-	0.700	1,943	
パーク24	8	10	28,101	
パラカ	0.600	0.600	1,455	
三井不動産	93	97	253,320	
三菱地所	130	145	276,696	
平和不動産	3	3	6,834	
東京建物	20	21	37,171	
ダイビル	4	5	6,725	
京阪神ビルディング	2	3	2,790	
住友不動産	42	47	185,180	
大京	33	3	6,925	
テーオーシー	6	6	5,695	
東京楽天地	3	0.300	1,548	
レオパレス21	22	23	19,106	
スターツコーポレーション	1	2	7,765	
フジ住宅	2	2	2,202	
空港施設	2	2	1,397	
明和地所	1	1	1,400	
住友不動産販売	1	-	-	
ゴールドクレスト	1	1	3,352	
日本エスリード	0.900	0.800	1,760	
日神不動産	2	2	2,106	
日本エスコン	-	3	3,402	
タカラレーベン	7	9	4,397	
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,361	
イオンモール	11	12	28,009	
ファースト住建	0.800	0.800	1,408	
カチタス	-	2	6,400	
トーセイ	2	2	3,208	
穴吹興産	0.500	-	-	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ都市開発	10	12	15,972	
サンフロンティア不動産	1	2	2,954	
エフ・ジェー・ネクスト	-	1	1,417	
ランドビジネス	4	4	1,423	
グランディハウス	2	2	1,403	
日本空港ビルデング	5	5	23,028	
サービス業(4.3%)				
日本工営	1	1	3,809	
LIFULL	4	6	6,982	
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	3,241	
日本M&Aセンター	5	6	43,550	
メンバーズ	-	1	1,433	
タケエイ	1	2	2,554	
トラスト・テック	0.800	0.800	2,520	
コシダカホールディングス	0.600	1	6,690	
パソナグループ	1	1	4,267	
CDS	-	1	1,464	
リングアンドモチベーション	4	3	3,650	
GCA	1	2	2,125	
エス・エム・エス	2	3	16,335	
パーソルホールディングス	14	17	48,562	
リニカル	1	1	1,683	
クックパッド	4	5	3,599	
アイ・ケイ・ケイ	1	1	1,404	
学情	1	0.900	1,440	
スタジオアリス	0.800	1	2,713	
シミックホールディングス	0.900	1	2,718	
NJS	0.900	0.900	1,470	
総合警備保障	6	7	39,225	
カカクコム	13	14	28,710	
アイロムグループ	-	0.600	1,752	
セントケア・ホールディング	-	1	1,392	
ルネサンス	0.900	0.900	1,594	
ディップ	2	2	9,099	
オプトホールディング	1	1	1,498	
新日本科学	2	2	1,404	
ツクイ	4	4	3,789	
キャリアデザインセンター	0.900	-	-	
エムスリー	16	19	87,759	
ツカダ・グローバルホールディング	1	2	1,409	
アウトソーシング	1	5	11,323	

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
ウェルネット	1	1	2,207
ワールドホールディングス	—	0.600	2,382
ディー・エヌ・エー	8	10	19,747
博報堂DYホールディングス	25	26	42,001
ぐるなび	2	3	4,272
エスアールジータカミヤ	2	2	1,502
ジャパンベストレスキューシステム	5	2	1,863
ファンコミュニケーションズ	4	5	4,001
ライク	—	0.700	1,454
ビジネス・ブレイクスルー	—	3	1,449
WDBホールディングス	1	0.900	3,753
ティア	1	—	—
バリューコマース	—	1	2,317
インフォマート	7	9	8,553
J Pホールディングス	5	5	1,846
E P Sホールディングス	2	2	6,563
プレスステージ・インターナショナル	2	3	5,413
アミューズ	1	1	4,881
ドリームインキュベータ	0.600	0.600	1,646
クイック	—	1	2,488
T A C	5	4	1,394
ケネディクス	24	25	17,846
電通	20	23	115,153
テイクアンドギヴ・ニーズ	1	1	1,419
びあ	0.600	0.600	3,300
イオンファンタジー	0.500	0.600	2,997
シーティーエス	0.900	1	1,495
ネクシーズグループ	—	0.800	1,379
みらかホールディングス	4	5	23,940
アルプス技研	0.700	1	3,836
ダイオーズ	1	—	—
日本空調サービス	2	2	1,558
オリエンタルランド	20	22	238,896
ダスキン	4	5	13,525
明光ネットワークジャパン	2	2	3,088
ファルコホールディングス	0.900	1	1,765
秀英予備校	2	2	1,435
ラウンドワン	5	5	10,596
リゾートトラスト	7	8	19,352
ビー・エム・エル	2	2	6,345
ワタベウエディング	2	2	1,391

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
りらいあコミュニケーションズ	3	3	3,948
リソー教育	3	3	2,620
早稲田アカデミー	—	0.800	1,389
ユー・エス・エス	22	23	51,258
サイバーエージェント	9	12	55,924
楽天	94	97	91,167
クリーク・アンド・リバー社	—	1	1,383
テー・オー・ダブリュー	—	1	1,657
セントラルスポーツ	0.600	0.700	2,786
フルキャストホールディングス	1	1	4,312
テクノプロ・ホールディングス	3	3	20,978
インターワークス	—	1	1,440
Keeper 技研	0.700	1	1,403
ファーストロジック	—	1	1,399
Gunosy	—	0.900	2,344
イー・ガーディアン	—	1	3,130
リブセンス	2	2	1,424
ジャパンマテリアル	1	1	6,851
ベクトル	1	2	5,004
ウチヤマホールディングス	2	2	1,435
キャリアリンク	1	2	1,377
I B J	1	1	1,654
アサンテ	0.700	0.500	940
N・フィールド	0.900	1	2,425
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.400	3,112
E R Iホールディングス	—	1	1,453
アビスト	0.300	0.300	1,500
ウィルグループ	1	0.900	1,485
エスコロー・エージェント・ジャパン	—	2	1,394
日本ビューホテル	0.900	0.900	1,351
リクルートホールディングス	40	146	387,119
土木管理総合試験所	—	2	1,396
日本郵政	48	107	140,801
ベルシステム24ホールディングス	2	3	4,777
一蔵	—	1	1,398
ソラスト	—	1	2,968
リログループ	0.700	10	30,364
東祥	0.400	1	4,572
エイチ・アイ・エス	3	3	11,910
ラックランド	0.600	0.700	1,491
共立メンテナンス	1	3	15,453

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
イチネンホールディングス	1	2	3,229
建設技術研究所	1	1	1,726
スペース	1	1	1,644
燦ホールディングス	-	0.500	1,311
東京テアトル	8	1	1,463
ナガワ	0.300	0.400	1,712
よみうりランド	4	0.400	1,906
東京都競馬	13	1	5,243
常磐興産	0.800	0.800	1,530
カナモト	2	2	9,802
東京ドーム	7	7	7,584
西尾レントオール	1	1	5,933
トランス・コスモス	2	2	6,043
乃村工藝社	4	4	9,565
藤田観光	6	0.800	2,612
KNT-CTホールディングス	10	1	2,178
日本管財	1	2	4,184
トーカイ	0.800	1	4,712
白洋舎	0.500	0.400	1,354
セコム	19	20	160,036
セントラル警備保障	0.800	0.900	2,259
丹青社	3	3	4,110
メイテック	2	2	13,420
アサツー ディ・ケイ	3	-	-
応用地質	1	2	3,063

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
船井総研ホールディングス	2	3	8,525
進学会ホールディングス	2	2	1,432
いであ	-	1	1,452
学究社	0.800	0.900	1,463
ベネッセホールディングス	6	6	27,462
イオンディライト	2	2	8,912
ナック	1	1	1,428
ニチイ学館	3	3	4,518
ダイセキ	3	3	9,760
ステップ	0.900	0.800	1,471
合計	株数・金額	26,741	23,939 49,937,126
	銘柄数<比率>	1,711	1,820 <98.2%>

(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	952	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2018年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	49,937,126	95.4
コール・ローン等、その他	2,398,236	4.6
投資信託財産総額	52,335,363	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

(2018年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	52,332,830,131円
コーポレート債	2,156,463,306
株式(評価額)	49,937,126,110
未収入金	47,536,850
未収配当金	66,273,865
差入委託証拠金	125,430,000
(B)負債	1,464,779,204
未払金	1,381,421,890
未払解約金	83,353,318
その他未払費用	3,996
(C)純資産総額(A-B)	50,868,050,927
元本	28,140,482,546
次期繰越損益金	22,727,568,381
(D)受益権総口数	28,140,482,546口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,076円

(注1) 期首元本額	26,374,834,259円
期中追加設定元本額	12,504,825,643円
期中一部解約元本額	10,739,177,356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	7,165,337,530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)	5,432,863,472円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,464,218円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,117,101円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	902,320,051円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,416,092,276円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,424,354,525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)	15,429,588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)	52,436,377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)	65,705,940円
DCニッセイ国内株式インデックス	69,476,894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	8,300,321,337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)	269,194,698円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,727,590円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	753,106円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	273,304円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	417,233円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	647,897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(6資産均等型)	6,943,435円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,535,518円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	543,300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)	587,589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)	247,609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)	1,691,958円

損益の状況

当期(2017年2月21日~2018年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	876,392,637円
受取配当金	876,797,933
受取利息	20,551
その他収益金	498,842
支払利息	△ 924,689
(B)有価証券売買損益	5,534,946,124
売買益	6,560,403,856
売買損	△ 1,025,457,732
(C)先物取引等損益	147,800,640
取引益	273,087,760
取引損	△ 125,287,120
(D)信託報酬等	△ 752,420
(E)当期損益金(A+B+C+D)	6,558,386,981
(F)前期繰越損益金	14,623,173,169
(G)追加信託差損益金	9,026,071,431
(H)解約差損益金	△ 7,480,063,200
(I)合計(E+F+G+H)	22,727,568,381
次期繰越損益金(I)	22,727,568,381

- (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 22 期

(計算期間：2018年5月22日～2018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）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

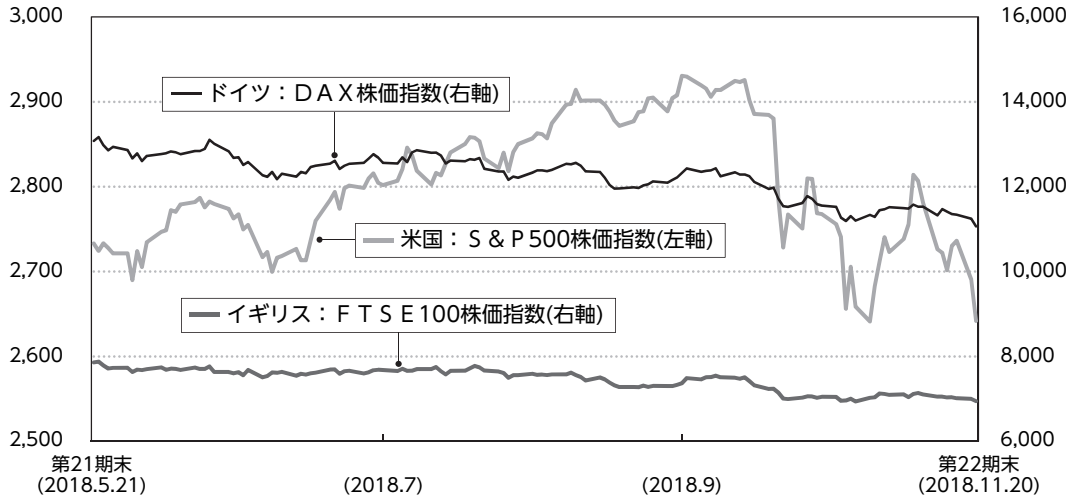
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

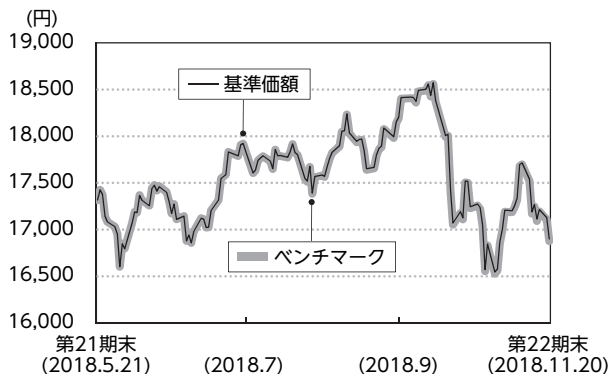


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期を通じて見ると下落しました。

期前半は、イタリアの政情不安や米朝首脳会談の延期を背景に株式市場は下落して始まりました。その後は、米中貿易摩擦懸念により一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績などに支えられ、上昇基調が続きました。しかし期後半に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念の再燃、中東情勢不安等の地政学リスクの高まりなどを背景に株式市場は大きく下落する展開となりました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期は、海外株式市場が下落したことから、基準価額も同様の動きとなりました。期前半は、イタリアの政情不安や米朝首脳会談の延期から株式市場が下落して始まったことを受けて、基準価額は下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念により一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績などに支えられ、株式市場が上昇基調となったことから、基準価額も同様の動きとなりました。しかし期後半に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念の再燃、中東情勢不安等の地政学リスクの高まりなどを背景として株価が大きく下落したため、基準価額は下落して当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

日本を除く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-2.4%となり、ベンチマーク騰落率（-2.5%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415
19期(2017年5月22日)	15,268	13.8	15,052	13.7	94.6	2.8	2.4	82,206
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613
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

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		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			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年5月21日	17,317	-	17,031	-	95.6	1.9	2.2
5月末	16,847	△2.7	16,571	△2.7	95.8	1.9	2.2
6月末	16,982	△1.9	16,701	△1.9	95.4	2.1	2.2
7月末	17,653	1.9	17,358	1.9	95.7	1.9	2.2
8月末	18,035	4.1	17,730	4.1	95.1	2.4	2.2
9月末	18,492	6.8	18,174	6.7	95.8	1.9	2.2
10月末	16,868	△2.6	16,571	△2.7	94.2	3.4	2.3
(期末)2018年11月20日	16,899	△2.4	16,598	△2.5	94.2	3.3	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018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	0.008	
(株式)	(1)	(0.008)	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	5	0.029	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.023)	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)	(0.006)	・ 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	7	0.040	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,533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5月22日～2018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 16,961 (710)	千米ドル 132,982 (△ 1,479)	百株 1,507	千米ドル 9,567
	カナダ	2,605 (75)	千カナダ・ドル 10,191	173	千カナダ・ドル 316
	オーストラリア	4,048 (△ 8)	千オーストラリア・ドル 6,642 (△ 17)	222	千オーストラリア・ドル 156
	香港	5,473 (311)	千香港ドル 19,336	2,000	千香港ドル 779
	シンガポール	2,446	千シンガポール・ドル 1,368	529	千シンガポール・ドル 99
	ニュージーランド	662	千ニュージーランド・ドル 539	218	千ニュージーランド・ドル 68
	イギリス	19,298 (27,453)	千イギリス・ポンド 11,563 (△ 90)	39,408	千イギリス・ポンド 1,501
	イスラエル	326 (△ 10)	千イスラエル・シケル 797 (△ 347)	4	千イスラエル・シケル 178
	スイス	1,036 (67)	千スイス・フラン 6,483	54	千スイス・フラン 189
	デンマーク	229	千デンマーク・クローネ 8,509	46	千デンマーク・クローネ 1,587
	ノルウェー	358	千ノルウェー・クローネ 5,784	—	千ノルウェー・クローネ —
	スウェーデン	1,326 (342)	千スウェーデン・クローナ 17,797	512	千スウェーデン・クローナ 1,435

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	251	613	—	—
		オランダ	1,067	2,825	557	903
		ベルギー	105	683	0.99	4
		ルクセンブルグ	65	148	—	—
		フランス	1,655	7,176	47	149
				(△ 2)		
		ドイツ	1,507	6,789	411	1,754
			(298)	(△ 9)		
		ポルトガル	240	126	—	—
		スペイン	2,927	2,102	—	—
			(20)	(0.1000)		
		イタリア	3,260	1,649	388	93
	(68)					
フィンランド	452	663	43	26		
オーストリア	40	151	0.27	1		
		(△ 11)				
その他	11	92	—	—		

(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。

ニッセイ外国株式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	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.920	113	—	—
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	279	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.873	109	—	—
PROLOGIS INC	6	431	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	5	61	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.807	142	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.592	54	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1	48	—	—
DUKE REALTY CORP	2	62	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	141	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.391	94	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.491	61	—	—
GGP INC	4	99	—	—
	(△ 22)			
HCP INC	2	73	—	—
WELLTOWER INC	2	138	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	89	—	—
KIMCO REALTY CORP	2	41	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	44	—	—
MACERICH CO/THE	0.622	34	0.384	21
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.704	70	—	—
PUBLIC STORAGE	0.893	187	—	—
REGENCY CENTERS CORP	0.938	59	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	323	0.209	38
SL GREEN REALTY CORP	0.452	44	0.205	19
UDR INC	1	64	—	—
VENTAS INC	2	114	—	—
VORNADO REALTY TRUST	1	74	—	—
REALTY INCOME CORP	1	103	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.761	69	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	134	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	61	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	4	94	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	2	406	—	—
EQUINIX INC	0.481	201	—	—
VEREIT	6	48	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	9	150
COLONY CAPITAL INC	—	—	15	94
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.581	92	—	—
INVITATION HOMES INC	2	46	—	—
BROOKFIELD PROPERTY PARTNERS	—	—	0.355	6
	(0.355)	(8)		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	0.589	11	—	0.010
	(8)	(△ 271)		
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	37	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1	39	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	43	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	8	83	—	—
GPT GROUP	15	80	—	—
GOODMAN GROUP	10	102	5	48
STOCKLAND	18	74	—	—
WESTFIELD CORP	—	—	64	569
MIRVAC GROUP	28	66	—	—
VICINITY CENTRES	26	70	—	—
SCENTRE GROUP	37	154	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	11	820	0.500	34
(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	18	50	0.200	0.528
		(△0.648)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25	45	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	21	45	1	2
SUNTEC REIT	16	29	11	19
		(△0.583)		
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	6	39	0.176	1
HAMMERSON PLC	4	23	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	5	48	—	—
SEGRO PLC	7	49	—	—

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(ユーロ/フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO SE	1	242	4	835
KLEPIERRE	1	57	0.412	13
GECINA SA	0.403	58	0.084	11
COVIVIO	0.678	60	—	—
ICADE	0.564	46	—	—

(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
	30,329	27,759	—	—

(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5月22日～2018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
APPLE INC	22	531,819	23,195	MONSANTO CO	14	198,582	14,149
AMAZON.COM INC	2	454,037	201,704	LINDE PLC	10	188,369	18,406
MICROSOFT CORP	37	448,098	12,010	APPLE INC	4	104,876	25,850
FACEBOOK INC-A	12	249,131	19,174	SKY PLC	36	89,988	2,479
JOHNSON & JOHNSON	13	209,145	15,039	KEURIG DR PEPPER INC	5	79,763	13,641
ALPHABET INC-CL C	1	208,989	128,214	RELX PLC	33	78,357	2,361
ALPHABET INC-CL A	1	205,138	129,998	XL GROUP LTD	8	57,559	6,541
EXXON MOBIL CORP	22	201,250	9,129	CA Inc	11	55,863	5,013
JPMORGAN CHASE & CO	15	197,343	12,498	OLD MUTUAL PLC	156	47,539	304
LINDE PLC	10	192,403	18,651	AMGEN INC	1	31,429	20,044

(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

2018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	186	217	4,467	503,371	資本財
ABBOTT LABORATORIES	546	641	4,528	510,181	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	501	555	4,970	559,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	-	15	463	52,260	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	192	235	3,829	431,450	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	225	264	1,300	146,576	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	13	14	185	20,863	資本財
ADOBE INC	154	180	3,962	446,410	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	23	27	480	54,193	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	257	337	644	72,590	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	42	45	230	25,938	資本財
AES CORP	210	245	377	42,503	公益事業
AETNA INC	102	119	2,484	279,880	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	17	19	216	24,425	各種金融
AFLAC INC	245	282	1,279	144,153	保険
AGCO CORP	19	22	131	14,777	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	100	116	731	82,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	68	80	1,280	144,226	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	53	62	425	47,990	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	34	40	403	45,419	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	70	81	936	105,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	23	27	569	64,193	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	48	56	193	21,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	4	5	344	38,820	保険
ALLEGION PLC	30	34	310	34,937	資本財
ALLERGAN PLC	104	124	1,936	218,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	18	353	39,876	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	73	85	389	43,899	公益事業
ALLSTATE CORP	112	128	1,133	127,670	保険
ALLY FINANCIAL INC	138	157	392	44,255	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27	33	236	26,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	93	109	11,239	1,266,407	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	98	115	11,730	1,321,619	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	598	692	3,858	434,732	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	128	151	22,844	2,573,907	小売
AMERCO	2	3	120	13,583	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	76	89	627	70,702	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	44	160	18,072	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	154	181	1,403	158,149	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	231	267	2,899	326,683	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23	26	278	31,407	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	281	328	1,422	160,277	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	56	65	615	69,342	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	46	52	664	74,904	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	51	60	547	61,703	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	88	103	539	60,832	各種金融
AMETEK INC	72	84	611	68,898	資本財
AMGEN INC	227	242	4,722	532,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	95	110	950	107,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	171	188	1,046	117,962	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	115	135	1,159	130,696	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	46	-	-	-	エネルギー
ANSYS INC	26	30	458	51,632	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	69	74	105	11,891	エネルギー
ANTHEM INC	80	93	2,632	296,633	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	78	89	1,479	166,727	保険
APACHE CORP	118	139	509	57,374	エネルギー
APPLE INC	1,611	1,800	33,457	3,769,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	334	368	1,270	143,094	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	83	96	699	78,820	自動車・自動車部品
ARAMARK	76	89	321	36,272	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41	147	417	46,989	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	175	203	943	106,322	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	135	158	323	36,435	資本財
ARISTA NETWORKS INC	14	19	426	48,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	27	31	233	26,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	56	66	518	58,399	保険
ASSURANT INC	16	18	188	21,182	保険
AT&T INC	1,930	2,663	8,084	910,875	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	33	56	247	27,891	保険
ATMOS ENERGY CORP	33	41	407	45,945	公益事業
AUTODESK INC	61	80	1,010	113,832	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	27	31	269	30,413	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	139	161	2,312	260,570	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	16	-	-	-	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	
AUTOZONE INC	8	9	811	91,387	小売
AVERY DENNISON CORP	27	32	296	33,432	素材
AVNET INC	37	42	183	20,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	69	81	197	22,302	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	25	29	160	18,033	保険
BAKER HUGHES A GE CO	127	151	349	39,350	エネルギー
BALL CORP	104	121	600	67,703	素材
BANK OF AMERICA CORP	3,108	3,525	9,784	1,102,377	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	320	369	1,851	208,640	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	153	186	1,210	136,347	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	246	283	1,466	165,204	銀行
BECTON DICKINSON & CO	83	97	2,382	268,424	ヘルスケア機器・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	398	468	10,203	1,149,679	各種金融
BEST BUY CO INC	84	92	576	64,992	小売
BIOGEN INC	66	77	2,466	277,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	55	64	606	68,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	37	43	1,789	201,650	各種金融
BOEING CO	177	202	6,505	732,933	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	15	17	3,141	353,975	小売
BORGWARNER INC	66	76	301	33,937	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	431	504	1,781	200,730	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	26	38	153	17,307	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	513	598	3,200	360,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	128	150	3,445	388,222	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	36	43	435	49,032	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	80	96	460	51,864	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	44	51	300	33,846	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	45	52	474	53,451	運輸
CA Inc	98	-	-	-	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	145	165	426	48,021	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	88	102	440	49,624	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	56	65	253	28,522	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151	177	1,561	175,895	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	98	113	620	69,882	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	57	65	406	45,805	小売
CARNIVAL CORP	108	155	921	103,769	消費者サービス
CATERPILLAR INC	186	218	2,757	310,681	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32	41	455	51,364	各種金融
CBRE GROUP INC	95	119	522	58,878	不動産

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CBS CORP-CL B	109	126	694	78,285	メディア
CDK GLOBAL INC	39	46	228	25,759	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	48	55	488	55,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	42	49	503	56,714	素材
CELGENE CORP	247	265	1,842	207,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	54	75	986	111,129	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	130	151	425	47,885	公益事業
CENTURYLINK INC	303	357	679	76,598	電気通信サービス
CERNER CORP	93	109	614	69,232	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	73	85	387	43,707	素材
CHARLES SCHWAB CORP	378	444	2,043	230,215	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	58	61	1,976	222,734	メディア
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	40	46	517	58,286	ソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO/THE - W/I	57	65	190	21,438	素材
CHENIERE ENERGY INC	63	77	463	52,239	エネルギー
CHEVRON CORP	596	699	8,354	941,328	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	9	426	48,027	消費者サービス
CHUBB LTD	145	170	2,284	257,400	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	89	577	65,123	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	77	89	1,880	211,892	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	29	34	306	34,565	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	48	56	455	51,278	保険
CINTAS CORP	28	33	595	67,073	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,552	1,723	7,883	888,234	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	41	41	186	21,038	銀行
CITIGROUP INC	829	933	6,031	679,612	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	153	176	633	71,430	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	47	49	531	59,858	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	40	47	768	86,542	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	106	124	2,435	274,368	各種金融
CMS ENERGY CORP	90	105	542	61,133	公益事業
COCA-COLA CO	1,270	1,480	7,478	842,558	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	68	79	390	43,987	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	54	63	257	29,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	184	214	1,483	167,108	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	262	303	1,904	214,630	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	1,465	1,683	6,429	724,378	メディア
COMERICA INC	54	62	504	56,808	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	60	71	128	14,525	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	
CONAGRA BRANDS INC	128	143	479	54,067	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	46	73	1,016	114,476	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	374	427	2,841	320,115	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	97	114	887	100,015	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	54	61	1,190	134,112	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	28	33	160	18,030	エネルギー
COOPER COS INC/THE	15	17	459	51,791	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	-	76	370	41,750	商業・専門サービス
CORNING INC	272	303	947	106,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	11	13	464	52,303	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	137	160	3,674	414,003	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	152	178	162	18,356	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	42	49	242	27,378	素材
CSX CORP	268	306	2,207	248,672	運輸
CUMMINS INC	49	57	831	93,699	資本財
CVS HEALTH CORP	317	372	2,923	329,405	ヘルスケア機器・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	-	124	110	12,434	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	196	230	2,330	262,544	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	38	45	512	57,704	消費者サービス
DAVITA INC	46	51	309	34,905	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	85	112	1,608	181,242	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	63	72	752	84,800	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	57	65	369	41,625	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	71	83	306	34,563	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	155	191	566	63,785	エネルギー
DIAMONDBACK ENERGY INC	27	36	410	46,213	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	113	127	893	100,679	各種金融
DISCOVERY INC-A	47	60	182	20,612	メディア
DISCOVERY INC-C	95	110	306	34,522	メディア
DISH NETWORK CORP	72	85	267	30,167	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	85	97	1,082	121,909	小売
DOLLAR TREE INC	74	87	731	82,425	小売
DOMINION ENERGY INC	202	240	1,787	201,346	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	13	14	371	41,805	消費者サービス
DOVER CORP	48	56	487	54,885	資本財
DOWDUPONT INC	734	849	4,909	553,189	素材
DR HORTON INC	111	131	458	51,694	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	56	67	799	90,111	公益事業
DUKE ENERGY CORP	220	257	2,258	254,443	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	
DXC TECHNOLOGY CO	89	104	618	69,633	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	83	96	494	55,705	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	44	51	272	30,746	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	45	51	425	47,918	素材
EATON CORP PLC	137	159	1,171	132,033	資本財
EATON VANCE CORP	36	42	179	20,193	各種金融
EBAY INC	311	345	967	108,989	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	81	95	1,523	171,615	素材
EDISON INTERNATIONAL	102	119	645	72,754	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	66	77	1,155	130,232	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	96	112	932	105,059	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	310	357	4,140	466,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	201	230	1,576	177,577	資本財
ENERGY CORP	57	66	579	65,269	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	38	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	180	211	2,235	251,844	エネルギー
EQT CORP	79	-	-	-	エネルギー
EQUIFAX INC	37	43	446	50,282	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	70	81	1,169	131,803	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	12	14	320	36,083	保険
EVERGY INC	-	100	598	67,446	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	100	116	787	88,754	公益事業
EXELON CORP	301	354	1,635	184,270	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	39	45	512	57,687	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	58	65	485	54,666	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	177	205	1,992	224,446	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	1,329	1,549	12,278	1,383,423	エネルギー
F5 NETWORKS INC	19	22	381	42,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	748	878	11,556	1,302,089	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	90	105	603	68,013	資本財
FEDEX CORP	80	93	2,119	238,806	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	80	99	321	36,265	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	104	120	1,262	142,235	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	220	249	682	76,934	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	143	193	327	36,852	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	49	58	551	62,127	銀行
FIRSTENERGY CORP	140	176	680	76,619	公益事業
FISERV INC	131	149	1,177	132,681	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	28	32	626	70,615	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	
FLEX LTD	166	192	155	17,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	43	50	229	25,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	40	47	231	26,127	資本財
FLUOR CORP	43	51	224	25,259	資本財
FMC CORP	42	49	402	45,390	素材
FORD MOTOR CO	1,162	1,361	1,259	141,869	自動車・自動車部品
FORTINET INC	46	52	353	39,848	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	98	114	844	95,130	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	47	53	226	25,543	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	103	116	376	42,444	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	430	502	578	65,147	素材
GAP INC	72	85	216	24,401	小売
GARMIN LTD	38	41	266	30,018	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	28	33	486	54,775	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	79	92	1,655	186,484	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,721	3,181	2,493	280,989	資本財
GENERAL MILLS INC	178	216	959	108,129	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	400	464	1,657	186,703	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	45	53	544	61,370	小売
GILEAD SCIENCES INC	409	476	3,237	364,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	50	58	609	68,634	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	-	59	350	39,480	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	112	131	2,606	293,662	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	77	87	195	21,978	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	65	76	213	24,049	消費者サービス
HALLIBURTON CO	273	319	1,055	118,891	エネルギー
HANESBRANDS INC	114	132	197	22,268	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	53	61	245	27,631	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	37	43	641	72,268	資本財
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	111	130	570	64,297	保険
HASBRO INC	35	43	412	46,474	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	89	102	1,384	156,030	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	55	64	242	27,374	資本財
HELMERICH & PAYNE	33	39	251	28,382	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	49	56	485	54,740	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	44	51	560	63,138	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	89	100	574	64,760	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	499	558	828	93,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60	104	744	83,855	消費者サービス

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	
HOLLYFRONTIER CORP	52	61	381	42,993	エネルギー
HOLOGIC INC	86	99	415	46,808	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	366	422	7,335	826,537	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	226	273	4,029	454,017	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	375	446	286	32,261	不動産
HORMEL FOODS CORP	90	105	480	54,107	食品・飲料・タバコ
HP INC	523	601	1,415	159,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	44	50	1,564	176,227	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	337	401	595	67,066	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	14	16	343	38,735	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	23	28	477	53,819	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	23	27	374	42,208	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	27	31	616	69,445	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	124	142	722	81,388	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	96	111	1,494	168,342	資本財
ILLUMINA INC	45	53	1,623	182,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	56	65	423	47,770	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	78	90	933	105,197	資本財
INGREDION INC	22	26	274	30,912	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,468	1,706	8,190	922,799	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	183	211	1,722	194,050	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	275	336	4,043	455,553	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	24	32	453	51,069	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	123	143	664	74,880	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	123	142	334	37,682	メディア
INTUIT INC	76	89	1,776	200,194	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	35	41	2,001	225,523	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	127	149	300	33,835	各種金融
IPG PHOTONICS CORP	11	13	186	21,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	42	58	677	76,374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24	28	379	42,765	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39	46	337	37,995	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	68	82	522	58,842	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	70	82	292	33,001	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	18	21	313	35,299	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	28	33	363	40,956	運輸
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	100	113	240	27,141	各種金融
JM SMUCKER CO	35	41	463	52,223	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	843	982	14,507	1,634,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	290	338	1,132	127,551	資本財
JONES LANG LASALLE INC	14	16	236	26,592	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,088	1,246	13,813	1,556,419	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	118	128	360	40,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	33	38	384	43,325	運輸
KELLOGG CO	81	95	587	66,225	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	56	-	-	-	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	336	386	705	79,494	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	-	68	378	42,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	110	127	1,412	159,151	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	631	726	1,265	142,539	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	49	57	526	59,327	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	44	51	165	18,604	運輸
KOHL'S CORP	52	61	436	49,165	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	190	222	1,156	130,346	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	297	908	102,410	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	75	86	300	33,827	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	24	28	536	60,419	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	31	37	604	68,156	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	50	60	863	97,235	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	123	143	726	81,846	消費者サービス
LEAR CORP	21	24	325	36,649	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	41	47	179	20,248	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	44	52	335	37,811	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	89	105	438	49,359	耐久消費財・アパレル
LENOX INTERNATIONAL INC	11	13	294	33,142	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	33	39	322	36,369	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62	71	170	19,191	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	176	200	464	52,336	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29	32	125	14,166	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	57	65	252	28,456	メディア
LIBERTY MEDIA GROUP-C	63	74	223	25,197	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	68	79	498	56,148	保険
LINDE PLC	-	205	3,285	370,163	素材
LIVE NATION INC	46	54	287	32,443	メディア
LKQ CORP	97	113	311	35,145	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	81	94	2,775	312,663	資本財
LOEWS CORP	89	98	476	53,671	保険
LOWE'S COS INC	260	301	2,750	309,883	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	
LULULEMON ATHLETICA INC	31	37	473	53,297	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	105	121	1,128	127,198	素材
M&T BANK CORP	42	50	843	95,045	銀行
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	27	-	-	-	運輸
MACY'S INC	95	111	370	41,695	小売
MANPOWER GROUP	20	23	185	20,926	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	264	310	531	59,844	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	153	254	1,612	181,725	エネルギー
MARKEL CORP	4	5	561	63,250	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	97	109	1,280	144,268	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	160	185	1,646	185,517	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	19	23	427	48,172	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	122	224	340	38,403	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	99	113	350	39,479	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	294	339	6,426	724,087	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	108	126	167	18,892	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	88	102	530	59,812	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	37	44	662	74,596	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	250	287	5,369	605,024	消費者サービス
MCKESSON CORP	65	73	932	105,112	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	424	495	4,480	504,822	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	77	90	148	16,699	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	13	15	515	58,118	ソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	854	984	7,519	847,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	279	314	1,374	154,910	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	9	536	60,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	142	193	496	55,930	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	47	54	244	27,542	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	73	85	634	71,478	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	361	424	1,563	176,152	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	2,299	2,673	27,965	3,150,902	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	17	20	235	26,520	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	23	288	32,478	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	59	69	459	51,740	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	468	539	2,398	270,260	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	138	-	-	-	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	123	154	880	99,247	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	54	63	938	105,739	各種金融
MORGAN STANLEY	425	486	2,160	243,398	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	
MOSAIC CO/THE	104	133	467	52,622	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	51	59	755	85,161	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	28	32	475	53,584	各種金融
MYLAN NV	142	188	652	73,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	36	42	377	42,582	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	118	139	457	51,546	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	-	62	238	26,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	83	98	659	74,288	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	135	159	4,308	485,437	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	151	174	167	18,859	銀行
NEWELL BRANDS INC	153	177	380	42,922	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	62	72	140	15,844	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	165	193	635	71,594	素材
NEWS CORP - CLASS A	121	143	191	21,541	メディア
NEXTERA ENERGY INC	147	173	3,149	354,895	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	130	334	37,658	商業・専門サービス
NIKE INC	411	469	3,406	383,857	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	108	134	349	39,382	公益事業
NOBLE ENERGY INC	144	176	440	49,669	エネルギー
NORDSTROM INC	39	42	220	24,799	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	91	104	1,781	200,763	運輸
NORTHERN TRUST CORP	67	77	761	85,762	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	51	60	1,632	183,966	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	57	77	383	43,249	消費者サービス
NUCOR CORP	99	115	717	80,816	素材
NVIDIA CORP	190	211	3,055	344,261	半導体・半導体製造装置
NVR INC	1	1	309	34,847	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	106	125	1,024	115,483	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	239	279	2,051	231,102	エネルギー
OGE ENERGY CORP	63	73	291	32,830	公益事業
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20	23	312	35,198	運輸
OMNICOM GROUP	73	84	646	72,854	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	-	155	274	30,948	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	120	150	937	105,572	エネルギー
ORACLE CORP	982	1,121	5,554	625,859	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	26	30	1,063	119,856	小売
OWENS CORNING	34	40	196	22,193	資本財
PACCAR INC	110	128	775	87,380	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	29	34	333	37,522	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	
PALO ALTO NETWORKS INC	28	33	551	62,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	41	48	813	91,681	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	70	90	193	21,784	エネルギー
PAYCHEX INC	101	117	806	90,912	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	358	413	3,309	372,884	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	53	61	257	29,043	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	105	120	193	21,772	銀行
PEPSICO INC	446	519	6,182	696,536	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	39	47	301	33,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,869	2,141	9,459	1,065,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	161	189	440	49,664	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	487	569	4,990	562,243	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	136	162	1,537	173,237	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	35	41	368	41,543	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53	62	977	110,152	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	45	54	111	12,561	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	149	171	2,319	261,332	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	18	21	202	22,842	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	79	91	982	110,642	素材
PPL CORPORATION	217	257	809	91,226	公益事業
PRAXAIR INC	89	-	-	-	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	89	103	509	57,395	保険
PROCTER & GAMBLE CO	795	920	8,585	967,357	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	182	212	1,383	155,854	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	132	153	1,402	157,990	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	159	185	1,012	114,124	公益事業
PULTE GROUP INC	83	99	250	28,270	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	24	28	312	35,211	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	39	46	292	32,900	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	462	515	2,827	318,582	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	42	49	467	52,665	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	142	160	365	41,203	小売
RALPH LAUREN CORP	17	20	230	25,984	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	77	-	-	-	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	40	47	371	41,889	各種金融
RAYTHEON CO	90	105	1,854	208,953	資本財
RED HAT INC	55	65	1,126	126,961	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	24	29	985	111,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	362	407	657	74,094	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	20	23	349	39,390	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	12	14	182	20,510	保険
REPUBLIC SERVICES INC	73	83	640	72,169	商業・専門サービス
RESMED INC	44	52	534	60,267	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	38	44	271	30,623	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	40	45	769	86,732	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	51	59	781	88,064	資本財
ROLLINS INC	30	35	216	24,394	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	32	37	1,106	124,662	資本財
ROSS STORES INC	120	138	1,262	142,289	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	53	61	661	74,566	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	80	92	1,633	184,021	各種金融
SABRE CORP	65	96	231	26,045	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	215	258	3,124	352,021	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	42	49	218	24,619	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	434	507	2,449	276,024	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	90	99	419	47,284	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	57	59	216	24,406	素材
SEATTLE GENETICS INC	34	40	230	25,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	41	48	259	29,281	各種金融
SEMPRA ENERGY	75	92	1,063	119,830	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	53	62	288	32,551	資本財
SERVICENOW INC	54	64	1,015	114,409	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26	30	1,281	144,432	素材
SIGNATURE BANK	17	19	233	26,319	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	515	586	354	39,946	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	57	66	470	53,033	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	45	52	239	26,986	資本財
SNAP-ON INC	17	20	337	38,016	資本財
SOUTHERN CO	316	372	1,752	197,408	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	54	285	32,199	運輸
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	8	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	36	41	338	38,160	資本財
SPLUNK INC	43	53	474	53,428	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	256	301	186	21,050	電気通信サービス
SQUARE INC - A	84	106	668	75,332	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	54	78	354	39,943	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	47	56	714	80,463	資本財
STARBUCKS CORP	446	505	3,430	386,534	消費者サービス

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	
STATE STREET CORP	116	133	958	107,944	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	74	85	339	38,256	素材
STERICYCLE INC	26	31	144	16,247	商業・専門サービス
STRYKER CORP	105	123	2,064	232,584	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	148	169	1,067	120,273	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	16	19	463	52,262	銀行
SYMANTEC CORP	194	227	506	57,027	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	245	262	669	75,426	各種金融
SYNOPSIS INC	46	54	464	52,369	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	155	181	1,195	134,725	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	75	88	838	94,473	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	35	41	443	49,933	ソフトウェア・サービス
TAPESTRY INC	89	105	412	46,431	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	67	79	377	42,504	エネルギー
TARGET CORP	161	185	1,441	162,443	小売
TE CONNECTIVITY LTD	110	127	954	107,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	138	159	387	43,664	エネルギー
TELEFLEX INC	14	16	421	47,446	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	11	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA, INC.	42	46	1,649	185,905	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	286	353	778	87,744	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	309	358	3,390	381,956	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	82	93	520	58,661	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	125	147	3,429	386,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	38	40	418	47,178	小売
TIME WARNER INC	244	-	-	-	メディア
TJX COS INC	198	458	2,246	253,088	小売
T-MOBILE US INC	93	125	854	96,244	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	47	52	163	18,455	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	34	38	336	37,969	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	51	59	506	57,061	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39	44	411	46,382	小売
TRANSDIGM GROUP INC	16	17	584	65,895	資本財
TRANSUNION	48	67	411	46,412	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	85	98	1,287	145,101	保険
TRIMBLE INC	78	90	317	35,827	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	35	38	235	26,561	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	138	160	780	87,952	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	330	387	1,893	213,340	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TWITTER INC	198	248	793	89,395	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	93	108	645	72,726	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	55	64	366	41,267	公益事業
ULTA BEAUTY INC	18	21	659	74,300	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	55	70	148	16,675	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	59	67	131	14,839	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	248	285	4,300	484,567	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	23	26	239	27,008	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	218	254	2,827	318,579	運輸
UNITED RENTALS INC	26	30	344	38,775	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	237	278	3,554	400,527	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	13	15	183	20,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	304	351	9,362	1,054,910	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	27	31	417	47,075	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	69	79	283	31,889	保険
US BANCORP	519	569	3,134	353,115	銀行
VAIL RESORTS INC	12	14	386	43,547	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	137	157	1,272	143,325	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	28	33	385	43,386	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	35	44	373	42,029	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	28	40	607	68,451	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	49	57	702	79,168	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,283	1,515	9,189	1,035,388	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	79	93	1,503	169,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	105	122	982	110,655	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	110	130	409	46,095	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	569	654	8,815	993,283	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	80	124	294	33,151	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	22	26	413	46,561	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	55	61	266	30,059	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	41	48	503	56,694	素材
WABCO HOLDINGS INC	15	19	227	25,626	資本財
WABTEC CORP	27	31	275	31,026	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	263	308	2,527	284,733	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	468	540	5,229	589,230	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	474	545	6,294	709,154	メディア
WASTE CONNECTIONS INC	82	95	734	82,747	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	136	158	1,465	165,132	商業・専門サービス
WATERS CORP	24	28	565	63,750	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	
WEC ENERGY GROUP INC	99	116	833	93,869	公益事業
WELLS FARGO & CO	1,467	1,694	9,036	1,018,113	銀行
WESTAR ENERGY INC	45	—	—	—	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP	92	109	493	55,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	143	167	314	35,387	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	13	97	10,953	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	79	93	430	48,543	素材
WEYERHAEUSER CO	236	280	758	85,468	不動産
WHIRLPOOL CORP	22	23	279	31,535	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	259	443	1,122	126,440	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	39	48	769	86,689	保険
WORKDAY INC-CLASS A	43	53	664	74,871	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC	93	108	854	96,220	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	30	34	274	30,892	保険
WR GRACE & CO	21	—	—	—	素材
WW GRAINGER INC	16	17	531	59,847	資本財
WYNDHAM DESTINATIONS INC	31	—	—	—	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	25	35	373	42,085	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	160	187	969	109,178	公益事業
XEROX CORP	68	83	221	25,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	78	92	814	91,768	半導体・半導体製造装置
XL GROUP LTD	80	—	—	—	保険
XPO LOGISTICS INC	—	44	331	37,300	運輸
XYLEM INC	56	65	455	51,276	資本財
YUM! BRANDS INC	100	118	1,043	117,556	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	61	80	209	23,590	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	33	42	116	13,072	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	63	74	844	95,117	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.	62	70	343	38,683	銀行
ZOETIS INC	153	177	1,596	179,824	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	96,098 601	112,261 595	850,286 —	95,801,747 <64.0%>
(カナダ)			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	72	85	402	34,388	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	135	158	1,033	88,391	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	55	97	154	13,206	公益事業
ARC RESOURCES LTD	107	128	140	11,995	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'	26	31	126	10,831	公益事業
AURORA CANNABIS INC	—	239	192	16,428	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF MONTREAL	203	234	2,295	196,268	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	375	438	3,101	265,232	銀行
BARRICK GOLD CORP	364	426	735	62,905	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	104	115	357	30,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	53	62	350	30,005	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	157	186	211	18,096	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC	608	770	159	13,646	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	266	311	1,793	153,397	各種金融
CAE INC	85	97	256	21,973	資本財
CAMECO CORP	124	144	233	19,931	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	136	162	1,845	157,853	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	238	272	3,100	265,114	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	343	450	1,614	138,110	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	46	53	1,474	126,117	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	20	22	350	29,976	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	44	51	163	14,016	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	44	54	287	24,607	素材
CENOVUS ENERGY INC	326	382	405	34,663	エネルギー
CGI GROUP INC	80	93	757	64,809	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	86	98	193	16,542	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	7	660	56,513	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	169	199	99	8,469	エネルギー
DOLLARAMA INC	33	114	397	33,960	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	117	-	-	-	各種金融
EMERA INC	22	26	116	9,980	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	53	63	157	13,501	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	520	624	2,736	234,020	エネルギー
ENCANA CORP	305	353	355	30,391	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	10	618	52,921	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	53	61	166	14,199	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	52	77	151	12,935	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	215	251	311	26,606	素材
FORTIS INC	135	159	735	62,922	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	57	68	604	51,684	素材
GEORGE WESTON LTD	16	28	269	23,039	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	69	78	325	27,806	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	271	317	396	33,935	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	93	107	331	28,310	保険
HUSKY ENERGY INC	110	128	216	18,520	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	
HYDRO ONE LTD	100	127	248	21,257	公益事業
IGM FINANCIAL INC	27	32	108	9,240	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	93	106	440	37,641	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	33	39	193	16,518	保険
INTACT FINANCIAL CORP	44	51	528	45,191	保険
INTER PIPELINE LTD	119	141	321	27,468	エネルギー
KEYERA CORP	63	75	223	19,085	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	387	454	154	13,206	素材
LINAMAR CORP	15	16	80	6,921	自動車・自動車部品
LOBLAW COS LTD	67	69	409	34,992	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	204	235	126	10,858	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	107	123	815	69,731	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	620	725	1,580	135,136	保険
METHANEX CORP	26	24	183	15,724	素材
METRO INC	71	89	384	32,846	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	107	124	754	64,493	銀行
NUTRIEN LTD	202	232	1,600	136,870	素材
ONEX CORPORATION	26	32	274	23,455	各種金融
OPEN TEXT CORP	84	98	421	36,076	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	159	184	828	70,864	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	112	130	350	30,014	保険
POWER FINANCIAL CORP	79	91	258	22,124	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	67	76	143	12,256	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	71	87	618	52,888	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	118	136	962	82,300	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	457	527	5,003	427,936	銀行
SAPUTO INC	67	85	337	28,848	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	76	98	118	10,099	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	171	433	37,037	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	27	32	570	48,782	ソフトウェア・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	55	64	303	25,969	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	192	222	1,077	92,135	保険
SUNCOR ENERGY INC	519	598	2,583	220,907	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	178	185	524	44,828	素材
THOMSON REUTERS CORP	90	105	672	57,478	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	579	675	4,846	414,431	銀行
TOURMALINE OIL CORP	70	94	188	16,123	エネルギー
TRANSCANADA CORP	274	328	1,745	149,312	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	312	355	87	7,469	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
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
VERMILION ENERGY INC		36	52	176	15,086	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		21	21	153	13,163	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		137	161	340	29,079	素材
WSP GLOBAL INC		-	37	245	20,988	資本財
小計		12,669	15,178	61,805	5,285,617	
	株数・金額 銘柄数<比率>	86	87	-	<3.5%>	
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD		217	253	467	38,420	公益事業
ALUMINA LTD		818	936	217	17,860	素材
AMCOR LTD		383	452	610	50,171	素材
AMP LTD		976	1,127	290	23,922	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		176	217	561	46,187	消費者サービス
ASX LTD		68	78	476	39,142	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD		723	846	350	28,805	運輸
AUSNET SERVICES		843	941	150	12,380	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		933	1,078	2,713	223,148	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		139	170	166	13,652	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		167	201	203	16,745	銀行
BHP BILLITON LTD		1,016	1,188	3,849	316,561	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		181	207	266	21,947	素材
BORAL LTD		390	455	241	19,855	素材
BRAMBLES LTD		521	609	625	51,448	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		88	103	272	22,435	エネルギー
CHALLENGER LTD		198	222	215	17,682	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED		33	39	168	13,824	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED		191	212	215	17,760	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		19	22	349	28,701	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		556	652	4,471	367,723	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		155	181	349	28,721	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		131	154	181	14,897	消費者サービス
CSL LIMITED		143	166	3,037	249,787	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		20	23	113	9,334	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		18	22	103	8,474	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		500	600	243	19,987	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		190	234	73	6,078	小売
HEALTHSCOPE LTD		589	693	162	13,392	ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD		572	670	261	21,501	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		785	890	629	51,797	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		147	173	278	22,892	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千ドル	千円		
MACQUARIE GROUP LTD	104	121	1,417	116,554	各種金融	
MEDIBANK PRIVATE LTD	928	1,090	283	23,324	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	856	1,017	2,399	197,336	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	247	290	598	49,227	素材	
OIL SEARCH LTD	460	525	391	32,227	エネルギー	
ORICA LTD	125	150	263	21,692	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED	566	667	457	37,627	エネルギー	
QBE INSURANCE GROUP LTD	442	521	591	48,672	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	47	55	303	24,982	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	20	22	164	13,496	ソフトウェア・サービス	
RIO TINTO LTD	132	154	1,230	101,205	素材	
SANTOS LTD	606	664	405	33,324	エネルギー	
SEEK LTD	114	135	238	19,616	商業・専門サービス	
SONIC HEALTHCARE LTD	136	160	348	28,627	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	1,649	1,909	632	51,974	素材	
SUNCORP GROUP LTD	433	510	685	56,328	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	629	735	331	27,266	消費者サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,408	1,631	494	40,639	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD	136	162	119	9,804	電気通信サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	236	272	390	32,090	食品・飲料・タバコ	
WESFARMERS LIMITED	362	421	1,848	151,982	食品・生活必需品小売り	
WESTPAC BANKING CORP	1,078	1,274	3,200	263,217	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	303	349	1,137	93,509	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	418	494	1,417	116,567	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,350 56	27,167 56	41,670 -	3,426,540 <2.3%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	3,792	4,426	29,017	417,269	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	98	111	831	11,955	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	402	454	1,189	17,104	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,165	1,350	4,091	58,838	銀行	
CK ASSET HOLDINGS LTD	809	964	5,437	78,190	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	854	989	8,194	117,838	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	220	250	1,453	20,904	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD	526	606	5,382	77,394	公益事業	
FIRST PACIFIC CO	720	-	-	-	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	758	868	4,071	58,546	消費者サービス	
HANG LUNG GROUP LTD	300	360	779	11,207	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	631	791	1,238	17,802	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		
HANG SENG BANK LTD	241	279	5,010	72,046	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	382	510	1,985	28,549	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	2,713	3,426	5,236	75,295	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	370	433	9,874	142,001	各種金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	190	260	1,032	14,843	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD	210	250	666	9,580	不動産	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	1,220	-	-	-	各種金融	
LI & FUNG LTD	1,872	2,212	367	5,282	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	308	352	428	6,155	消費者サービス	
MINIH GROUP LTD	220	260	704	10,132	自動車・自動車部品	
MTR CORP	527	597	2,372	34,113	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,876	2,336	2,514	36,155	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	500	560	917	13,190	資本財	
PCCW LTD	1,560	1,830	796	11,447	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	445	515	2,775	39,909	公益事業	
SANDS CHINA LTD	765	889	2,927	42,096	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD	380	480	560	8,062	消費者サービス	
SINO LAND CO	1,000	1,260	1,638	23,554	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	590	720	501	7,206	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	460	595	6,553	94,239	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	163	193	1,710	24,603	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	376	452	1,337	19,239	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	440	505	2,179	31,335	耐久消費財・アパレル	
WH GROUP LTD	2,785	3,240	2,106	30,284	食品・飲料・タバコ	
WHARF HOLDINGS LTD	387	467	974	14,011	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	387	457	2,380	34,230	不動産	
WHEELOK & CO LTD	270	330	1,527	21,971	不動産	
WYNN MACAU LTD	493	577	967	13,906	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	235	270	638	9,182	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	31,648	35,433	122,369	1,759,679	
	銘柄数<比率>	41	39	-	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND LTD	812	986	309	25,440	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	129	156	130	10,703	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	742	843	181	14,892	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	561	651	1,510	124,102	銀行	
GENTING SINGAPORE LTD	1,886	2,171	204	16,768	消費者サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,154	2,237	52	4,319	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	32	35	122	10,060	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	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
KEPPEL CORP LTD		458	524	329	27,082	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		984	1,139	1,263	103,793	銀行
SATS LTD		248	284	137	11,318	運輸
SENBCORP INDUSTRIES LTD		315	357	96	7,891	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		185	207	194	15,988	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		252	281	203	16,740	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		516	604	161	13,251	メディア
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		497	545	190	15,673	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,635	3,060	942	77,443	電気通信サービス
STARHUB LTD		244	-	-	-	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		417	484	1,173	96,442	銀行
UOL Group Limited		153	193	119	9,784	不動産
VENTURE CORP LTD		-	98	146	12,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		503	677	220	18,079	食品・飲料・タバコ
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING		703	811	102	8,463	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,426 21	16,343 21	7,792 -	640,280 <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		-	267	279	21,571	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		326	393	279	21,520	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		178	209	271	20,914	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		214	311	172	13,319	素材
MERCURY NZ LTD		218	-	-	-	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		395	467	151	11,687	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		123	146	173	13,389	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		608	715	294	22,737	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,065 7	2,510 7	1,623 -	125,139 <0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		300	348	282	40,886	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		63	72	144	20,956	保険
ANGLO AMERICAN PLC		416	382	659	95,519	素材
ANTOFAGASTA PLC		121	139	113	16,452	素材
ASHTREAD GROUP PLC		156	179	322	46,715	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		111	130	322	46,715	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		397	463	2,863	414,735	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		307	349	149	21,651	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		1,256	1,460	608	88,047	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC		76	90	53	7,732	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	千イリス・ポンド	千円	
BAE SYSTEMS PLC	1,000	1,166	606	87,804	資本財
BARCLAYS PLC	5,348	6,264	1,039	150,586	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	316	368	181	26,233	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	40	46	155	22,557	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	659	770	1,251	181,183	素材
BP PLC	6,210	7,305	3,818	552,954	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	719	840	2,287	331,211	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	2,666	3,116	797	115,531	電気通信サービス
BUNZL PLC	106	122	281	40,813	資本財
BURBERRY GROUP PLC	133	153	273	39,538	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC	57	65	295	42,739	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,763	2,074	294	42,717	公益事業
COBHAM PLC	755	-	-	-	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	57	73	169	24,479	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	496	580	921	133,457	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	432	504	81	11,781	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	41	48	232	33,691	素材
DCC PLC	28	32	189	27,474	資本財
DIAGEO PLC	782	901	2,511	363,705	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	431	497	157	22,858	保険
EASYJET PLC	52	61	72	10,489	運輸
EXPERIAN PLC	290	336	620	89,861	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	78	84	414	60,069	資本財
FRESNILLO PLC	68	78	70	10,224	素材
G4S PLC	490	569	104	15,124	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,545	1,816	2,849	412,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	3,830	4,212	1,266	183,378	素材
GVC HOLDINGS PLC	-	199	155	22,562	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81	103	189	27,489	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	6,272	7,338	4,780	692,259	銀行
IMI PLC	85	-	-	-	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	299	349	895	129,634	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	-	466	341	49,413	メディア
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	56	66	276	39,992	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	50	59	266	38,609	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	210	245	122	17,805	各種金融
ITV PLC	1,149	1,348	197	28,530	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	60	70	203	29,496	素材
KINGFISHER PLC	677	781	191	27,742	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,863	2,166	533	77,252	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,587	26,401	1,473	213,333	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	97	114	465	67,351	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	507	591	174	25,198	小売
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	114	135	44	6,507	ヘルスケア機器・サービス
MEGGITT PLC	242	280	144	20,889	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	-	1,773	301	43,731	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	223	260	87	12,613	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	136	159	234	33,954	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	115	134	236	34,225	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	699	813	199	28,847	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	1,069	1,239	1,023	148,202	公益事業
NEXT PLC	45	51	266	38,556	小売
NMC HEALTH PLC	-	38	135	19,567	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL PLC	1,544	-	-	-	保険
PEARSON PLC	254	288	271	39,351	メディア
PERSIMMON PLC	96	113	238	34,546	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	811	948	1,485	215,157	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	29	34	219	31,753	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	209	245	1,585	229,579	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	335	734	1,188	172,099	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	379	432	1,682	243,653	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	521	613	488	70,731	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT	-	27,577	2	399	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	36,227	-	-	-	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	1,127	1,755	381	55,213	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,425	1,682	4,027	583,291	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,176	1,372	3,343	484,152	エネルギー
ROYAL MAIL PLC	299	344	106	15,417	運輸
RSA INSURANCE GROUP PLC	320	371	199	28,904	保険
SAGE GROUP PLC	340	397	218	31,708	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	509	638	195	28,381	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	38	44	109	15,899	各種金融
SEVERN TRENT PLC	77	89	165	24,027	公益事業
SHIRE PLC	285	334	1,539	222,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SKY PLC	326	-	-	-	メディア
SMITH & NEPHEW PLC	274	320	445	64,488	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	124	144	203	29,518	資本財
SSE PLC	322	378	418	60,587	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ST JAMES'S PLACE PLC		166	194	195	28,359	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC		1,035	1,028	614	88,940	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		835	853	219	31,751	各種金融
TAYLOR WIMPEY PLC		1,023	1,189	176	25,519	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		2,572	3,581	735	106,519	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC		78	90	91	13,261	資本財
TUI AG-DI		136	158	201	29,170	消費者サービス
UNILEVER PLC		386	447	1,906	276,024	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		222	258	192	27,850	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		8,426	9,847	1,534	222,168	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE		70	87	132	19,129	資本財
WHITBREAD PLC		57	66	304	44,067	消費者サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC		211	248	159	23,089	エネルギー
WPP PLC		398	465	398	57,735	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	130,936 97	138,280 97	64,786 -	9,381,730 <6.3%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		12	16	309	9,420	不動産
BANK HAPOALIM BM		326	380	1,009	30,722	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		449	519	1,263	38,441	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		647	792	369	11,237	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		7	8	366	11,146	資本財
FRUTAROM		12	-	-	-	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		213	252	575	17,524	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		41	48	323	9,832	銀行
NICE LTD		18	22	930	28,305	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,728 9	2,040 8	5,147 -	156,631 <0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		577	674	1,340	152,031	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		50	59	280	31,832	商業・専門サービス
BALOISE HOLDING AG		15	17	255	28,955	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.67	0.82	141	16,043	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.33	0.39	271	30,764	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	238	27,084	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		164	191	1,262	143,222	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		73	73	152	17,295	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		760	938	1,156	131,163	各種金融
DUFREY AG-REG		11	11	123	13,993	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	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	161	18,346	素材
GEBERIT AG-REG	11	13	511	58,043	資本財
GIVAUDAN-REG	2	3	817	92,734	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	70	82	360	40,894	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	18	21	282	32,054	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	142	178	814	92,364	素材
LONZA GROUP AG	23	27	818	92,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	976	1,140	9,497	1,077,172	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	697	793	6,929	785,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR	12	13	97	11,114	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	6	427	48,438	各種金融
ROCHE HOLDING AG	220	257	6,343	719,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6	6	134	15,235	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12	15	300	34,113	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	1	1	445	50,529	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER	0.66	47	589	66,912	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	16	20	305	34,655	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	3	3	239	27,145	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	9	11	364	41,352	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10	12	471	53,494	保険
SWISS PRIME SITE-REG	22	28	233	26,506	不動産
SWISS RE AG	98	114	1,013	115,007	保険
SWISSCOM AG	8	9	461	52,324	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	-	22	274	31,110	ソフトウェア・サービス
THE SWATCH GROUP AG-REG	15	16	97	11,097	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG	1,149	1,414	1,919	217,737	各種金融
VIFOR PHARMA AG	15	16	212	24,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	47	55	1,688	191,459	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,256 37	6,307 38	41,037 -	4,654,480 <3.1%>
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	2	2,120	36,639	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S	1	1	1,156	19,979	運輸
CARLSBERG AS-B	33	39	2,855	49,341	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	31	36	2,270	39,237	素材
COLOPLAST-B	37	43	2,669	46,133	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	235	261	3,544	61,248	銀行
DSV A/S	61	70	3,559	61,506	運輸
GENMAB A/S	18	22	2,088	36,080	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	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
H LUNDBECK A/S		21	25	695	12,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		52	60	1,350	23,338	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S		584	665	19,629	339,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		70	79	2,542	43,930	素材
ORSTED A/S		59	69	3,090	53,411	公益事業
PANDORA A/S		33	40	1,382	23,888	耐久消費財・アパレル
TRYGVESTA AS		35	41	669	11,567	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		67	71	3,265	56,433	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING		36	36	719	12,440	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,383	1,566	53,610	926,384	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
AKER BP ASA		-	39	958	12,729	エネルギー
DNB ASA		307	357	5,369	71,303	銀行
EQUINOR ASA		362	428	8,789	116,724	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		62	72	980	13,023	保険
MARINE HARVEST		130	152	3,019	40,092	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		415	485	2,039	27,084	素材
ORKLA ASA		256	299	2,142	28,445	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-B SHS		30	36	1,027	13,648	メディア
TELENOR ASA		238	280	4,610	61,223	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		55	65	2,237	29,707	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,860	2,219	31,173	413,985	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		93	108	2,151	26,909	資本財
ASSA ABLOY AB		316	369	6,331	79,212	資本財
ATLAS COPCO AB		122	142	2,727	34,127	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		207	-	-	-	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		211	247	5,084	63,609	資本財
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION		119	-	-	-	資本財
BOLIDEN AB		84	98	2,014	25,205	素材
BOLIDEN AB-REDEMPTION		83	-	-	-	素材
ELECTROLUX AB		76	89	1,691	21,160	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		-	247	1,949	24,392	資本財
EPIROC AB-B		-	143	1,087	13,603	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		192	223	4,922	61,584	家庭用品・パーソナル用品
GETINGE AB-B SHS		72	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		298	322	5,170	64,677	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		
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEXAGON AB-B SHS	82	95	4,050	50,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS	135	155	1,045	13,084	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB	24	29	968	12,122	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	52	63	1,160	14,523	各種金融	
INVESTOR AB	143	168	6,425	80,378	各種金融	
KINNEVIK AB - B	73	86	2,031	25,417	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS	24	28	773	9,677	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	61	69	1,684	21,068	エネルギー	
NORDEA BANK AB	954	-	-	-	銀行	
NORDEA BANK ABP	-	1,119	9,096	113,792	銀行	
SANDVIK AB	356	415	5,545	69,376	資本財	
SECURITAS AB	101	117	1,796	22,478	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	478	602	5,626	70,383	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	107	125	1,795	22,463	資本財	
SKF AB	120	139	1,927	24,114	資本財	
SVENSKA HANDELSBANKEN	483	565	5,489	68,667	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	286	336	6,926	86,651	銀行	
SWEDISH MATCH AB	58	65	2,643	33,076	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB	123	139	1,497	18,730	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	970	1,130	8,581	107,352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	921	1,066	4,377	54,758	電気通信サービス	
VOLVO AB	492	575	7,194	89,998	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,931 33	9,088 31	113,770 -	1,423,266 <1.0%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
AIB GROUP PLC	259	301	114	14,746	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	293	361	213	27,489	銀行	
CRH PLC	266	310	743	95,958	素材	
KERRY GROUP PLC-A	50	58	539	69,616	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	25	31	256	33,020	消費者サービス	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	-	83	209	26,985	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	895 5	1,146 6	2,076 -	267,817 <0.2%>	
(ユーロ/オランダ)						
ABN AMRO GROUP NV-CVA	132	154	349	45,078	銀行	
AEGON NV	553	648	345	44,559	保険	
AIRBUS SE	182	213	1,980	255,485	資本財	
AKZO NOBEL NV	78	92	679	87,650	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/オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
	ALTICE NV - A-W/I	171	-	-	-	メディア
	ASML HOLDING NV	121	150	2,162	278,909	半導体・半導体製造装置
	BOSKALIS WESTMINSTER	27	-	-	-	資本財
	CNH INDUSTRIAL NV	322	373	316	40,821	資本財
	EXOR NV	34	39	201	26,037	各種金融
	FERRARI NV	38	45	429	55,388	自動車・自動車部品
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	337	394	567	73,149	自動車・自動車部品
	HEINEKEN HOLDING NV	36	42	329	42,477	食品・飲料・タバコ
	HEINEKEN NV	81	95	765	98,759	食品・飲料・タバコ
	ING GROEP NV-CVA	1,217	1,425	1,551	200,142	銀行
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	401	456	1,044	134,710	食品・生活必需品小売り
	KONINKLIJKE DSM NV	56	66	516	66,670	素材
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	295	344	1,127	145,478	ヘルスケア機器・サービス
	NN GROUP NV	95	109	416	53,725	保険
	QIAGEN NV	68	82	246	31,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	RANDSTAD NV	37	43	182	23,523	商業・専門サービス
	RELX NV	303	-	-	-	商業・専門サービス
	ROYAL KPN NV	1,101	1,299	312	40,361	電気通信サービス
	STMICROELECTRONICS NV	200	252	308	39,763	半導体・半導体製造装置
	UNILEVER NV	511	565	2,755	355,348	家庭用品・パーソナル用品
	VOPAK	21	25	100	12,948	エネルギー
	WOLTERS KLUWER NV	90	106	552	71,238	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,518	7,028	17,242	2,223,972	
(ユーロ/ベルギー)						
	AGEAS	58	66	295	38,062	保険
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	239	279	1,911	246,516	食品・飲料・タバコ
	COLRUYT NV	17	21	122	15,758	食品・生活必需品小売り
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	24	29	235	30,385	各種金融
	KBC GROEP NV	78	91	568	73,338	銀行
	PROXIMUS	51	60	142	18,347	電気通信サービス
	SOLVAY SA	23	27	275	35,536	素材
	TELENET GROUP HOLDING NV	17	20	88	11,439	メディア
	UCB SA	39	46	351	45,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	UMICORE	65	76	312	40,248	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	616	720	4,302	554,924	
		10	10	-	<0.4%>	

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/ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELORMITTAL		207	244	530	68,389	素材
RTL GROUP		12	14	76	9,855	メディア
TENARIS SA		147	172	209	26,998	エネルギー
小計	株数・金額	367	432	815	105,243	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.1%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		58	71	277	35,735	消費者サービス
ADP		10	12	214	27,604	運輸
AIR LIQUIDE		134	158	1,666	214,945	素材
ALSTOM RGPT		48	59	227	29,302	資本財
AMUNDI SA		18	23	113	14,596	各種金融
ARKEMA		21	26	229	29,662	素材
ATOS SE		29	35	252	32,591	ソフトウェア・サービス
AXA		607	714	1,549	199,874	保険
BIOMERIEUX		12	16	103	13,393	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		352	413	1,873	241,677	銀行
BOLLORE		301	376	145	18,795	運輸
BOUYGUES		67	82	270	34,928	資本財
BUREAU VERITAS SA		84	103	199	25,732	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		50	59	610	78,788	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		182	215	374	48,283	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON		16	21	81	10,525	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		156	185	579	74,763	資本財
CNP ASSURANCES		54	70	142	18,328	保険
CREDIT AGRICOLE SA		357	427	465	60,066	銀行
DANONE		189	227	1,474	190,145	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		0.80	0.97	131	16,902	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		40	48	513	66,241	ソフトウェア・サービス
EDENRED		70	88	290	37,415	商業・専門サービス
EDF		181	220	329	42,494	公益事業
EIFFAGE		23	31	272	35,127	資本財
ENGIE		574	681	830	107,181	公益事業
ESSILORLUXOTTICA		65	77	889	114,730	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO		14	18	123	15,959	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC		3	4	165	21,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		56	67	125	16,176	メディア
FAURECIA		23	29	115	14,948	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR		162	195	214	27,649	運輸
HERMES INTERNATIONAL		10	11	570	73,604	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	
ILIAD SA	8	10	112	14,512	電気通信サービス
IMERYS SA	11	14	73	9,531	素材
INGENICO GROUP	18	22	141	18,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	11	14	170	22,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	23	31	89	11,594	メディア
KERING	23	27	1,068	137,778	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.	37	-	-	-	メディア
LEGRAND SA	83	100	531	68,534	資本財
L'OREAL SA	79	93	1,915	247,042	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	87	102	2,651	341,937	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	53	63	565	72,993	自動車・自動車部品
NATIXIS	296	368	181	23,376	各種金融
ORANGE S.A.	636	756	1,109	143,045	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	66	78	1,103	142,354	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	183	217	429	55,421	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	65	78	414	53,473	メディア
REMY COINTREAU	7	8	91	11,787	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	60	71	419	54,153	自動車・自動車部品
REXEL SA	95	115	117	15,124	資本財
SAFRAN SA	104	123	1,328	171,369	資本財
SANOFI	356	413	3,245	418,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	177	201	1,279	165,002	資本財
SCOR REGROUPE	53	63	266	34,399	保険
SEB SA	7	8	102	13,253	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA	8	10	95	12,267	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE	240	283	936	120,734	銀行
SODEXO	28	33	309	39,881	消費者サービス
SUEZ	118	145	192	24,869	公益事業
TELEPERFORMANCE	18	21	310	40,097	商業・専門サービス
THALES SA	33	40	440	56,862	資本財
TOTAL SA	753	879	4,355	561,810	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	19	29	198	25,570	ソフトウェア・サービス
VALEO SA	75	89	221	28,583	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	152	205	378	48,881	公益事業
VINCI SA	159	187	1,440	185,800	資本財
VIVENDI SA	326	386	836	107,904	メディア
WENDEL	9	11	123	15,877	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,478 70	10,086 69	42,674 -	5,504,213 <3.7%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
1 AND 1 DRILLISCH AG	17	20	89	11,519	電気通信サービス
ADIDAS AG	59	69	1,385	178,730	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	139	161	3,038	391,913	保険
AXEL SPRINGER SE	15	18	108	14,004	メディア
BASF SE	287	336	2,320	299,291	素材
BAYER AG	259	333	2,080	268,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	103	121	901	116,276	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	17	19	129	16,689	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	31	36	336	43,415	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	48	56	237	30,625	資本財
COMMERZBANK AG	333	367	298	38,497	銀行
CONTINENTAL AG	34	40	546	70,454	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	50	70	392	50,578	素材
DAIMLER AG	302	333	1,680	216,762	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE	-	33	109	14,148	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BANK AG	530	719	616	79,510	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG	60	70	788	101,759	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	75	88	179	23,109	運輸
DEUTSCHE POST AG	309	367	1,033	133,256	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,055	1,236	1,875	241,897	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	111	133	544	70,268	不動産
E.ON SE	692	810	746	96,253	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	50	59	152	19,713	素材
FRAPORT AG	14	17	112	14,461	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	130	152	785	101,311	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	21	25	100	12,980	素材
GEA GROUP AG	57	63	163	21,108	資本財
HANNOVER RUECK SE	18	21	264	34,052	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	46	54	322	41,628	素材
HENKEL AG & CO KGAA	32	37	336	43,426	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	55	65	641	82,716	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	5	6	86	11,192	資本財
HUGO BOSS AG	19	23	141	18,229	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	355	415	710	91,595	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	43	51	206	26,659	公益事業
K+S AG	60	70	115	14,905	素材
KION GROUP AG	22	25	131	17,004	資本財
LANXESS	28	31	162	20,995	素材
LINDE AG - TENDER	58	-	-	-	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/ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MAN SE		10	-	-	-	資本財
MERCK KGAA		40	47	458	59,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG		54	64	92	11,936	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG		16	18	342	44,169	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		48	54	1,041	134,285	保険
OSRAM LICHT AG		31	36	117	15,096	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		47	55	320	41,294	自動車・自動車部品
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG		73	87	151	19,520	メディア
PUMA AG		1	3	133	17,195	耐久消費財・アパレル
RWE AG		163	190	368	47,498	公益事業
SAP SE		308	359	3,201	412,905	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		-	13	148	19,205	ヘルスケア機器・サービス
SCHAEFFLER AG		50	60	47	6,152	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		239	280	2,800	361,242	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		-	54	201	25,989	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG		38	45	322	41,572	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		245	291	100	12,936	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		137	159	257	33,196	素材
UNIPER SE		61	73	190	24,620	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		38	44	172	22,313	ソフトウェア・サービス
VOLKSWAGEN AG		10	11	158	20,419	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		58	68	1,006	129,761	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		152	181	766	98,837	不動産
WIRECARD AG		36	42	591	76,297	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE		34	40	111	14,382	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,457 61	8,853 62	36,975 -	4,769,157 <3.2%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		748	949	292	37,722	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		156	182	265	34,255	エネルギー
JERONIMO MARTINS		78	91	97	12,525	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	983 3	1,223 3	655 -	84,502 <0.1%>	
(ユーロ/スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		74	93	309	39,922	資本財
AENA SME SA		22	26	351	45,321	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		137	160	1,057	136,432	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		2,087	2,438	1,197	154,409	銀行
BANCO DE SABADELL SA		1,670	2,046	235	30,351	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ/スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO SANTANDER SA	5,058	5,907	2,483	320,265	銀行	
BANKIA SA	384	447	129	16,697	銀行	
BANKINTER SA	209	243	185	23,950	銀行	
CAIXABANK	1,123	1,310	486	62,724	銀行	
ENAGAS SA	70	82	201	25,972	エネルギー	
ENDESA SA	98	117	237	30,661	公益事業	
FERROVIAL S.A.	152	177	312	40,327	資本財	
FERROVIAL SA - RTS	-	173	7	918	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	152	-	-	-	資本財	
GRIFOLS SA	93	109	285	36,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	1,822	2,193	1,468	189,420	公益事業	
INDITEX SA	341	399	1,006	129,771	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	200	233	166	21,539	運輸	
MAPFRE SA	313	374	94	12,227	保険	
NATURGY ENERGY GROUP SA	109	130	300	38,766	公益事業	
RED ELECTRICA DE ESPANA	136	161	306	39,472	公益事業	
REPSOL SA	385	493	769	99,313	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	73	86	101	13,065	資本財	
TELEFONICA SA	1,478	1,738	1,297	167,406	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	16,197	19,145	12,992	1,675,754	
		23	23	-	<1.1%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	390	429	620	80,027	保険	
ATLANTIA SPA	148	190	343	44,319	運輸	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	183	214	164	21,210	食品・飲料・タバコ	
ENEL SPA	2,557	2,999	1,368	176,507	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	795	932	1,372	177,048	エネルギー	
INTESA SANPAOLO	4,504	5,462	1,052	135,709	銀行	
LEONARDO SPA	126	148	123	15,935	資本財	
LUXOTTICA GROUP SPA	53	62	330	42,655	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	194	228	169	21,804	銀行	
MONCLER SPA	-	65	197	25,432	耐久消費財・アパレル	
PIRELLI & C SPA	-	148	93	12,045	自動車・自動車部品	
POSTE ITALIANE SPA	164	188	123	15,969	保険	
PRYSMIAN SPA	64	88	141	18,238	資本財	
RECORDATI SPA	33	38	110	14,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SNAM SPA	717	830	322	41,619	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA	5,099	6,056	331	42,729	電気通信サービス	
TERNA SPA	452	535	261	33,721	公益事業	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNICREDIT SPA		629	735	796	102,699	銀行
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		300	-	-	-	保険
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	16,415 17	19,355 18	7,922 -	1,021,907 <0.7%>
(ユーロ/フィンランド)						
ELISA OYJ		47	55	206	26,595	電気通信サービス
FORTUM OYJ		139	164	310	40,089	公益事業
KONE OYJ		105	123	530	68,470	資本財
METSO OYJ		35	38	100	13,006	資本財
NESTE OYJ		39	46	328	42,398	エネルギー
NOKIA OYJ		1,834	2,067	1,043	134,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		36	42	116	15,061	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		32	38	113	14,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		139	161	646	83,429	保険
STORA ENSO OYJ		172	201	245	31,666	素材
UPM-KYMMENE OYJ		166	194	507	65,442	素材
WARTSILA OYJ		138	162	235	30,317	資本財
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	2,888 12	3,298 12	4,385 -	565,628 <0.4%>
(ユーロ/オーストリア)						
ANDRITZ AG		22	26	111	14,421	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		94	110	391	50,520	銀行
OMV AG		45	53	243	31,445	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		46	53	142	18,340	銀行
VOESTALPINE AG		35	41	124	16,068	素材
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	245 5	285 5	1,014 -	130,795 <0.1%>
(ユーロ/その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		67	79	541	69,794	ヘルスケア機器・サービス
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	67 1	79 1	541 -	69,794 <0.0%>
ユーロ計		株数・金額 銘柄数<比率>	61,132 236	71,655 235	131,599 -	16,973,711 <11.3%>
合計		株数・金額 銘柄数<比率>	390,489 1,250	440,051 1,241	- -	140,969,194 <94.2%>

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国 (外貨建) 投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	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	4	5	724	81,630	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	12	15	1,719	193,726	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	3	473	53,317	
PROLOGIS INC	16	23	1,572	177,139	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	35	41	417	47,029	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	5	968	109,111	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	3	325	36,694	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4	5	289	32,586	
DUKE REALTY CORP	11	13	383	43,173	
EQUITY RESIDENTIAL	11	13	952	107,296	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	2	636	71,689	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	2	359	40,475	
GGP INC	18	—	—	—	
HCP INC	14	17	503	56,687	
WELLTOWER INC	11	13	969	109,273	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	23	27	529	59,626	
KIMCO REALTY CORP	13	15	247	27,898	
LIBERTY PROPERTY TRUST	4	5	248	28,024	
MACERICH CO/THE	3	4	199	22,487	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	4	433	48,876	
PUBLIC STORAGE	4	5	1,233	138,936	
REGENCY CENTERS CORP	4	5	365	41,184	
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	11	2,138	240,969	
SL GREEN REALTY CORP	3	3	311	35,088	
UDR INC	8	10	422	47,638	
VENTAS INC	11	13	817	92,119	
VORNADO REALTY TRUST	5	6	460	51,859	
REALTY INCOME CORP	8	10	682	76,925	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	4	452	50,927	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6	7	854	96,245	
IRON MOUNTAIN INC	8	10	341	38,521	
AGNC INVESTMENT CORP	11	16	294	33,163	
AMERICAN TOWER REIT INC	13	16	2,706	304,929	
EQUINIX INC	2	2	1,127	127,024	
VEREIT	30	36	277	31,232	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	9	—	—	—	
COLONY CAPITAL INC	15	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	3	4	743	83,746	
INVITATION HOMES INC	9	11	250	28,183	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	8	160	18,129	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	378 39	413 37	25,593 —	2,883,569 <1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		2	3	103	8,839
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		4	6	136	11,670
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5	6	168	14,446
小計	□数・金額	11	16	408	34,956
	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		35	43	440	36,234
GPT GROUP		63	79	419	34,533
GOODMAN GROUP		61	65	680	55,963
STOCKLAND		85	103	374	30,834
WESTFIELD CORP		64	—	—	—
MIRVAC GROUP		130	159	350	28,861
VICINITY CENTRES		116	142	381	31,335
SCENTRE GROUP		176	214	828	68,168
小計	□数・金額	733	808	3,477	285,930
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		69	80	5,895	84,773
小計	□数・金額	69	80	5,895	84,773
	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		79	98	250	20,614
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		77	102	174	14,373
CAPITALAND MALL TRUST		78	98	216	17,779
SUNTEC REIT		80	85	152	12,490
小計	□数・金額	315	385	794	65,258
	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		29	35	210	30,496
HAMMERSON PLC		25	29	125	18,200
LAND SECURITIES GROUP PLC		23	28	240	34,824
SEGRO PLC		31	38	238	34,546
小計	□数・金額	109	133	815	118,068
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE		3	—	—	—
KLEPIERRE		6	8	243	31,468
GECINA SA		1	1	238	30,809
COVIVIO		1	1	153	19,850
ICADE		1	1	114	14,768
小計	口数・金額	13	13	751	96,897
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.1%>
合計	口数・金額	1,631	1,850	—	3,569,453
	銘柄数<比率>	64	60	—	<2.4%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外 国	S&P 500 EMINI FUTURE	3,691	—
	FTSE 100	374	—
	DJ EURO STOXX 50	934	—

(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

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	140,969,194	93.9
投資信託証券	3,569,453	2.4
コール・ローン等、その他	5,650,604	3.8
投資信託財産総額	150,189,252	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1香港ドル14.38円、1シンガポール・ドル82.17円、1ニュージーランド・ドル77.08円、1イギリス・ポンド144.81円、1イスラエル・シケル30.43円、1スイス・フラン113.42円、1デンマーク・クローネ17.28円、1ノルウェー・クローネ13.28円、1スウェーデン・クローナ12.51円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（146,483,125千円）の投資信託財産総額（150,189,252千円）に対する比率は97.5%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	153,273,493,759円
コーポレート債	3,993,301,687
株式(評価額)	140,969,194,066
投資信託証券(評価額)	3,569,453,040
未収入金	3,228,451,575
未収配当金	227,585,194
差入委託証拠金	1,285,508,197
(B)負債	3,555,232,007
未払金	3,242,016,970
未払解約金	313,161,773
その他未払費用	53,264
(C)純資産総額(A-B)	149,718,261,752
元本	88,596,175,879
次期繰越損益金	61,122,085,873
(D)受益権総口数	88,596,175,879口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,899円

(注1) 期首元本額	76,045,712,874円
期中追加設定元本額	19,369,725,952円
期中一部解約元本額	6,819,262,947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)	562,227,597円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,650,340,512円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	2,084,617,874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)	11,709,845,155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	60,295,944,002円
DCニッセイ外国株式インデックス	10,792,141,547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)	406,450,400円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	13,254,832円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,183,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	7,256,656円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	10,766,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,134,713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)	14,090,128円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,703,740円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,668,453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)	602,496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)	8,947,629円

損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,434,148,695円
受取配当金	1,432,218,552
受取利息	2,799,914
その他の収益	237,046
支払利息	△ 1,106,817
(B)有価証券売買損益	△ 5,232,112,285
売却益	7,659,015,136
買入損	△ 12,891,127,421
(C)先物取引等損益	△ 81,466,139
取引益	269,623,448
取引損	△ 351,089,587
(D)信託報酬等	△ 41,537,027
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,920,966,756
(F)前期繰越損益金	55,641,079,258
(G)追加信託差損益金	14,601,931,938
(H)解約差損益金	△ 5,199,958,567
(I)合計(E+F+G+H)	61,122,085,873
次期繰越損益金(I)	61,122,085,873

- (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 1 期

(計算期間：2017年8月7日～2018年11月20日)

運用方針

主に新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、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）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（DR（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。



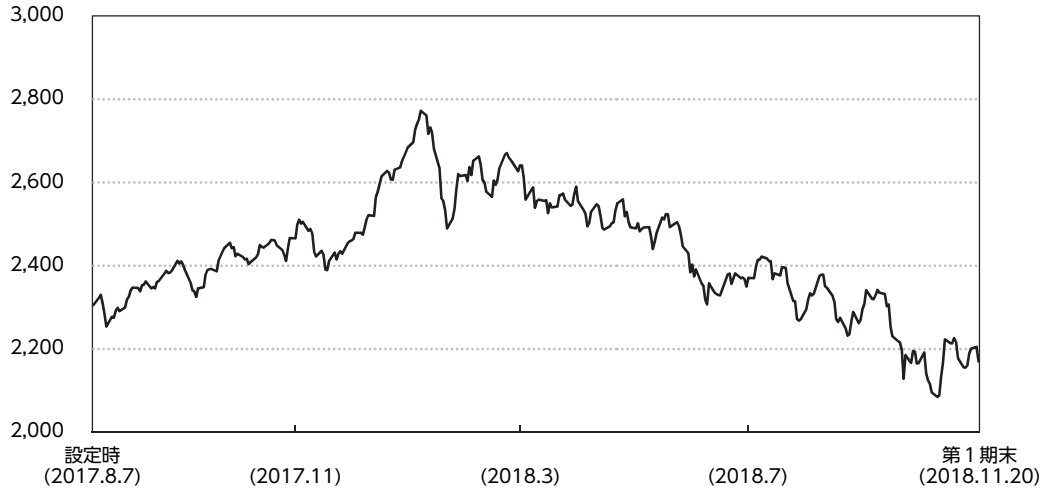
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過 2017年8月7日～2018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】

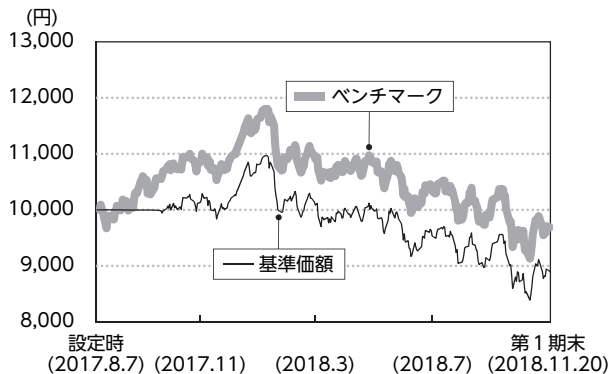


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の新興国株式市場は、期を通じて見ると下落しました。

2017年10月に国際通貨基金（IMF）が世界経済見通しを上方修正したことや良好な企業業績を受けて株価は緩やかに上昇し、1月以降も世界経済の成長を背景にユーフォリア（過度な楽観）に包まれた相場環境となり、急上昇する展開となりました。2月以降は、金利の急上昇や米ドル高への警戒感が高まり株価は下落し、その後も、先進国における金融引き締めや米ドル高の進行、米中貿易摩擦に対する懸念などを背景に、期末にかけて下落基調が続きました。

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、新興国株式市場が下落したことから、同様の動きとなりました。

2017年10月にIMFが世界経済見通しを上方修正したことや良好な企業業績を受けて株価が緩やかに上昇し、1月以降も世界経済の成長を背景にユーフォリアに包まれた相場環境となったことから株価が急上昇したことを受けて、基準価額は大きく上昇しました。2月以降は、金利の急上昇や米ドル高への警戒感が高まり株価は下落しました。その後も、先進国における金融引き締めや米ドル高の進行、米中貿易摩擦に対する懸念などを背景に、期末にかけて株価は下落基調が続き、基準価額も下落して当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

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-11.0%となり、ベンチマーク騰落率（-3.1%）を下回りました。

これはマザーファンドにおける証券保管費用および売買費用等の要因に加え、運用開始にあたり新興国の口座開設に一定期間が必要であったことから、ベンチマークとの値動きにかい離が生じました。これら要因を除くと、おおむねベンチマークに連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

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

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

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注4) 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
(設定日)2017年8月7日	円	%		%	%	%	%
	10,000	—	10,000	—	—	—	—
8月末	9,999	△0.0	10,183	1.8	—	—	—
9月末	9,999	△0.0	10,277	2.8	—	—	—
10月末	10,010	0.1	10,721	7.2	82.2	9.2	9.8
11月末	10,130	1.3	10,861	8.6	82.2	8.1	9.7
12月末	10,360	3.6	11,117	11.2	89.0	9.7	1.7
2018年1月末	10,747	7.5	11,567	15.7	90.9	7.3	1.6
2月末	10,258	2.6	11,092	10.9	88.9	9.4	1.6
3月末	9,838	△1.6	10,637	6.4	87.7	10.3	1.6
4月末	9,906	△0.9	10,723	7.2	88.0	10.2	1.6
5月末	9,582	△4.2	10,386	3.9	85.5	12.7	1.6
6月末	9,201	△8.0	9,974	△0.3	88.2	9.6	1.8
7月末	9,657	△3.4	10,481	4.8	91.6	6.1	2.0
8月末	9,391	△6.1	10,189	1.9	87.8	10.0	1.9
9月末	9,558	△4.4	10,373	3.7	88.3	9.3	2.0
10月末	8,491	△15.1	9,231	△7.7	91.5	5.7	2.4
(期末)2018年11月20日	8,898	△11.0	9,691	△3.1	88.6	8.8	2.2

(注) 騰落率は設定日比です。

1万口当たりの費用明細

2017年8月7日～2018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	33円	0.339%	
(株式)	(30)	(0.304)	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)	(2)	(0.017)	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)	(2)	(0.018)	
有価証券取引税	8	0.085	
(株式)	(8)	(0.084)	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	148	1.507	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)	(136)	(1.388)	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)	(12)	(0.119)	・ 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	189	1.931	

(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（9,805円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年8月7日～2018年11月20日

(1) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
アメリカ	百株 710	千米ドル 1,945	百株 42	千米ドル 49
香港	23,404 (191)	千香港ドル 27,687 (△ 7)	552	千香港ドル 616
台湾	8,760 (△ 105)	千台湾ドル 52,897 (△ 153)	280	千台湾ドル 1,247
トルコ	340 (18)	千トルコ・リラ 409	37	千トルコ・リラ 20
メキシコ	2,302	千メキシコ・ペソ 8,504 (△ 4)	85	千メキシコ・ペソ 254
フィリピン	1,486 (0.06)	千フィリピン・ペソ 7,048	61	千フィリピン・ペソ 223
チリ	7,020 (11)	千チリ・ペソ 95,272 (△ 0.735)	509	千チリ・ペソ 6,234
コロンビア	257	千コロンビア・ペソ 161,622	6	千コロンビア・ペソ 6,864
インド	1,384 (98)	千インド・ルピー 83,837	65	千インド・ルピー 678
インドネシア	7,411 (780)	千インドネシア・ルピア 4,164,546	863	千インドネシア・ルピア 164,703
ブラジル	1,377 (33)	千ブラジル・リアル 3,560	48	千ブラジル・リアル 85

外国

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	チェコ	百株 20	千チェコ・コルナ 523 (△ 0.676)	百株 1	千チェコ・コルナ 34
	韓国	288 (125)	千韓国ウォン 2,513,384	13	千韓国ウォン 75,696
	中国	13	千人民元 115	—	千人民元 —
	マレーシア	1,828 (121)	千マレーシア・リングgit 1,299	183	千マレーシア・リングgit 39
	南アフリカ	906 (5)	千南アフリカ・ランド 12,805	143	千南アフリカ・ランド 468
	タイ	2,295 (203)	千タイ・バーツ 10,082	111	千タイ・バーツ 202
	ポーランド	193	千ポーランド・ズロチ 634	37	千ポーランド・ズロチ 30
	ハンガリー	15	千ハンガリー・フォリント 10,852	0.27	千ハンガリー・フォリント 215
	ユーロ ギリシャ	25	千ユーロ 32 (△ 0.092)	1	千ユーロ 2

(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) 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 INDIA ETF	24	829	24	844
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	7	121	—	—
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	9	151	—	—
(トルコ)		千トルコ・リラ		千トルコ・リラ
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	3	10	0.113	0.277
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8	259	—	—
		(△ 3)		
(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	6	173	0.055	1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	0.503	53	0.018	1
RESILIENT REIT LTD	0.639	89	0.008	1
REDEFINE PROPERTIES LTD	14	156	0.193	1
FORTRESS REIT LTD-A	1	33	—	—
FORTRESS REIT LTD-B	1	66	0.025	1
	(0.252)			

(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
	1,459	1,298	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2017年8月7日～2018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
TENCENT HOLDINGS LTD	17	91,491	5,139	TENCENT HOLDINGS LTD	0.400	2,306	5,766
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4	76,968	17,284	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.008	2,145	268,129
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	3	73,570	20,062	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	0.100	2,000	20,006
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	77	67,237	873	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2	1,702	851
NASPERS LTD-N SHS	1	35,979	26,474	MINTH GROUP LTD	2	1,231	615
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	298	30,057	100	NASPERS LTD-N SHS	0.027	904	33,494
BAIDU INC - SPON ADR	0.863	23,841	27,626	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	0.100	892	8,923
CHINA MOBILE LTD/HK	18	20,523	1,109	SILICONWARE PRECISION INDS	4	753	188
IND & COMM BK OF CHINA - H	214	19,069	89	ENEL GENERACION CHILE SA	6	531	86
HON HAI PRECISION INDUSTRY	45	16,824	373	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5	491	98

(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

2018年11月20日現在

(1) 外国株式

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
(アメリカ)				
51JOB INC-ADR	1	6	744	商業・専門サービス
58.COM INC-ADR	3	19	2,218	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	35	533	60,095	ソフトウェア・サービス
AUTOHOME INC-ADR	1	9	1,114	ソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	8	158	17,802	ソフトウェア・サービス
BAOZUN INC-SPN ADR	1	3	350	ソフトウェア・サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	7	879	素材
CREDICORP LTD	1	41	4,638	銀行
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	12	32	3,617	小売
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1	2	310	ソフトウェア・サービス
HUAZHU GROUP LIMITED ADR	3	8	930	消費者サービス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	21	2	288	エネルギー
JD.COM INC-ADR	22	47	5,351	小売
LUKOIL PJSC-SPON ADR	13	98	11,126	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	9	13	1,468	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	4	3	432	素材
MOBILE TELESYSTEMS PJSC	10	8	986	電気通信サービス
MOMO INC-SPON ADR	3	11	1,261	ソフトウェア・サービス
NETEASE.COM INC -ADR	2	69	7,832	ソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	3	18	2,057	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	1	4	459	各種金融
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2	50	5,721	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3	7	892	素材
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	3	4	473	素材
PJSC GAZPROM ADR	167	78	8,856	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	19	33	3,803	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	1	5	570	素材
ROSNEFT OJSC-GDR	38	24	2,793	エネルギー
RUSHYDRO PJSC-ADR	28	2	243	公益事業
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	87	108	12,229	銀行
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	5	8	945	素材
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	19	2	291	不動産
SINA CORP	1	8	918	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN COPPER CORP	2	8	982	素材
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	35	14	1,621	エネルギー
TAL EDUCATION GROUP- ADR	10	28	3,179	消費者サービス
TATNEFT-SPONSORED ADR	8	56	6,403	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8	4	523	小売
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	42	5	646	銀行
WEIBO CORP-SPON ADR	1	7	857	ソフトウェア・サービス
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2	7	794	食品・生活必需品小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	10	38	4,304	消費者サービス
YY INC-ADR	1	8	1,005	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	668 43	1,615 -	182,024 <11.1%>
(香港)		千香港ドル		
3SBIO INC	25	30	445	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	112	1,610	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	40	40	575	不動産
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	900	315	4,542	銀行
AIR CHINA LIMITED-H	40	30	431	運輸
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100	76	1,097	ヘルスケア機器・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200	23	342	メディア
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	60	17	257	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
ANGANG STEEL CO LTD-H	20	12	183	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	40	159	2,292	素材
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30	109	1,568	耐久消費財・アパレル
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	23	341	資本財
BAIC MOTOR CORP LTD-H	40	18	264	自動車・自動車部品
BANK OF CHINA LTD - H	2,420	820	11,797	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	240	142	2,050	銀行
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	35	514	運輸
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10	45	647	公益事業
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	69	1,000	公益事業
BOC AVIATION LTD	5	31	447	資本財
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	80	55	792	自動車・自動車部品
BYD CO LTD	15	87	1,261	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10	11	161	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CGN POWER CO LTD-H	200	39	566	公益事業
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	180	37	535	各種金融
CHINA CITIC BANK	240	120	1,739	銀行
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	100	79	1,136	資本財
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	40	28	405	電気通信サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	45	105	1,517	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,930	1,922	27,639	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	55	17	249	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	50	17	253	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	90	64	921	商業・専門サービス
CHINA EVERBRIGHT LTD	20	29	427	各種金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	70	140	2,013	不動産
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	80	25	364	自動車・自動車部品
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	65	27	400	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	52	133	1,925	公益事業
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	210	33	486	各種金融
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	24	35	513	各種金融
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	120	43	628	不動産
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	230	388	5,582	保険
CHINA LITERATURE LTD	4	18	267	メディア
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	60	35	515	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	30	29	417	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	195	2,812	食品・飲料・タバコ
CHINA MERCHANTS BANK - H	120	381	5,487	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	40	59	858	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MINSHENG BANKING-H	144	84	1,215	銀行
CHINA MOBILE LTD/HK	185	1,429	20,550	電気通信サービス
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	60	19	278	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	80	47	677	素材
CHINA OILFIELD SERVICES-H	40	28	414	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	120	330	4,745	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	76	229	3,300	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	780	528	7,593	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	140	239	3,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	100	18	261	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	90	69	996	資本財
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	40	43	625	資本財
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	130	20	291	保険
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	40	119	1,711	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	60	42	614	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	20	58	846	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	100	298	4,285	不動産
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	40	49	707	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	59	853	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	100	186	2,686	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40	21	303	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40	25	361	資本財
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	44	115	1,660	保険
CHINA TELECOM CORP LTD-H	420	174	2,506	電気通信サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	900	106	1,527	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	32	465	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	159	2,290	電気通信サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	26	72	1,046	不動産
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	400	9	135	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	50	22	327	銀行
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	80	29	424	不動産
CITIC LTD	160	199	2,871	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	50	76	1,094	各種金融
CNOOC LTD	540	720	10,358	エネルギー
COSCO PACIFIC LTD	20	15	229	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	230	215	3,102	不動産
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	30	34	502	商業・専門サービス
CRRC CORP LTD H	90	65	946	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	45	27	392	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	80	62	891	自動車・自動車部品
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20	139	2,011	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	40	30	441	各種金融
FOSUN INTERNATIONAL	55	70	1,017	資本財
FULLSHARE HOLDINGS LTD	125	38	555	資本財
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	40	19	278	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8	20	291	自動車・自動車部品
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	250	13	194	半導体・半導体製造装置
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	227	3,270	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20	28	415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	30	35	516	各種金融
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	200	13	195	小売
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	65	31	451	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	20	12	177	不動産
GUANGDONG INVESTMENT LTD	80	115	1,658	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56	45	649	自動車・自動車部品
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	16	19	275	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	14	23	341	各種金融
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	30	55	793	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10	17	246	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	68	58	840	各種金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20	126	1,813	家庭用品・パーソナル用品
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10	16	231	半導体・半導体製造装置
HUANENG POWER INTL INC-H	80	38	557	公益事業
HUANENG RENEWABLES CORP-H	80	19	273	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	34	47	680	各種金融
IND & COMM BK OF CHINA - H	2,100	1,144	16,457	銀行
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	21	310	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	20	18	269	素材
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	20	29	430	不動産
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	20	44	645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	17	244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	40	30	439	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	10	12	184	ソフトウェア・サービス
KUNLUN ENERGY CO LTD	60	55	803	エネルギー
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65	42	608	不動産
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	30	20	301	素材
LEGEND GROUP LTD	180	105	1,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEGEND HOLDINGS CORP-H	10	23	337	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	40	34	491	不動産
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	40	86	1,248	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	25	16	231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITU INC	25	10	156	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MMG LTD	40	14	209	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	22	80	1,154	保険
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	20	23	341	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	23	342	素材
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	150	52	754	保険
PETROCHINA CO LTD-H	640	362	5,218	エネルギー
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	190	155	2,240	保険
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	160	1,228	17,670	保険
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	70	32	461	銀行
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	60	41	591	半導体・半導体製造装置
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40	29	429	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	40	11	158	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10	28	407	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	17	252	資本財
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13	24	357	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	20	30	441	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	80	20	293	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20	189	2,729	耐久消費財・アパレル
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	30	55	798	不動産
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	80	13	199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINO BIOPHARMACEUTICAL	180	135	1,943	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	20	295	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	30	21	309	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	60	22	319	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	28	109	1,578	ヘルスケア機器・サービス
SOHO CHINA LTD	45	13	199	不動産
SSY GROUP LTD	40	32	472	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	50	721	食品・生活必需品小売り
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	60	150	2,161	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	21	162	2,343	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD	174	5,066	72,861	ソフトウェア・サービス
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	40	52	760	食品・飲料・タバコ
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20	40	580	ソフトウェア・サービス
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	23	333	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	110	61	882	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
WEICHAI POWER CO LTD-H	30	26	374	資本財
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	15	101	1,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	60	18	263	半導体・半導体製造装置
YANZHOU COAL MINING CO-H	40	30	444	エネルギー
YUEXIU PROPERTY CO LTD	160	22	322	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	35	24	355	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	20	12	182	運輸
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	10	15	217	小売
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	12	51	744	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	180	52	748	素材
ZTE CORP-H	12	19	284	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	24,123 -	346,898 <21.1%>
(台湾)		千台湾ドル		
ACER INC	50	97	354	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD	10	226	822	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	100	597	2,173	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	40	134	489	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	20	430	1,565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	170	216	788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	528	1,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	250	1,275	4,641	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD	30	287	1,047	各種金融
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	114	205	749	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	40	160	582	自動車・自動車部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	10	61	223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	40	41	149	運輸
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	370	371	1,353	銀行
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	53	159	578	保険
CHINA STEEL CORP	370	906	3,299	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	130	1,384	5,039	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS	80	141	515	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	550	1,174	4,274	銀行
DELTA ELECTRONICS INC	70	892	3,248	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	311	659	2,399	銀行
EVA AIRWAYS CORP	31	46	169	運輸
EVERGREEN MARINE	31	36	134	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	60	176	643	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	40	295	1,075	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10	192	698	耐久消費財・アパレル
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	272	557	2,029	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	100	1,080	3,931	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	30	345	1,255	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	140	1,428	5,197	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	10	34	123	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20	125	455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	200	1,030	3,749	各種金融
GIANT MANUFACTURING	10	147	536	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	10	296	1,077	半導体・半導体製造装置
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	20	92	338	不動産
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10	228	829	資本財
HON HAI PRECISION INDUSTRY	352	2,583	9,404	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10	231	840	小売
HTC CORP	10	41	152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	217	386	1,407	銀行
INNOLUX CORPORATION	180	184	671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	40	90	328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	40	154	563	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MACRONIX INTERNATIONAL	30	57	211	半導体・半導体製造装置
MEDIATEK INC	50	1,117	4,067	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	320	848	3,086	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10	65	238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PLASTICS CORP	150	1,182	4,302	素材
NANYA TECHNOLOGY CORP	20	115	418	半導体・半導体製造装置
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	20	258	939	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	40	210	764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	40	133	485	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10	70	258	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	640	2,329	食品・生活必需品小売り
QUANTA COMPUTER INC	70	347	1,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10	126	460	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	12	56	206	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	6	50	183	耐久消費財・アパレル
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	172	177	646	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	244	264	962	銀行
STANDARD FOODS CORP	10	48	177	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	20	67	245	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	279	389	1,418	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
TAIWAN BUSINESS BANK	83	89	325	銀行
TAIWAN CEMENT	118	430	1,567	素材
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	245	441	1,605	銀行
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	30	98	358	運輸
TAIWAN MOBILE CO LTD	40	438	1,594	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	750	16,650	60,606	半導体・半導体製造装置
TECO ELECTRIC & MACHINERY	30	51	185	資本財
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	150	1,143	4,160	食品・飲料・タバコ
UNITED MICROELECTRONICS CORP	310	344	1,252	半導体・半導体製造装置
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	20	120	437	半導体・半導体製造装置
WALSIN TECHNOLOGY CORP	10	166	606	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIN SEMICONDUCTORS CORP	10	102	371	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	50	69	253	半導体・半導体製造装置
WISTRON CORP	51	101	369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	27	102	374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION	10	317	1,155	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	220	347	1,265	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10	78	284	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>	8,374 82	47,054 -	171,278 <10.4%>
(トルコ)		千トルコ・リラ		
AKBANK T.A.S.	46	34	736	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	4	8	176	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS	4	6	141	耐久消費財・アパレル
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3	10	217	資本財
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4	36	769	食品・生活必需品小売り
COCA-COLA ICECEK AS	1	4	90	食品・飲料・タバコ
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	28	25	536	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1	8	179	自動車・自動車部品
HACI OMER SABANCI HOLDING	18	14	298	各種金融
KOC HOLDING AS	15	22	484	資本財
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	13	7	150	素材
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	2	7	162	運輸
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	2	4	97	自動車・自動車部品
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2	31	673	エネルギー
TURK HAVA YOLLARI AO	9	16	345	運輸
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	13	6	147	資本財
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	22	27	585	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI	48	39	834	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE HALK BANKASI	11	8	177	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	30	12	262	銀行
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	14	5	109	銀行
ULKER BISKUVI SANAYI AS	3	4	99	食品・飲料・タバコ
YAPI VE KREDI BANKASI	16	2	58	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	320 23	345 -	7,335 <0.4%>
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		
ALFA S.A.B.-A	63	134	747	資本財
ALSEA SAB DE CV	11	52	289	消費者サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,023	1,390	7,702	電気通信サービス
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10	105	582	食品・飲料・タバコ
BANCO SANTANDER MEXICO-B	35	90	503	銀行
CEMEX SAB-CPO	417	422	2,342	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	11	135	752	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	3	39	218	小売
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	60	1,044	5,787	食品・飲料・タバコ
GRUMA S.A.B.-B	4	97	540	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	4	127	706	運輸
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	9	130	720	運輸
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	35	135	752	食品・飲料・タバコ
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	9	57	320	資本財
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	81	795	4,408	銀行
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	49	132	735	銀行
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	107	471	2,609	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	69	416	2,304	メディア
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3	96	532	素材
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	11	82	456	公益事業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	29	86	480	家庭用品・パーソナル用品
MEXICHEM SAB DE CV.*	20	102	568	素材
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4	79	440	運輸
WALMART DE MEXICO-SER V	149	741	4,108	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,217 24	6,969 -	38,613 <2.4%>
(フィリピン)		千フィリピン・ペソ		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	36	171	367	資本財
ABOITIZ POWER CORP	28	91	194	公益事業
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	75	80	172	資本財
AYALA CORPORATION	5	505	1,082	各種金融

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(フィリピン)	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	197	786	1,682	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	15	141	301	銀行
BDO UNIBANK INC	53	695	1,487	銀行
DMCI HOLDINGS INC	71	93	199	資本財
GLOBE TELECOM INC	0.65	129	278	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	1	151	323	各種金融
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9	90	193	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	59	280	599	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP	8	225	482	消費者サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY	4	168	361	公益事業
MEGAWORLD CORP	229	105	226	不動産
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	281	130	279	各種金融
METROPOLITAN BANK & TRUST	12	92	197	銀行
PLDT INC	1	203	436	電気通信サービス
ROBINSONS LAND CO	34	71	152	不動産
SECURITY BANK CORP	4	65	141	銀行
SM INVESTMENTS CORP	4	459	983	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC	273	898	1,922	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	17	225	482	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,424 23	5,864 -	12,549 <0.8%>
(チリ)		千チリ・ペソ		
AGUAS ANDINAS SA-A	46	1,796	302	公益事業
BANCO DE CHILE	689	6,797	1,145	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	0.79	3,473	585	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	0.06	14	2	銀行
BANCO SANTANDER CHILE	1,780	9,345	1,574	銀行
CENCOSUD SA	27	3,729	628	食品・生活必需品小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	2	2,301	387	食品・飲料・タバコ
COLBUN SA	137	1,901	320	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	4	1,137	191	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2	1,482	249	電気通信サービス
EMPRESAS CMPC SA	24	6,121	1,031	素材
EMPRESAS COPEC SA	9	9,060	1,526	エネルギー
ENEL CHILE SA	604	3,823	644	公益事業
ENERSIS SA	588	6,552	1,104	公益事業
ITAU CORPBANCA	2,575	1,639	276	銀行
LATAM AIRLINES GROUP SA	6	3,922	660	運輸
S.A.C.I. FALABELLA	18	9,709	1,636	小売

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(チリ)		百株	千チリ・ペソ	千円	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		3	9,258	1,560	素材
小計	株数・金額	6,522	82,068	13,828	
	銘柄数<比率>	18	—	<0.8%>	
(コロンビア)			千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		4	16,673	591	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		12	40,280	1,429	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		8	6,218	220	素材
ECOPETROL SA		126	40,477	1,436	エネルギー
GRUPO ARGOS SA		5	8,694	308	素材
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		76	9,018	320	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		5	17,193	610	各種金融
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		2	7,518	266	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA		8	10,679	379	公益事業
小計	株数・金額	250	156,754	5,564	
	銘柄数<比率>	9	—	<0.3%>	
(インド)			千インド・ルピー		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		15	530	842	運輸
AMBUJA CEMENTS LTD		11	251	399	素材
ASHOK LEYLAND LTD		22	244	388	資本財
ASIAN PAINTS LTD		7	1,005	1,598	素材
AUROBINDO PHARMA LTD		5	416	662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD		2	388	617	食品・生活必需品小売り
AXIS BANK LTD		54	3,386	5,384	銀行
BAJAJ AUTO LTD		1	485	771	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD		4	1,097	1,745	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD		0.80	458	728	保険
BHARAT FORGE LTD		4	255	405	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTROCALCS		17	119	189	資本財
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		15	504	802	エネルギー
BHARTI AIRTEL LTD		36	1,240	1,972	電気通信サービス
BHARTI INFRATEL LTD		7	190	302	電気通信サービス
BOSCH LTD		0.15	280	446	自動車・自動車部品
BRITANNIA INDUSTRIES LTD		0.56	335	533	食品・飲料・タバコ
CADILA HEALTHCARE LTD		4	151	240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIPLA LIMITED		7	391	623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD		14	371	590	エネルギー
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		1	105	167	運輸
DABUR INDIA LTD		10	412	656	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2	616	980	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	871	1,385	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	21	713	1,134	公益事業
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2	186	296	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	542	862	家庭用品・パーソナル用品
GRASIM INDUSTRIES LTD	8	733	1,166	素材
HAVELLS INDIA LTD	4	332	528	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	13	1,438	2,287	ソフトウェア・サービス
HERO MOTOCORP LTD	1	298	473	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	23	558	887	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	12	306	486	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	19	3,387	5,386	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	48	9,166	14,574	銀行
ICICI BANK LTD	67	2,457	3,907	銀行
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	6	488	777	銀行
INDIAN OIL CORPORATION LTD	36	527	838	エネルギー
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	104	6,817	10,839	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	2	211	336	運輸
ITC LTD	104	2,981	4,741	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	17	585	930	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	13	1,911	3,039	資本財
LIC HOUSING FINANCE LTD	5	269	428	銀行
LUPIN LTD	4	408	648	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	242	386	各種金融
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21	1,679	2,669	自動車・自動車部品
MARICO LTD	8	305	486	家庭用品・パーソナル用品
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3	2,445	3,888	自動車・自動車部品
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	20	312	496	自動車・自動車部品
NESTLE INDIA LTD	0.62	641	1,019	食品・飲料・タバコ
NTPC LTD	52	807	1,284	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26	413	657	エネルギー
PAGE INDUSTRIES LTD	0.14	371	590	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	8	183	291	エネルギー
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2	307	489	素材
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1	387	615	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	668	1,062	公益事業
REC LTD	13	170	270	各種金融
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	86	9,948	15,818	エネルギー
SHREE CEMENT LTD	0.16	254	404	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3	384	611	各種金融
SIEMENS LTD	1	134	214	資本財
STATE BANK OF INDIA	47	1,381	2,196	銀行
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	27	1,466	2,331	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	5,374	8,545	ソフトウェア・サービス
TATA MOTORS LTD	42	782	1,244	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	21	165	263	公益事業
TATA STEEL LTD	6	361	574	素材
TECH MAHINDRA LTD	12	923	1,468	ソフトウェア・サービス
TITAN CO LTD	6	591	941	耐久消費財・アパレル
ULTRATECH CEMENT LTD	2	1,036	1,647	素材
UNITED SPIRITS LTD	6	397	631	食品・飲料・タバコ
UPL LTD	7	576	917	素材
VEDANTA LTD	30	644	1,024	素材
VODAFONE IDEA LTD	28	120	191	電気通信サービス
WIPRO LTD	25	854	1,359	ソフトウェア・サービス
YES BANK LTD	41	857	1,364	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	10	490	779	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,417 79	84,117 -	133,747 <8.1%>
(インドネシア)		千インドネシア・ルピア		
ADARO ENERGY TBK PT	271	40,243	313	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	584	496,400	3,871	自動車・自動車部品
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	307	770,570	6,010	銀行
BANK DANAMON INDONESIA TBK	67	49,915	389	銀行
BANK MANDIRI TBK	539	402,902	3,142	銀行
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	158	132,720	1,035	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA	1,599	562,848	4,390	銀行
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	83	19,754	154	銀行
BUMI SERPONG DAMAI PT	163	19,723	153	不動産
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	144	81,000	631	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	11	86,020	670	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	199	67,660	527	食品・飲料・タバコ
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	60	67,500	526	素材
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	38	74,575	581	素材
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	46	40,365	314	食品・飲料・タバコ
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	85	50,575	394	食品・飲料・タバコ
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	41	16,482	128	運輸
KALBE FARMA TBK PT	418	64,372	502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	47	21,103	164	小売
PAKUWON JATI TBK PT	453	27,633	215	不動産
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	215	43,645	340	公益事業
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	56	62,160	484	素材
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	111	20,313	158	メディア
TELEKOMUNIKASI TBK PT	1,438	568,010	4,430	電気通信サービス
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	40	16,160	126	電気通信サービス
UNILEVER INDONESIA TBK PT	32	132,160	1,030	家庭用品・パーソナル用品
UNITED TRACTORS TBK PT	35	120,400	939	エネルギー
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	88	14,344	111	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,328 28	4,069,553 -	31,742 <1.9%>
(ブラジル)		千ブラジル・レアル		
AMBEV SA	144	237	7,096	食品・飲料・タバコ
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8	13	393	食品・生活必需品小売り
BANCO BRADESCO S.A.	28	94	2,844	銀行
BANCO BRADESCO SA-PREF	103	383	11,473	銀行
BANCO DO BRASIL SA	24	105	3,168	銀行
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	10	42	1,280	銀行
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	15	39	1,196	保険
BM&FBOVESPA SA	60	157	4,717	各種金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	18	22	660	不動産
BRASKEM SA-PREF A	3	16	481	素材
BRF SA	10	20	603	食品・飲料・タバコ
CCR SA	26	27	830	運輸
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR	4	9	293	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4	11	332	公益事業
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	3	24	724	食品・生活必需品小売り
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	17	19	592	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6	16	498	公益事業
CIELO SA	27	25	748	ソフトウェア・サービス
COSAN SA	3	10	302	エネルギー
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	6	8	247	公益事業
EMBRAER SA	14	28	846	資本財
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	3	12	376	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	4	28	850	公益事業
FIBRIA CELULOSE SA	7	49	1,488	素材
GERDAU SA-PREF	22	35	1,063	素材
HYPERA S.A	6	17	534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)		百株	千ブラジル・リアル	千円	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	3	21	654	保険
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	99	521	15,626	銀行
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	137	165	4,961	銀行
	JBS SA	16	17	519	食品・飲料・タバコ
	KLABIN SA - UNIT	19	33	989	素材
	KROTON EDUCACIONAL SA	29	31	940	消費者サービス
	LOCALIZA RENT A CAR	11	31	934	運輸
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	15	26	798	小売
	LOJAS RENNER S.A.	22	87	2,609	小売
	M DIAS BRANCO SA	2	8	261	食品・飲料・タバコ
	MAGAZINE LUIZA SA	2	31	935	小売
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	6	13	405	不動産
	NATURA COSMETICOS SA	3	11	335	家庭用品・パーソナル用品
	ODONTOPREV S.A.	5	7	211	ヘルスケア機器・サービス
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	85	238	7,133	エネルギー
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	120	312	9,341	エネルギー
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8	18	561	小売
	PORTO SEGURO SA	2	10	315	保険
	RAIA DROGASIL SA	6	38	1,140	食品・生活必需品小売り
	RUMO SA	24	41	1,249	運輸
	SUL AMERICA SA - UNITS	4	9	297	保険
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	12	44	1,343	素材
	TELEF BRASIL	10	45	1,347	電気通信サービス
	TIM PARTICIPACOES SA	18	21	629	電気通信サービス
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	9	39	1,174	エネルギー
	VALE SA	96	535	16,025	素材
	WEG SA	22	41	1,231	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,362 53	3,861 -	115,624 <7.0%>	
(チェコ)			千チェコ・コルナ		
	CEZ AS	3	216	1,073	公益事業
	KOMERCNI BANKA AS	1	170	845	銀行
	MONETA MONEY BANK AS	11	88	441	銀行
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	1	38	189	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18 4	514 -	2,549 <0.2%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
	AMOREPACIFIC CORP	0.79	12,482	1,248	家庭用品・パーソナル用品
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	0.17	1,526	152	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	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	千韓国ウォン	千円	
AMOREPACIFIC GROUP	0.60	3,684	368	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD/NEW	0.15	2,662	266	食品・生活必需品小売り
BNK FINANCIAL GROUP INC	5	3,961	396	銀行
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	0.73	5,657	565	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION INC	2	56,563	5,656	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	2,366	236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC	1	3,049	304	メディア
CJ CHEILJEDANG CORP	0.15	5,287	528	食品・飲料・タバコ
CJ CORP	0.28	3,626	362	資本財
CJ ENM CO LTD	0.28	6,146	614	小売
CJ LOGISTICS	0.16	2,392	239	運輸
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	0.53	4,669	466	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	2	1,170	117	資本財
DAUM COMMUNICATIONS CORP	1	14,231	1,423	ソフトウェア・サービス
DB INSURANCE CO LTD	1	7,570	757	保険
DGB FINANCIAL GROUP INC	3	2,907	290	銀行
DONGSUH COMPANIES INC	0.66	1,135	113	食品・生活必需品小売り
DOOSAN BOBCAT INC	0.69	2,539	253	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1	1,086	108	資本財
E-MART CO LTD	0.43	8,363	836	食品・生活必需品小売り
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	0.96	4,094	409	資本財
GS HOLDINGS CORP	1	5,407	540	エネルギー
GS RETAIL CO LTD	0.52	1,898	189	食品・生活必需品小売り
HANA FINANCIAL GROUP	8	32,736	3,273	銀行
HANKOOK TIRE CO LTD	1	6,841	684	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD	0.13	5,824	582	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	1,812	181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	3	3,953	395	自動車・自動車部品
HANSSEM CO LTD	0.20	1,168	116	耐久消費財・アパレル
HANWHA CHEMICAL CORP	2	3,944	394	素材
HANWHA CORPORATION	0.83	2,506	250	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	5	2,367	236	保険
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	0.67	2,753	275	資本財
HLB INC	0.69	5,940	594	耐久消費財・アパレル
HOTEL SHILLA CO LTD	0.61	5,209	520	小売
HYUNDAI DEPT STORE CO	0.26	2,392	239	小売
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2	11,178	1,117	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	0.35	4,165	416	運輸
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1	13,584	1,358	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	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	千韓国ウォン	千円	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	0.21	7,896	789	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1	5,252	525	保険
HYUNDAI MOBIS	1	37,436	3,743	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	4	48,111	4,811	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	0.78	5,350	535	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	0.45	2,844	284	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	1	7,276	727	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5	7,911	791	銀行
KANGWON LAND INC	2	7,290	729	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	12	56,889	5,688	銀行
KCC CORP	0.11	3,080	308	資本財
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	0.44	1,287	128	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORPORATION	6	19,483	1,948	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1	4,759	475	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	6	17,312	1,731	公益事業
KOREA GAS CORPORATION	0.54	2,710	271	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	0.83	5,702	570	各種金融
KOREA ZINC CO LTD	0.17	7,420	742	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	0.87	2,836	283	運輸
KT&G CORP	3	33,400	3,340	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	0.35	3,143	314	素材
LG CHEM LTD	1	45,606	4,560	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.15	2,947	294	素材
LG CORP	2	18,200	1,820	資本財
LG DISPLAY CO LTD	4	8,518	851	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	2	18,687	1,868	耐久消費財・アパレル
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	0.29	34,046	3,404	家庭用品・パーソナル用品
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.04	2,776	277	家庭用品・パーソナル用品
LG INNOTEK CO LTD	0.28	2,828	282	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	2	3,876	387	各種金融
LG UPLUS CORP	5	8,760	876	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	0.45	13,117	1,311	素材
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.57	3,152	315	資本財
LOTTE SHOPPING CO	0.22	4,994	499	小売
MEDY-TOX INC	0.08	4,457	445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	7	5,338	533	各種金融
NAVER CORP	4	47,610	4,761	ソフトウェア・サービス
NCSOFT CORPORATION	0.47	21,972	2,197	ソフトウェア・サービス
NETMARBLE CORPORATION	0.58	7,134	713	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	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	千韓国ウォン	千円	
OCI CO LTD	0.32	3,145	314	素材
ORANGE LIFE INSURANCE, LTD.	0.65	2,076	207	保険
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.43	4,300	430	食品・飲料・タバコ
OTTOGI CORPORATION	0.02	1,424	142	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP	0.13	2,434	243	ソフトウェア・サービス
POSCO	2	62,259	6,225	素材
POSCO DAEWOO CORP	0.69	1,362	136	資本財
S-1 CORPORATION	0.32	3,072	307	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	0.44	14,718	1,471	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	22,568	2,256	資本財
SAMSUNG CARD CO	0.58	1,928	192	各種金融
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1	16,030	1,603	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	146	638,905	63,890	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	26	93,353	9,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3	6,282	628	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	0.89	24,875	2,487	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	11	8,958	895	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1	17,070	1,707	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	1	34,710	3,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD	0.93	17,670	1,767	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1	3,942	394	各種金融
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13	55,756	5,575	銀行
SHINSEGAE CO LTD	0.14	4,060	406	小売
SILLAJEN INC	1	8,413	841	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	21,840	2,184	資本財
SK HYNIX INC	17	123,615	12,361	半導体・半導体製造装置
SK INNOVATION CO LTD	1	37,555	3,755	エネルギー
SK TELECOM CO LTD	0.42	11,592	1,159	電気通信サービス
S-OIL CORPORATION	0.94	10,481	1,048	エネルギー
STX PAN OCEAN CO LTD	4	1,866	186	運輸
VIROMED CO LTD	0.30	6,051	605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WOONGJIN COWAY CO LTD	1	8,109	810	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	12	19,923	1,992	銀行
YUHAN CORP	0.16	4,072	407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	399 114	2,106,694 -	210,669 <12.8%>
(中国)		千人民元		
CHINA MERCHANTS BANK-A	8	23	376	銀行
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1	56	924	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		当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)		百株	千人民元	千円	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A		4	26	426	保険
小計	株数・金額	13	106	1,727	
	銘柄数<比率>	3	—	<0.1%>	
(マレーシア)		千マレーシア・リンギット			
AIRASIA GROUP BERHAD		25	7	209	運輸
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD		20	7	209	銀行
AMBANK HOLDINGS BHD		32	13	357	銀行
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD		28	3	91	メディア
AXIATA GROUP BERHAD		57	20	538	電気通信サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD		3	11	308	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		126	72	1,942	銀行
DIALOG GROUP BHD		99	31	860	エネルギー
DIGI.COM BHD		65	28	755	電気通信サービス
FGV HOLDINGS BHD		29	3	94	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD		3	10	269	食品・飲料・タバコ
GAMUDA BHD		31	7	206	資本財
GENTING BHD		45	31	841	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD		59	21	572	消費者サービス
GENTING PLANTATIONS BHD		5	4	131	食品・飲料・タバコ
HAP SENG CONSOLIDATED		11	10	292	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD		26	16	433	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG BANK BERHAD		13	26	723	銀行
HONG LEONG FINANCIAL GROUP		4	7	211	銀行
IHH HEALTHCARE BHD		63	30	815	ヘルスケア機器・サービス
IJM CORP BHD		52	8	241	資本財
IOI CORPORATION BHD		44	19	512	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD		35	5	159	不動産
KUALA LUMPUR KEPONG BHD		11	27	736	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD		122	115	3,117	銀行
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD		16	12	343	運輸
MAXIS BHD		62	33	902	電気通信サービス
MISC BHD		24	15	426	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD		1	14	397	食品・飲料・タバコ
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		62	57	1,552	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD		4	10	292	エネルギー
PETRONAS GAS BHD		15	28	758	公益事業
PPB GROUP BERHAD		10	18	495	食品・飲料・タバコ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN		24	12	322	素材
PUBLIC BANK BHD		91	227	6,119	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
RHB BANK BHD	16	8	223	銀行
SIME DARBY BERHAD	48	11	311	資本財
SIME DARBY PLANTATION BHD	52	27	739	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD	48	4	128	不動産
SP SETIA BHD	23	4	132	不動産
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	4	133	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	97	144	3,877	公益事業
TOP GLOVE CORP BHD	30	17	466	ヘルスケア機器・サービス
UMW HOLDINGS BHD	11	5	147	自動車・自動車部品
WESTPORTS HOLDINGS BHD	18	6	180	運輸
YTL CORPORATION BERHAD	83	9	255	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,766 46	1,220 -	32,842 <2.0%>
(南アフリカ)		千南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD	22	352	2,828	銀行
ANGLO PLATINUM LTD	1	68	545	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	9	131	1,057	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9	144	1,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD	8	248	1,995	食品・生活必需品小売り
BIDVEST GROUP LTD	8	174	1,398	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	0.86	94	760	銀行
CLICKS GROUP LTD	5	102	825	食品・生活必需品小売り
CORONATION FUND MANAGERS LTD	4	19	160	各種金融
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	7	123	988	保険
EXXARO RESOURCES LTD	4	73	588	エネルギー
FIRSTRAND LTD	103	714	5,727	各種金融
GOLD FIELDS LTD	19	82	658	素材
IMPERIAL HOLDINGS LTD	3	43	350	小売
INVESTEC LTD	5	47	381	各種金融
KUMBA IRON ORE LTD	1	36	293	素材
LIBERTY HOLDINGS LTD	2	25	201	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	24	60	486	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD	17	32	261	保険
MONDI LTD	2	76	616	素材
MR PRICE GROUP LTD	6	157	1,262	小売
MTN GROUP LTD	48	410	3,294	電気通信サービス
NASPERS LTD-N SHS	13	3,762	30,178	メディア
NEDBANK GROUP LTD	10	272	2,188	銀行
NEPI ROCKCASTLE PLC	7	92	745	不動産

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS	18	47	378	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL LTD	151	352	2,825	保険
PICK N PAY STORES LTD	6	46	372	食品・生活必需品小売り
PIONEER FOODS GROUP LTD	2	19	153	食品・飲料・タバコ
PSG GROUP LTD	4	95	764	各種金融
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	12	47	379	保険
REINET INVESTMENTS SCA	3	68	550	各種金融
REMGRO LTD	13	263	2,116	各種金融
RMB HOLDINGS LTD	14	118	948	各種金融
SANLAM LIMITED	52	417	3,344	保険
SAPPI LIMITED	11	92	743	素材
SASOL LTD	16	743	5,965	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	11	221	1,778	食品・生活必需品小売り
SPAR GROUP LIMITED/THE	3	63	508	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	39	679	5,451	銀行
TELKOM SA SOC LTD	4	25	207	電気通信サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	4	74	596	小売
TIGER BRANDS LTD	3	93	753	食品・飲料・タバコ
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	8	74	598	小売
VODACOM GROUP LTD	15	194	1,561	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	20	108	869	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	769 46	11,199 -	89,822 <5.5%>
(タイ)		千タイ・バーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	28	505	1,723	電気通信サービス
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	125	815	2,781	運輸
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	5	103	351	銀行
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	74	185	630	ヘルスケア機器・サービス
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	144	124	424	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	38	66	226	エネルギー
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	24	122	417	資本財
BTS GROUP HOLDINGS PCL	111	104	355	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	6	113	385	ヘルスケア機器・サービス
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	30	222	759	不動産
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	58	145	494	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-FOREIGN	142	986	3,365	食品・生活必需品小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	10	69	235	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	2	47	160	公益事業
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	22	107	367	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	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	千タイ・バーツ	千円	
GLOW ENERGY PCL - FOREIGN	10	87	298	公益事業
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	74	111	378	食品・生活必需品小売り
INDORAMA VENTURES-FOREIGN	30	163	557	素材
IRPC PCL - FOREIGN	184	105	360	エネルギー
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	54	1,061	3,618	銀行
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	67	132	452	銀行
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	87	88	302	不動産
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	41	143	489	消費者サービス
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	37	490	1,671	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	59	458	1,564	素材
PTT PCL/FOREIGN	320	1,560	5,319	エネルギー
ROBINSON PCL-FOREIGN	10	67	230	食品・生活必需品小売り
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	9	396	1,350	素材
SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	52	709	2,420	銀行
THAI OIL PCL-FRGN	24	183	624	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-F	37	68	232	食品・飲料・タバコ
TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	271	62	214	銀行
TRUE CORP PCL-FOREIGN	202	118	402	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,387 33	9,726 -	33,168 <2.0%>
(ポーランド)		千ポーランド・ズロチ		
ALIOR BANK SA	1	9	286	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	0.75	5	157	銀行
BANK MILLENNIUM SA	12	11	346	銀行
BANK PEKAO SA	4	48	1,441	銀行
CCC SA	0.57	10	302	耐久消費財・アパレル
CD PROJEKT SA	1	18	554	ソフトウェア・サービス
CYFROWY POLSAT SA	4	9	277	メディア
DINO POLSKA SA	0.96	8	243	食品・生活必需品小売り
GRUPA AZOTY SA	0.89	2	69	素材
GRUPA LOTOS SA	1	13	396	エネルギー
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1	7	233	素材
KGHM POLSKA MIEDZ SA	2	26	790	素材
LPP SA	0.02	15	452	耐久消費財・アパレル
MBANK SA	0.30	11	352	銀行
ORANGE POLSKA SA	13	6	179	電気通信サービス
PGE SA	17	21	646	公益事業
PKO BANK POLSKI SA	27	106	3,166	銀行
PLAY COMMUNICATIONS SA	2	3	116	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		当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	8	87	2,592	エネルギー
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	36	22	678	エネルギー
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16	64	1,909	保険
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	0.76	26	796	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	156 22	536 -	15,992 <1.0%>	
(ハンガリー)			千ハンガリー・フォリント		
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	6	1,928	774	エネルギー
	OTP BANK RT	6	7,614	3,057	銀行
	RICHTER GEDEON NYRT	2	1,491	598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15 3	11,034 -	4,430 <0.3%>	
(ギリシャ)			千ユーロ		
	FF GROUP	1	0.619	79	小売
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	7	8	1,043	電気通信サービス
	JUMBO SA	3	4	533	小売
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2	5	652	エネルギー
	OPAP SA	6	5	696	消費者サービス
	TITAN CEMENT CO. S.A.	1	3	446	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23 6	26 -	3,452 <0.2%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	58,480 834	- -	1,453,862 <88.6%>	

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

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

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

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

ニッセイ新興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	口数	当期末		
		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
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	7		108	12,191
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	9		172	19,463
小計	口数・金額	16	280	31,654
	銘柄数<比率>	2	—	<1.9%>
(トルコ)			千トルコ・リラ	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	3		6	137
小計	口数・金額	3	6	137
	銘柄数<比率>	1	—	<0.0%>
(メキシコ)			千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	8		194	1,079
小計	口数・金額	8	194	1,079
	銘柄数<比率>	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)			千南アフリカ・ランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	6		158	1,267
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	0.485		43	346
RESILIENT REIT LTD	0.631		39	318
REDEFINE PROPERTIES LTD	14		143	1,153
FORTRESS REIT LTD-A	1		33	265
FORTRESS REIT LTD-B	1		28	227
小計	口数・金額	25	446	3,579
	銘柄数<比率>	6	—	<0.2%>
合計	口数・金額	55	—	36,451
	銘柄数<比率>	10	—	<2.2%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 MINI MSCI EM INDEX FUTURES	百万円 144	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

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,453,862	87.5
投資信託証券	36,451	2.2
コール・ローン等、その他	171,521	10.3
投資信託財産総額	1,661,836	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円、1香港ドル14.38円、1台湾ドル3.64円、1トルコ・リラ21.20円、1メキシコ・ペソ5.54円、1フィリピン・ペソ2.14円、100チリ・ペソ16.85円、100コロンビア・ペソ3.55円、1インド・ルピー1.59円、100インドネシア・ルピア0.78円、1ブラジル・レアル29.94円、1チェコ・コルナ4.96円、100韓国ウォン10.00円、1人民元16.24円、1マレーシア・リングギット26.90円、1南アフリカ・ランド8.02円、1タイ・バーツ3.41円、1ポーランド・ズロチ29.79円、100ハンガリー・フォリント40.15円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（1,564,539千円）の投資信託財産総額（1,661,836千円）に対する比率は94.1%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	1,758,074,792円
コール・ローン等	123,859,044
株式(評価額)	1,453,862,370
投資信託証券(評価額)	36,451,892
未収入金	100,800,308
未収配当金	964,063
差入委託証拠金	42,137,115
(B)負債	116,502,418
未払金	99,920,768
未払解約金	16,580,249
その他未払費用	1,401
(C)純資産総額(A-B)	1,641,572,374
元本	1,844,866,571
次期繰越損益金	△ 203,294,197
(D)受益権総口数	1,844,866,571口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,898円

(注1) 設定元本額 1,000,000,000円
 期中追加設定元本額 1,154,053,608円
 期中一部解約元本額 309,187,037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) 995,014,308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 781,520,587円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 46,427,320円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 3,257,038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) 1,176,052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) 17,471,266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203,294,197円です。

損益の状況

当期 (2017年8月7日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	30,460,650円
受取配当金	30,442,602
受取利息	212,469
その他収益金	766
支払利息	△ 195,187
(B)有価証券売買損益	△ 167,482,369
売買益	90,045,970
売買損	△ 257,528,339
(C)先物取引等損益	△ 19,362,760
取引益	18,468,952
取引損	△ 37,831,712
(D)信託報酬等	△ 19,994,699
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△ 176,379,178
(F)追加信託差損益金	△ 36,177,170
(G)解約差損益金	9,262,151
(H)合計(E+F+G)	△ 203,294,197
次期繰越損益金(H)	△ 203,294,197

(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) (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 2 期

(計算期間：2017年3月11日～2018年3月12日)

運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA – B P I 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ませ



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年3月11日～2018年3月12日

国内債券市況

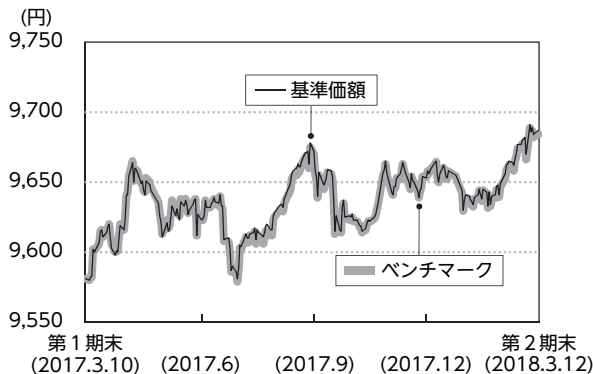


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は、日銀の金融緩和政策を背景に、期初以降、低下基調となりましたが、その後6月末にかけては、欧州を中心に金融緩和縮小観測が高まり、海外金利が上昇したことで国内金利にも上昇圧力がかかり、大きく上昇する場面が見られました。

7月前半には、日銀による指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れる公開市場操作）の実施や定例の中長期債の買い入れ額の増額など、金利上昇を抑制するスタンスを明確にしたことなどから、金利は低下基調に転じ、8月には北朝鮮情勢の緊迫化を受けて、さらに低下する展開となりました。9月に入ると、北朝鮮情勢への警戒感が後退したことや、好調な米経済指標を背景に米国において利上げ継続の可能性が高まったことから金利は再び上昇に転じました。その後、米税制改革への思惑などから金利は上下しましたが、2月には世界的な同時株安を受けた投資家のリスク回避姿勢などから低下し、結局、10年国債金利は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



基準価額は上下しましたが、2月には世界的な同時株安を受けた投資家のリスク回避姿勢などから金利が低下したことで基準価額は上昇し、結局、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。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、日銀の金融緩和政策を背景とした金利の低下（債券価格は上昇）を受けておおむね上昇しましたが、6月末にかけて、海外金利の上昇を背景に国内金利も上昇したことから基準価額は下落基調で推移しました。その後は、日銀の金利上昇を抑制するスタンスや北朝鮮情勢の緊迫化を受けて、金利が低下したことにより基準価額は上昇基調となりました。9月に入ると、北朝鮮情勢への警戒感が後退したことや米国における利上げ継続の見通しが高まったことから、金利が再び上昇し基準価額は下落しました。その後、米税制改革への思惑などから基

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+1.1%となり、ベンチマーク騰落率（+1.1%）に連動しました。

■ 今後の運用方針

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

■ お知らせ

■ 約款変更

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

(2017年9月20日)

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

(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)2017年3月10日	9,581	—	9,585	—	99.0
3月末	9,603	0.2	9,610	0.3	99.2
4月末	9,651	0.7	9,657	0.8	99.2
5月末	9,634	0.6	9,637	0.5	99.1
6月末	9,609	0.3	9,612	0.3	99.3
7月末	9,612	0.3	9,611	0.3	98.6
8月末	9,661	0.8	9,663	0.8	99.1
9月末	9,626	0.5	9,629	0.5	99.2
10月末	9,627	0.5	9,630	0.5	99.2
11月末	9,651	0.7	9,655	0.7	99.1
12月末	9,658	0.8	9,661	0.8	99.2
2018年1月末	9,643	0.6	9,644	0.6	99.1
2月末	9,681	1.0	9,681	1.0	99.1
(期末)2018年3月12日	9,687	1.1	9,688	1.1	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2017年3月11日～2018年3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)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	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（9,638円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年3月11日～2018年3月12日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	28,768,808	50,851,222
	地方債証券	234,461	2,288,732
	特殊債券	116,355	4,096,028
	社債券	—	(293,410)
			2,543,598

(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

2017年3月11日～2018年3月12日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第346回 利付国債 (10年)	1,638,544	第341回 利付国債 (10年)	1,658,765
第347回 利付国債 (10年)	1,428,772	第342回 利付国債 (10年)	1,441,697
第341回 利付国債 (10年)	1,333,394	第116回 利付国債 (5年)	1,264,189
第342回 利付国債 (10年)	1,170,440	第117回 利付国債 (5年)	1,208,899
第349回 利付国債 (10年)	1,077,717	第296回 利付国債 (10年)	1,174,647
第377回 利付国債 (2年)	1,004,280	第340回 利付国債 (10年)	1,149,388
第343回 利付国債 (10年)	848,205	第343回 利付国債 (10年)	1,105,800
第340回 利付国債 (10年)	810,686	第115回 利付国債 (5年)	1,061,580
第131回 利付国債 (5年)	789,102	第113回 利付国債 (5年)	952,626
第379回 利付国債 (2年)	753,930	第335回 利付国債 (10年)	854,636

(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

2018年3月12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	81,351,000	90,527,405	71.7	—	54.0	12.4	5.3
地方債証券	11,781,000 (11,781,000)	12,222,855 (12,222,855)	9.7 (9.7)	—	3.9 (3.9)	4.1 (4.1)	1.7 (1.7)
特殊債券 (除く金融債券)	12,176,966 (12,176,966)	12,641,311 (12,641,311)	10.0 (10.0)	—	5.3 (5.3)	2.8 (2.8)	1.8 (1.8)
金融債券	900,000 (900,000)	904,034 (904,034)	0.7 (0.7)	—	—	0.5 (0.5)	0.2 (0.2)
社債券	8,600,000 (8,600,000)	8,910,744 (8,910,744)	7.1 (7.1)	—	1.7 (1.7)	3.8 (3.8)	1.5 (1.5)
合計	114,808,966 (33,457,966)	125,206,350 (34,678,945)	99.1 (27.5)	—	65.0 (11.0)	23.6 (11.2)	10.6 (5.3)

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

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375回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/4/15	14,000	14,039
	第376回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/5/15	14,000	14,042
	第377回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/6/15	332,000	333,082
	第378回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/7/15	375,000	376,305
	第379回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/8/15	371,000	372,372
	第380回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/9/15	306,000	307,199
	第381回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/10/15	750,000	753,105
	第382回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/11/15	299,000	300,303
	第383回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/12/15	279,000	280,275
	第384回 利付国債 (2年)	0.1000	2020/1/15	500,000	502,400
	第118回 利付国債 (5年)	0.2000	2019/6/20	463,000	465,055
	第119回 利付国債 (5年)	0.1000	2019/6/20	44,000	44,139
	第120回 利付国債 (5年)	0.2000	2019/9/20	473,000	475,521
	第121回 利付国債 (5年)	0.1000	2019/9/20	85,000	85,323
	第122回 利付国債 (5年)	0.1000	2019/12/20	843,000	846,658
	第123回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/3/20	794,000	797,850
	第124回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/6/20	784,000	788,186
	第125回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/9/20	745,000	749,328
	第126回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/12/20	806,000	811,150
	第127回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/3/20	855,000	860,950
	第128回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/6/20	788,000	793,941
	第129回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/9/20	577,000	581,587
	第130回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/12/20	500,000	504,165
	第131回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/3/20	705,000	711,253
	第132回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/6/20	360,000	363,394
	第133回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/9/20	360,000	363,596
	第1回 利付国債 (40年)	2.4000	2048/3/20	144,000	207,292
	第2回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	187,000	260,137
	第3回 利付国債 (40年)	2.2000	2050/3/20	171,000	239,023
	第4回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	241,000	338,400
	第5回 利付国債 (40年)	2.0000	2052/3/20	234,000	315,841
	第6回 利付国債 (40年)	1.9000	2053/3/20	245,000	324,034
第7回 利付国債 (40年)	1.7000	2054/3/20	261,000	329,906	
第8回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	288,000	336,867	
第9回 利付国債 (40年)	0.4000	2056/3/20	382,000	323,317	
第10回 利付国債 (40年)	0.9000	2057/3/20	190,000	190,549	
第301回 利付国債 (10年)	1.5000	2019/6/20	324,000	330,813	
第302回 利付国債 (10年)	1.4000	2019/6/20	47,000	47,928	

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303回 利付国債 (10年)	1.4000	2019/ 9 /20	365,000	373,650
	第304回 利付国債 (10年)	1.3000	2019/ 9 /20	67,000	68,485
	第305回 利付国債 (10年)	1.3000	2019/12/20	693,000	710,830
	第306回 利付国債 (10年)	1.4000	2020/ 3 /20	393,000	405,277
	第307回 利付国債 (10年)	1.3000	2020/ 3 /20	57,000	58,665
	第308回 利付国債 (10年)	1.3000	2020/ 6 /20	161,000	166,293
	第309回 利付国債 (10年)	1.1000	2020/ 6 /20	385,000	395,907
	第310回 利付国債 (10年)	1.0000	2020/ 9 /20	434,000	446,512
	第311回 利付国債 (10年)	0.8000	2020/ 9 /20	175,000	179,159
	第312回 利付国債 (10年)	1.2000	2020/12/20	1,051,000	1,090,002
	第313回 利付国債 (10年)	1.3000	2021/ 3 /20	572,000	596,859
	第314回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 3 /20	220,000	228,228
	第315回 利付国債 (10年)	1.2000	2021/ 6 /20	538,000	561,575
	第316回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 6 /20	240,000	249,729
	第317回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/ 9 /20	188,000	196,178
	第318回 利付国債 (10年)	1.0000	2021/ 9 /20	482,000	501,260
	第319回 利付国債 (10年)	1.1000	2021/12/20	238,000	249,088
	第320回 利付国債 (10年)	1.0000	2021/12/20	491,000	512,014
	第321回 利付国債 (10年)	1.0000	2022/ 3 /20	505,000	527,826
	第322回 利付国債 (10年)	0.9000	2022/ 3 /20	174,000	181,161
	第323回 利付国債 (10年)	0.9000	2022/ 6 /20	167,000	174,269
	第324回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/ 6 /20	477,000	495,717
	第325回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/ 9 /20	444,000	462,354
	第326回 利付国債 (10年)	0.7000	2022/12/20	9,000	9,349
	第327回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/12/20	211,000	220,205
	第328回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/ 3 /20	166,000	171,901
	第329回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/ 6 /20	49,000	51,335
	第330回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/ 9 /20	16,000	16,794
	第331回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/ 9 /20	11,000	11,424
	第332回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/12/20	419,000	435,764
	第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 3 /20	608,000	632,988
	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 6 /20	664,000	692,226
	第335回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/ 9 /20	405,000	420,118
	第336回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/12/20	53,000	55,035
第337回 利付国債 (10年)	0.3000	2024/12/20	336,000	344,336	
第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 3 /20	1,001,000	1,033,442	
第339回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 6 /20	1,112,000	1,148,918	
第340回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 9 /20	1,057,000	1,092,494	
第341回 利付国債 (10年)	0.3000	2025/12/20	1,028,000	1,055,231	

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342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	1,133,000	1,144,828
	第343回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 6 /20	1,138,000	1,149,300
	第344回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 9 /20	1,113,000	1,123,439
	第345回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/12/20	1,052,000	1,061,215
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	1,058,000	1,067,056
	第347回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 6 /20	991,000	999,255
	第348回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 9 /20	690,000	695,575
	第349回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/12/20	1,072,000	1,079,825
	第 1 回 利付国債 (30年)	2.8000	2029/ 9 /20	33,000	43,147
	第 2 回 利付国債 (30年)	2.4000	2030/ 2 /20	44,000	55,808
	第 3 回 利付国債 (30年)	2.3000	2030/ 5 /20	48,000	60,492
	第 4 回 利付国債 (30年)	2.9000	2030/11/20	79,000	106,115
	第 5 回 利付国債 (30年)	2.2000	2031/ 5 /20	53,000	66,829
	第 6 回 利付国債 (30年)	2.4000	2031/11/20	81,000	104,810
	第 7 回 利付国債 (30年)	2.3000	2032/ 5 /20	85,000	109,392
	第 8 回 利付国債 (30年)	1.8000	2032/11/22	77,000	93,980
	第 9 回 利付国債 (30年)	1.4000	2032/12/20	69,000	80,302
	第10回 利付国債 (30年)	1.1000	2033/ 3 /20	118,000	132,134
	第11回 利付国債 (30年)	1.7000	2033/ 6 /20	86,000	104,033
	第12回 利付国債 (30年)	2.1000	2033/ 9 /20	89,000	113,176
	第13回 利付国債 (30年)	2.0000	2033/12/20	108,000	135,849
	第14回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/ 3 /20	144,000	190,212
	第15回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 6 /20	157,000	210,249
	第16回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 9 /20	133,000	178,493
	第17回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/12/20	134,000	178,076
	第18回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	161,000	211,589
	第19回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 6 /20	121,000	159,163
	第20回 利付国債 (30年)	2.5000	2035/ 9 /20	127,000	171,650
	第21回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/12/20	124,000	163,630
	第22回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 3 /20	151,000	204,632
	第23回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 6 /20	155,000	210,414
第24回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 9 /20	159,000	216,201	
第25回 利付国債 (30年)	2.3000	2036/12/20	172,000	228,059	
第26回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	372,000	500,384	
第27回 利付国債 (30年)	2.5000	2037/ 9 /20	323,000	441,421	
第28回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/ 3 /20	368,000	504,211	
第29回 利付国債 (30年)	2.4000	2038/ 9 /20	370,000	501,768	
第30回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	399,000	535,074	
第31回 利付国債 (30年)	2.2000	2039/ 9 /20	361,000	478,379	

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 32 回 利付国債 (30年)	2.3000	2040/ 3 /20	449,000	605,687
	第 33 回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	515,000	664,633
	第 34 回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	473,000	632,443
	第 35 回 利付国債 (30年)	2.0000	2041/ 9 /20	527,000	684,003
	第 36 回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/ 3 /20	509,000	662,758
	第 37 回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	550,000	705,853
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	354,000	447,371
	第 39 回 利付国債 (30年)	1.9000	2043/ 6 /20	319,000	410,894
	第 40 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 9 /20	285,000	360,690
	第 41 回 利付国債 (30年)	1.7000	2043/12/20	302,000	375,304
	第 42 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 3 /20	324,000	402,842
	第 43 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 6 /20	323,000	401,799
	第 44 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 9 /20	318,000	395,766
	第 45 回 利付国債 (30年)	1.5000	2044/12/20	315,000	376,910
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/ 3 /20	374,000	447,569
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/ 6 /20	405,000	494,691
	第 48 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/ 9 /20	355,000	416,180
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	350,000	410,301
	第 50 回 利付国債 (30年)	0.8000	2046/ 3 /20	341,000	347,762
	第 51 回 利付国債 (30年)	0.3000	2046/ 6 /20	339,000	302,008
	第 52 回 利付国債 (30年)	0.5000	2046/ 9 /20	359,000	337,513
	第 53 回 利付国債 (30年)	0.6000	2046/12/20	319,000	307,675
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	330,000	335,128
	第 55 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 6 /20	317,000	321,574
	第 56 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 9 /20	318,000	322,229
	第 57 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/12/20	328,000	331,988
	第 43 回 利付国債 (20年)	2.9000	2019/ 9 /20	12,000	12,557
	第 44 回 利付国債 (20年)	2.5000	2020/ 3 /20	5,000	5,267
	第 45 回 利付国債 (20年)	2.4000	2020/ 3 /20	11,000	11,567
	第 46 回 利付国債 (20年)	2.2000	2020/ 6 /22	10,000	10,536
	第 47 回 利付国債 (20年)	2.2000	2020/ 9 /21	13,000	13,771
	第 48 回 利付国債 (20年)	2.5000	2020/12/21	81,000	86,964
	第 49 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/ 3 /22	88,000	93,981
第 50 回 利付国債 (20年)	1.9000	2021/ 3 /22	66,000	70,085	
第 51 回 利付国債 (20年)	2.0000	2021/ 6 /21	13,000	13,914	
第 52 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/ 9 /21	10,000	10,791	
第 53 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/12/20	10,000	10,842	
第 54 回 利付国債 (20年)	2.2000	2021/12/20	1,000	1,088	
第 55 回 利付国債 (20年)	2.0000	2022/ 3 /21	8,000	8,686	

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 56 回 利付国債 (20年)	2.0000	2022/ 6 /20	13,000	14,182
	第 57 回 利付国債 (20年)	1.9000	2022/ 6 /20	11,000	11,953
	第 58 回 利付国債 (20年)	1.9000	2022/ 9 /20	3,000	3,275
	第 59 回 利付国債 (20年)	1.7000	2022/12/20	9,000	9,783
	第 60 回 利付国債 (20年)	1.4000	2022/12/20	9,000	9,653
	第 61 回 利付国債 (20年)	1.0000	2023/ 3 /20	9,000	9,501
	第 62 回 利付国債 (20年)	0.8000	2023/ 6 /20	9,000	9,428
	第 63 回 利付国債 (20年)	1.8000	2023/ 6 /20	6,000	6,603
	第 64 回 利付国債 (20年)	1.9000	2023/ 9 /20	11,000	12,217
	第 65 回 利付国債 (20年)	1.9000	2023/12/20	10,000	11,147
	第 66 回 利付国債 (20年)	1.8000	2023/12/20	11,000	12,198
	第 68 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/ 3 /20	11,000	12,512
	第 69 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/ 3 /20	9,000	10,183
	第 70 回 利付国債 (20年)	2.4000	2024/ 6 /20	180,000	207,991
	第 71 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/ 6 /20	90,000	102,862
	第 72 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/ 9 /20	265,000	302,569
	第 73 回 利付国債 (20年)	2.0000	2024/12/20	129,000	147,062
	第 74 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/12/20	96,000	110,094
	第 75 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 3 /20	96,000	110,610
	第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 3 /20	143,000	162,748
	第 77 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 3 /20	103,000	117,949
	第 78 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 6 /20	113,000	129,074
	第 79 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 6 /20	93,000	106,907
	第 80 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 6 /20	121,000	139,977
	第 81 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 9 /20	146,000	168,339
	第 82 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 9 /20	211,000	244,966
	第 83 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/12/20	225,000	262,323
	第 84 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/12/20	329,000	381,011
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	253,000	296,184
	第 86 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 3 /20	227,000	269,392
	第 87 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 3 /20	211,000	248,709
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	350,000	417,077
	第 89 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 6 /20	225,000	266,258
	第 90 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 9 /20	363,000	431,225
	第 91 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 9 /20	209,000	250,064
	第 92 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/12/20	468,000	553,943
	第 93 回 利付国債 (20年)	2.0000	2027/ 3 /20	230,000	271,229
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	348,000	413,517
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/ 6 /20	305,000	369,504

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 96 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 6 /20	174,000	207,576
	第 97 回 利付国債 (20年)	2.2000	2027/ 9 /20	236,000	284,887
	第 98 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 9 /20	172,000	205,995
	第 99 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/12/20	426,000	511,898
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	277,000	336,690
	第101回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 3 /20	174,000	214,966
	第102回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 6 /20	201,000	249,127
	第103回 利付国債 (20年)	2.3000	2028/ 6 /20	188,000	231,095
	第104回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 6 /20	158,000	190,991
	第105回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 9 /20	286,000	346,812
	第106回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 9 /20	174,000	212,815
	第107回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/12/20	192,000	233,537
	第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	317,000	378,805
	第109回 利付国債 (20年)	1.9000	2029/ 3 /20	209,000	250,400
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	260,000	317,179
	第111回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/ 6 /20	180,000	222,242
	第112回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 6 /20	297,000	363,391
	第113回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 9 /20	456,000	559,548
	第114回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/12/20	315,000	387,610
	第115回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/12/20	189,000	234,760
	第116回 利付国債 (20年)	2.2000	2030/ 3 /20	216,000	269,060
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	346,000	426,898
	第118回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/ 6 /20	201,000	246,239
	第119回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 6 /20	182,000	218,571
	第120回 利付国債 (20年)	1.6000	2030/ 6 /20	223,000	262,426
	第121回 利付国債 (20年)	1.9000	2030/ 9 /20	323,000	392,706
	第122回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 9 /20	207,000	249,128
	第123回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/12/20	344,000	427,781
	第124回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/12/20	201,000	247,437
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	222,000	279,566
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	196,000	241,675
	第127回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 3 /20	182,000	222,094
	第128回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 6 /20	319,000	390,101
	第129回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 6 /20	185,000	223,837
第130回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 9 /20	334,000	404,881	
第131回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/ 9 /20	182,000	218,225	
第132回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/12/20	237,000	284,447	
第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	317,000	384,708	
第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/ 3 /20	237,000	288,111	

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135回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 3 /20	169,000	203,146
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 3 /20	178,000	211,399
	第137回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 6 /20	192,000	231,150
	第138回 利付国債 (20年)	1.5000	2032/ 6 /20	198,000	232,739
	第139回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 6 /20	178,000	211,834
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 9 /20	511,000	615,683
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	371,000	447,622
	第142回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/12/20	225,000	274,871
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	350,000	417,777
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	223,000	262,772
	第145回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 6 /20	522,000	631,458
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	506,000	612,416
	第147回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/12/20	554,000	662,938
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 3 /20	481,000	568,335
	第149回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 6 /20	521,000	616,061
	第150回 利付国債 (20年)	1.4000	2034/ 9 /20	515,000	600,387
	第151回 利付国債 (20年)	1.2000	2034/12/20	511,000	579,341
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	544,000	616,281
	第153回 利付国債 (20年)	1.3000	2035/ 6 /20	542,000	623,305
	第154回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 9 /20	522,000	590,857
	第155回 利付国債 (20年)	1.0000	2035/12/20	559,000	613,625
	第156回 利付国債 (20年)	0.4000	2036/ 3 /20	468,000	464,485
	第157回 利付国債 (20年)	0.2000	2036/ 6 /20	487,000	464,875
	第158回 利付国債 (20年)	0.5000	2036/ 9 /20	478,000	480,442
	第159回 利付国債 (20年)	0.6000	2036/12/20	505,000	515,433
	第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	495,000	513,082
第161回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 6 /20	501,000	508,905	
第162回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 9 /20	487,000	493,900	
第163回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/12/20	401,000	406,020	
	小計	-	-	-	90,527,405
地方債証券	第682回 東京都公募公債	1.3200	2020/ 3 /19	300,000	307,921
	第697回 東京都公募公債	1.1100	2021/ 6 /18	200,000	207,134
	第707回 東京都公募公債	0.8700	2022/ 3 /18	200,000	206,747
	第708回 東京都公募公債	0.8900	2022/ 6 /20	300,000	310,932
	第730回 東京都公募公債	0.6640	2024/ 3 /19	300,000	311,012
	平成22年度第12回 北海道公募公債	1.2900	2021/ 1 /28	200,000	207,274
	平成27年度第1回 北海道公募公債	0.4300	2025/ 4 /30	300,000	306,821
	第205回 神奈川県公募公債	0.6640	2024/ 3 /19	300,000	310,919
	第30回 神奈川県公募公債 (20年)	1.1610	2035/ 9 /20	100,000	110,420

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	第360回 大阪府公募公債(10年)	0.9000	2022/5/30	300,000	310,797
	第378回 大阪府公募公債(10年)	0.7000	2023/11/28	144,000	149,170
	第384回 大阪府公募公債(10年)	0.6700	2024/5/29	118,000	122,290
	平成25年度第9回 京都府公募公債	0.6900	2023/10/13	300,000	310,584
	平成24年度第1回 兵庫県公募公債	1.0200	2022/4/13	300,000	311,994
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	1.5400	2034/5/9	100,000	116,156
	平成21年度第1回 静岡県公募公債	1.5800	2019/5/24	150,000	152,825
	平成24年度第3回 静岡県公募公債	0.9060	2022/5/20	300,000	310,887
	平成24年度第19回 愛知県公募公債	0.6390	2023/3/28	300,000	308,928
	平成21年度第2回 埼玉県公募公債	1.5700	2019/5/27	300,000	305,652
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	0.9210	2023/7/24	100,000	104,657
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	0.6700	2024/2/26	119,000	123,323
	平成21年度第1回 福岡県公募公債	1.6500	2019/6/25	100,000	102,100
	平成24年度第9回 福岡県公募公債	0.7100	2022/12/26	300,000	309,623
	平成23年度第9回 千葉県公募公債	1.0000	2022/3/25	300,000	311,676
	平成21年度第2回 新潟県公募公債	1.5500	2019/11/27	300,000	307,908
	平成24年度第2回 新潟県公募公債	0.7900	2023/2/27	300,000	311,058
	第10回 群馬県公募公債	0.6700	2023/11/24	300,000	310,431
	平成21年度第1回 岐阜県公募公債	1.3500	2019/10/28	300,000	306,552
	第110回 共同発行市場公募地方債	0.8900	2022/5/25	300,000	310,705
	第123回 共同発行市場公募地方債	0.8700	2023/6/23	300,000	313,007
	第133回 共同発行市場公募地方債	0.6890	2024/4/25	300,000	311,450
	平成22年度第1回 福島県公募公債	1.0500	2020/11/26	200,000	205,564
	平成25年度第1回 熊本市公募公債	0.6550	2023/11/29	300,000	310,204
	平成21年度第1回 新潟市公募公債	1.3400	2019/12/25	300,000	307,141
	平成25年度第2回 大阪市公募公債	0.8330	2023/5/23	150,000	156,100
	平成25年度第6回 大阪市公募公債	0.6940	2023/11/22	200,000	207,218
	第22回 大阪市公募公債(20年)	0.3470	2036/5/30	100,000	96,126
	第1回 京都市公募公債	2.1400	2024/12/20	300,000	341,691
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	0.6890	2024/2/19	100,000	103,741
	平成22年度第1回 横浜市公募公債	1.3600	2020/5/25	300,000	308,878
	平成23年度第4回 横浜市公募公債	1.0450	2021/11/12	200,000	207,490
	第25回 横浜市公募公債(20年)	1.7200	2032/7/16	100,000	118,467
	平成22年度第7回 札幌市公募公債	1.0500	2020/9/18	200,000	205,225
平成25年度第3回 北九州市公募公債	0.7280	2023/12/26	150,000	155,806	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	0.4510	2024/12/24	150,000	153,721	
平成23年度第6回 福岡市公募公債	1.0000	2021/10/28	200,000	207,087	
平成24年度第4回 福岡市公募公債	0.8000	2022/10/31	100,000	103,513	
平成22年度第6回 広島市公募公債	1.2100	2021/5/31	200,000	207,629	

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25年度第1回 高知県公募公債	0.6500	2023/11/29	100,000	103,373
	平成22年度第1回 相模原市公募公債	1.2900	2020/12/18	100,000	103,507
	平成21年度第1回 福井県公募公債	1.3400	2019/12/25	300,000	307,141
	平成19年度第1回 山梨県公募公債	1.3700	2019/10/30	300,000	306,673
	平成22年度第1回 岡山県公募公債	1.0500	2020/11/30	200,000	205,585
		小計	-	-	-
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	207,125
	第22回 政保日本政策投資銀行債券	2.2000	2023/ 6 /19	300,000	334,701
	第80回 政保道路機構債券	1.5000	2019/ 5 /31	200,000	203,685
	第93回 政保道路機構債券	1.4000	2019/11/29	233,000	238,672
	第100回 政保道路機構債券	1.4000	2020/ 2 /28	200,000	205,557
	第107回 政保道路機構債券	1.3000	2020/ 5 /29	315,000	324,122
	第137回 政保道路機構債券	1.2000	2021/ 6 /30	400,000	415,896
	第139回 政保道路機構債券	1.1000	2021/ 7 /30	500,000	518,700
	第155回 政保道路機構債券	0.9000	2022/ 1 /31	300,000	310,564
	第163回 政保道路機構債券	0.9010	2022/ 5 /31	300,000	311,353
	第190回 政保道路機構債券	0.6050	2023/ 5 /31	500,000	515,599
	第211回 政保道路機構債券	0.6600	2024/ 2 /29	500,000	519,437
	第212回 政保道路機構債券	1.5000	2034/ 2 /28	100,000	116,846
	第218回 政保道路機構債券	0.6600	2024/ 5 /31	500,000	519,973
	第278回 政保道路機構債券	0.2370	2036/ 5 /30	100,000	95,081
	第8回 政保地方公営企業等金融機構債券	1.5000	2019/ 5 /24	124,000	126,248
	第4回 地方公営企業等金融機構債券	1.5930	2019/ 5 /28	400,000	407,536
	第5回 地方公共団体金融機構債券	1.3950	2019/10/28	200,000	204,428
	第8回 地方公共団体金融機構債券	1.4530	2020/ 1 /28	100,000	102,665
	第12回 政保地方公共団体金融機構債券	1.3000	2020/ 5 /22	313,000	322,007
	第12回 地方公共団体金融機構債券	1.3800	2020/ 5 /28	200,000	205,938
	第25回 政保地方公共団体金融機構債券	1.2000	2021/ 6 /14	200,000	207,845
	第36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	2022/ 5 /20	200,000	207,519
	第48回 政保地方公共団体金融機構債券	0.6050	2023/ 5 /16	300,000	309,287
	第48回 地方公共団体金融機構債券	0.8130	2023/ 5 /26	400,000	415,472
	第72回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5090	2025/ 5 /23	200,000	206,752
	第5回 政保阪神高速道路債券	1.3000	2020/ 3 /18	140,000	143,693
	第35回 日本政策金融公庫債券	0.6200	2023/ 5 / 8	100,000	102,776
	第56回 政保関西国際空港債券	1.4000	2020/ 2 /25	108,000	110,979
	第37回 住宅金融支援機構債券	1.4000	2019/ 9 /20	500,000	510,651
	第133回 住宅金融支援機構債券	0.8280	2023/ 5 /19	1,000,000	1,038,059
	第37回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7100	2045/ 6 /10	38,442	40,990
	第42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4300	2045/11/10	103,434	109,505

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 46 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.8500	2046/ 3 /10	127,740	137,473
	第 54 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4700	2046/11/10	102,014	108,267
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.4100	2046/12/10	109,674	116,133
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.3400	2047/ 5 /10	112,008	118,280
	第 61 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.2600	2047/ 6 /10	54,014	56,806
	第 62 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.2100	2047/ 7 /10	459,488	482,048
	第 63 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.1100	2047/ 8 /10	283,140	295,513
	第 73 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.3000	2048/ 6 /10	185,619	195,586
	第 78 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.0800	2048/11/10	168,393	175,297
	第 9 回 私学振興債券	1.3440	2019/ 9 /25	100,000	102,080
	第 19 回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.8680	2023/ 6 /20	300,000	312,415
	第 4 回 広島高速道路債券	1.4480	2021/ 2 /26	200,000	208,028
	第 24 回 国際協力機構債券	0.6550	2024/ 6 /20	300,000	310,052
	第 98 回 名古屋高速道路債券	1.4400	2019/ 9 /20	100,000	102,082
	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	207,747
	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	103,821
		小計	-	-	-
金融債券	い第778号 利付農林債券	0.2500	2020/ 3 /27	300,000	301,407
	い第779号 利付農林債券	0.2600	2020/ 4 /27	300,000	301,523
	第300回 利付しんきん中金債券	0.2250	2019/11/27	300,000	301,103
		小計	-	-	904,034
社債券	第 3 回 ノルデア・バンク	1.7500	2022/ 6 /15	200,000	212,478
	第 5 回 スウェンスカ・ハンデルスパンケン	0.6790	2024/ 9 / 4	200,000	203,823
	第 8 回 オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.4070	2019/ 5 / 2	200,000	200,633
	第 16 回 中日本高速道路債券	1.4470	2020/ 3 /19	500,000	514,391
	第 33 回 中日本高速道路債券	1.0840	2021/ 9 /17	300,000	310,902
	第 56 回 中日本高速道路債券	0.7590	2023/12/20	200,000	207,270
	第 20 回 西日本高速道路債券	0.7590	2023/ 9 /20	100,000	103,496
	第 22 回 西日本高速道路債券	0.7440	2024/ 3 /19	300,000	311,071
	第 8 回 旭化成	1.4550	2019/12/11	200,000	204,917
	第 14 回 武田薬品	0.5400	2019/ 7 /19	100,000	100,679
	第 12 回 オリエンタルランド	0.3730	2022/ 3 /18	100,000	101,181
	第 3 回 富士フィルムホールディングス	0.8820	2022/12/ 2	300,000	310,728
	第 68 回 新日本製鐵	1.1090	2021/ 9 /17	200,000	207,087
	第 19 回 豊田自動織機	1.1090	2021/ 9 /17	200,000	207,385
	第 24 回 豊田自動織機	0.7970	2023/ 6 /20	100,000	103,537
	第 71 回 伊藤忠商事	0.8620	2023/ 3 /15	200,000	206,906
	第 39 回 住友商事	1.7080	2022/ 3 /16	100,000	106,360
	第 45 回 住友商事	1.1170	2022/ 4 /20	100,000	104,067

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 46 回 住友商事	0.8840	2022/12/12	100,000	103,508
	第 79 回 三菱商事	1.0220	2022/ 5 /20	100,000	103,870
	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	102,726
	第 7 回 みずほコーポレート銀行劣後特約付	2.5000	2019/ 6 / 3	200,000	206,011
	第127回 三菱東京UFJ銀行	1.2750	2021/ 7 /14	200,000	208,317
	第 7 回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.1100	2019/12/20	200,000	207,307
	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	102,882
	第 9 回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	1.6800	2021/ 4 /28	200,000	209,744
	第 20 回 三井住友銀行劣後特約付	2.2100	2019/ 7 /24	100,000	102,966
	第 23 回 三井住友銀行劣後特約付	1.6100	2020/12/17	100,000	104,204
	第 14 回 みずほ銀行劣後特約付	2.1400	2019/ 9 /27	100,000	103,195
	第 20 回 みずほ銀行劣後特約付	1.4900	2022/ 6 / 3	100,000	105,354
	第139回 オリックス	2.2000	2019/ 8 /26	100,000	103,135
	第173回 オリックス	0.8400	2020/ 4 /17	100,000	101,634
	第 27 回 三菱UFJリース	0.5080	2021/ 2 /24	100,000	101,172
	第 21 回 野村ホールディングス	1.8600	2020/ 3 /17	100,000	103,477
	第 46 回 三井不動産	0.9640	2022/ 8 /30	100,000	103,649
	第111回 三菱地所	0.9290	2022/ 9 /14	100,000	103,613
	第 75 回 東京急行電鉄	0.9820	2022/ 6 / 7	100,000	103,638
	第 77 回 東京急行電鉄	0.9870	2023/ 6 /12	100,000	104,364
	第 13 回 東日本旅客鉄道	2.6000	2020/ 2 /25	300,000	315,034
	第 26 回 東日本旅客鉄道	1.1900	2022/12/20	100,000	105,215
	第 82 回 東日本旅客鉄道	1.1600	2021/12/22	100,000	104,133
	第 87 回 東日本旅客鉄道	0.8690	2022/ 9 /27	200,000	207,033
	第 26 回 西日本旅客鉄道	1.9890	2020/ 3 /19	100,000	103,934
	第 17 回 西日本旅客鉄道	1.3600	2020/ 6 /11	100,000	102,959
	第 19 回 KDDI	1.1510	2020/ 6 /19	100,000	102,421
	第483回 関西電力	1.1550	2020/ 9 /18	200,000	205,744
	第381回 中国電力	0.9530	2024/ 4 /25	200,000	208,689
	第304回 北陸電力	0.9890	2023/10/25	100,000	104,421
	第306回 北陸電力	0.8750	2024/ 5 /24	100,000	103,888
	第448回 東北電力	1.6080	2019/ 5 /24	300,000	305,858
	第253回 四国電力	1.0000	2023/ 6 /23	200,000	208,809
第290回 北海道電力	2.0900	2021/ 4 /23	200,000	212,339	
第 13 回 電源開発	2.0400	2025/ 6 /20	100,000	112,522	
第 31 回 東京瓦斯	1.4050	2019/12/18	100,000	102,439	
第 19 回 大阪瓦斯	1.8300	2020/ 3 /19	100,000	103,605	
	小計	-	-	-	8,910,744
	合計	-	-	-	125,206,350

投資信託財産の構成

2018年3月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	125,206,350	99.1
コール・ローン等、その他	1,119,326	0.9
投資信託財産総額	126,325,676	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

(2018年3月12日現在)

項目	当期末
(A)資産	126,325,676,867円
コーポレート債等	692,697,130
公社債(評価額)	125,206,350,784
未収利息	419,668,916
前払費用	6,960,037
(B)負債	1,240,931
未払解約金	1,235,515
その他未払費用	5,416
(C)純資産総額(A-B)	126,324,435,936
元本	130,405,709,835
次期繰越損益金	△ 4,081,273,899
(D)受益権総口数	130,405,709,835口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,687円

(注1) 期首元本額 164,455,758,041円
 期中追加設定元本額 5,054,259,079円
 期中一部解約元本額 39,104,307,285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D B (適格機関投資家限定) 129,622,236,109円
 DCニッセイ日本債券インデックス 726,908,986円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 1,686,782円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 24,260,970円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 269,209円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 1,022,443円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 4,675,659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) 13,677,660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) 2,831,863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) 2,346,977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) 5,793,177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4,081,273,899円です。

損益の状況

当期(2017年3月11日~2018年3月12日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,438,299,882円
受取利息	1,439,037,569
支払利息	△ 737,687
(B)有価証券売買損益	119,117,377
売却益	855,811,199
売却損	△ 736,693,822
(C)信託報酬等	△ 39,720
(D)当期損益金(A+B+C)	1,557,377,539
(E)前期繰越損益金	△ 6,897,208,598
(F)追加信託差損益金	△ 182,015,736
(G)解約差損益金	1,440,572,896
(H)合計(D+E+F+G)	△ 4,081,273,899
次期繰越損益金(H)	△ 4,081,273,899

(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 24 期

(計算期間：2018年5月22日～2018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

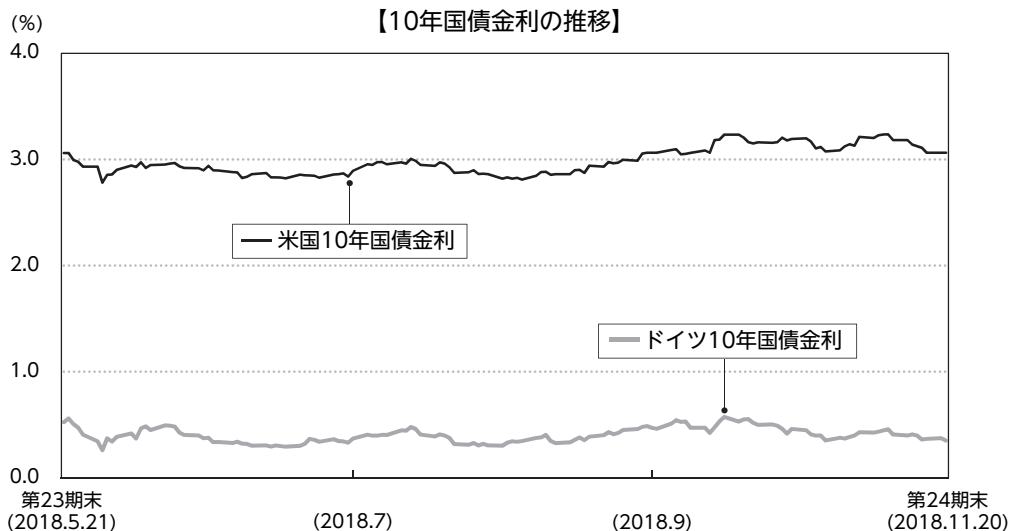
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

投資環境

■ 海外債券市況

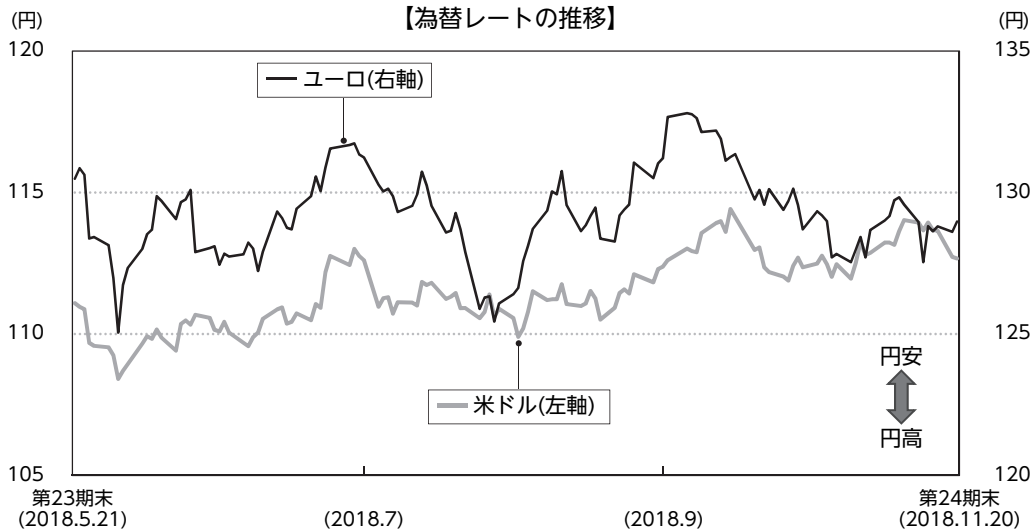


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は小幅に上昇しました。期初以降、米中貿易摩擦懸念や地政学リスクへの警戒感を背景に、金利は低下傾向となりました。9月になると、同懸念が弱まり新興国不安も一服し、金利は上昇する展開となりました。その後は、株価の大幅下落により低下する場面などもありましたが、結局、期初を若干上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は低下しました。期初以降、日銀による金融政策正常化への警戒感等からの上昇圧力もありましたが、欧州景気の減速懸念や米保護主義政策などを背景に、金利は低下傾向となりました。9月になると、米金利上昇などを受けて上昇する場面もありましたが、その後は、世界的に株価が大幅下落したことやイタリアの財政問題等から低下し、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

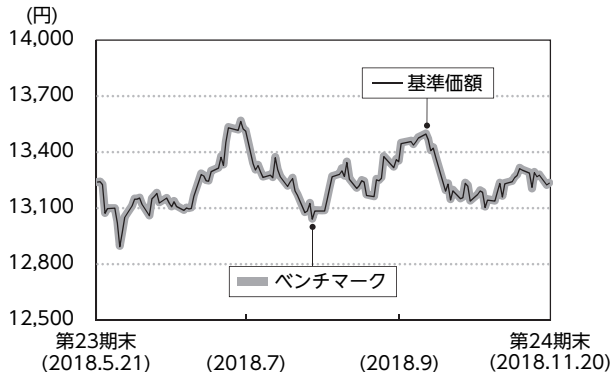


(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは上昇しました。米中貿易摩擦に対する懸念や世界的な株価下落などを受けて下落する場面もありましたが、堅調な米経済指標等を背景に、米ドルは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、イタリアの財政や米中貿易摩擦への懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やイギリスの欧州連合（EU）離脱交渉の進展期待の高まりが上昇要因となりましたが、ユーロはおおむね下落傾向で推移しました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期は、米中貿易摩擦やイタリア財政への懸念等からユーロが対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。一方で、欧州の景況感悪化などから欧州長期金利が低下（債券価格は上昇）したことや、堅調な米経済指標等を背景とした米ドルの対円での上昇は、基準価額の上昇要因となりましたが、期を通じて見ると若干下落して当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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。以下同じです。

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-0.0%となり、ベンチマーク騰落率（-0.0%）に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
20期(2016年11月21日)	12,470	△3.7	12,576	△3.7	98.7	10,062
21期(2017年5月22日)	13,045	4.6	13,165	4.7	98.8	11,666
22期(2017年11月20日)	13,528	3.7	13,656	3.7	98.8	13,064
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

(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、設定時を10,000として、指数化しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
		%		%	
(期首)2018年5月21日	13,240	—	13,369	—	99.1
5月末	12,972	△2.0	13,103	△2.0	98.9
6月末	13,164	△0.6	13,297	△0.5	99.4
7月末	13,263	0.2	13,396	0.2	99.3
8月末	13,255	0.1	13,388	0.1	98.8
9月末	13,476	1.8	13,613	1.8	99.0
10月末	13,232	△0.1	13,366	△0.0	98.8
(期末)2018年11月20日	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.021%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.021)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	3	0.021	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,235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5月22日～2018年11月20日

公社債

		買付額	売付額	
外国	アメリカ	千米ドル 17,419	千米ドル 7,408	
	カナダ	千カナダ・ドル 867	千カナダ・ドル 644	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 667	千オーストラリア・ドル 233	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 190	千シンガポール・ドル 130	
	イギリス	千イギリス・ポンド 1,428	千イギリス・ポンド 720	
	スイス	千スイス・フラン -	千スイス・フラン 244	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 858	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 501	千ノルウェー・クローネ 857	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 403	千スウェーデン・クローナ -	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 4,151	千メキシコ・ペソ 228	
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 393	千マレーシア・リンギット 51	
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 1,800	千南アフリカ・ランド 131	
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 673	千ポーランド・ズロチ 433	
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 191	千ユーロ 159
		オランダ	千ユーロ 408	千ユーロ 191
		ベルギー	千ユーロ 478	千ユーロ 189
		フランス	千ユーロ 2,409	千ユーロ 909
		ドイツ	千ユーロ 1,704	千ユーロ 871
		スペイン	千ユーロ 1,394	千ユーロ 603
イタリア		千ユーロ 1,865	千ユーロ 902	
フィンランド		千ユーロ 117	千ユーロ 41	
オーストリア	千ユーロ 268	千ユーロ 174		

(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

2018年5月22日～2018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	111,525	US TREASURY	130,876
US TREASURY	98,331	US TREASURY	120,319
US TREASURY	92,556	US TREASURY	115,432
US TREASURY	74,936	US TREASURY	102,124
US TREASURY	72,063	US TREASURY	97,022
US TREASURY	71,012	US TREASURY	87,574
US TREASURY	67,901	FRANCE (GOVT OF)	52,419
US TREASURY	66,494	UK TSY 1 3/4% 2019	51,132
US TREASURY	54,405	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,165
US TREASURY	51,691	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	28,236

(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

2018年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	73,750	71,862	8,096,694	45.6	—	18.4	17.6	9.6
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	4,070	4,223	361,158	2.0	—	0.9	0.6	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	4,290	4,514	371,210	2.1	—	1.3	0.6	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	830	848	69,712	0.4	—	0.2	0.1	0.0
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	6,740	8,091	1,171,742	6.6	—	4.8	1.3	0.5
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	5,190	6,293	108,751	0.6	—	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	千ルウェー・クローネ 3,040	千ルウェー・クローネ 3,123	千円 41,482	% 0.2	% -	% 0.1	% 0.1	% -	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 4,710	千スウェーデン・クローナ 5,269	65,923	0.4	-	0.2	0.2	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 26,020	千メキシコ・ペソ 24,522	135,853	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 3,200	千マレーシア・リンギット 3,167	85,214	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 14,090	千南アフリカ・ランド 12,694	101,812	0.6	-	0.5	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,360	千ポーランド・ズロチ 3,532	105,223	0.6	-	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	980	1,063	137,112	0.8	-	0.5	0.1	0.1
	オランダ	2,480	2,880	371,548	2.1	-	1.3	0.6	0.2
	ベルギー	2,850	3,334	430,031	2.4	-	1.7	0.5	0.1
	フランス	12,180	13,965	1,801,301	10.1	-	6.3	2.8	1.0
	ドイツ	8,230	9,502	1,225,689	6.9	-	3.9	2.0	1.0
	スペイン	7,100	8,029	1,035,642	5.8	-	3.7	1.4	0.7
	イタリア	11,690	11,850	1,528,414	8.6	-	4.8	2.8	1.1
	フィンランド	780	845	109,044	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	1,730	2,012	259,576	1.5	-	0.9	0.4	0.1	
合計	-	-	17,613,140	99.1	-	51.3	32.1	15.7	

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	80	95	10,789
	US TREASURY	6.5000	2026/11/15	60	74	8,439
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	90	111	12,584
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	60	72	8,138
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	80	94	10,694
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	50	59	6,701
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	120	147	16,634
	US TREASURY	1.2500	2019/10/31	1,160	1,144	128,960
	US TREASURY	1.3750	2019/12/15	1,020	1,005	113,297
	US TREASURY	1.6250	2019/12/31	1,080	1,066	120,200
	US TREASURY	1.3750	2020/01/31	1,390	1,367	154,083
	US TREASURY	1.3750	2020/02/29	1,010	992	111,826
	US TREASURY	1.3750	2020/03/31	970	952	107,278
	US TREASURY	3.5000	2020/05/15	1,320	1,333	150,291
	US TREASURY	1.5000	2020/05/31	1,090	1,069	120,468
	US TREASURY	1.6250	2020/06/30	1,000	981	110,636
	US TREASURY	2.6250	2020/08/15	1,440	1,435	161,787
	US TREASURY	1.3750	2020/08/31	1,120	1,092	123,103
	US TREASURY	2.0000	2020/09/30	1,070	1,054	118,847
	US TREASURY	2.6250	2020/11/15	1,660	1,654	186,373
	US TREASURY	1.8750	2020/12/15	780	765	86,282
	US TREASURY	2.3750	2020/12/31	790	783	88,240
	US TREASURY	1.3750	2021/01/31	1,230	1,192	134,387
	US TREASURY	2.0000	2021/02/28	790	775	87,430
	US TREASURY	2.2500	2021/03/31	820	809	91,219
	US TREASURY	3.1250	2021/05/15	1,090	1,098	123,735
	US TREASURY	2.0000	2021/05/31	850	833	93,872
	US TREASURY	2.1250	2021/06/30	870	854	96,322
	US TREASURY	2.1250	2021/08/15	1,280	1,256	141,575
	US TREASURY	2.0000	2021/08/31	890	870	98,070
	US TREASURY	2.1250	2021/09/30	920	902	101,664
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	1,320	1,289	145,250
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	890	871	98,168
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	1,220	1,188	133,928
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	800	772	86,987
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	1,210	1,166	131,392
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	730	711	80,205

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	千円
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	1,240	1,185	133,624
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	770	738	83,237
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	1,270	1,211	136,450
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	800	777	87,550
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	1,460	1,409	158,804
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	790	745	84,008
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	1,520	1,448	163,190
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	800	748	84,333
	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	1,480	1,455	163,988
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	810	755	85,065
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,140	1,133	127,660
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	440	426	48,077
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	950	943	106,282
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	350	336	37,921
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	1,000	979	110,345
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	380	362	40,802
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	1,010	980	110,497
	US TREASURY	2.1250	2024/09/30	380	363	40,968
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	1,040	1,000	112,768
	US TREASURY	2.2500	2024/12/31	380	365	41,168
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	1,020	965	108,749
	US TREASURY	2.6250	2025/03/31	380	372	42,006
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	1,100	1,046	117,855
	US TREASURY	2.7500	2025/06/30	350	345	38,944
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	1,070	1,006	113,430
	US TREASURY	3.0000	2025/09/30	390	390	44,037
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	900	858	96,756
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	580	528	59,578
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	590	535	60,385
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	580	519	58,581
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	590	547	61,689
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	590	556	62,712
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	580	551	62,164
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	580	544	61,386
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	580	543	61,248
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	600	585	65,924
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	650	640	72,125
	US TREASURY	2.8750	2028/08/15	670	659	74,291

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千円	千円
アメリカ	%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	140	164	18,571
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	60	75	8,474
US TREASURY	4.3750	2038/02/15	60	70	7,897
US TREASURY	4.5000	2038/05/15	70	83	9,364
US TREASURY	3.5000	2039/02/15	110	114	12,898
US TREASURY	4.2500	2039/05/15	120	138	15,569
US TREASURY	4.5000	2039/08/15	110	130	14,737
US TREASURY	4.3750	2039/11/15	130	152	17,141
US TREASURY	4.6250	2040/02/15	200	241	27,250
US TREASURY	3.8750	2040/08/15	160	174	19,713
US TREASURY	4.2500	2040/11/15	160	184	20,773
US TREASURY	4.7500	2041/02/15	170	209	23,605
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	130	126	14,252
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	170	165	18,618
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	150	142	16,061
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	220	199	22,500
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	270	244	27,584
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	280	271	30,561
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	370	342	38,606
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	330	347	39,133
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	380	408	45,985
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	390	410	46,273
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	390	394	44,416
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	400	386	43,601
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	380	359	40,482
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	400	342	38,598
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	390	368	41,505
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	400	368	41,522
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	390	368	41,467
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	360	306	34,589
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	370	315	35,517
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	350	281	31,767
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	370	340	38,317
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	360	339	38,204
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	360	338	38,178
US TREASURY	2.7500	2047/08/15	360	321	36,278
US TREASURY	2.7500	2047/11/15	360	321	36,249
US TREASURY	3.0000	2048/02/15	380	357	40,232

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	430	414	46,652
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	430	404	45,527
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	80	104	11,752
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	160	187	21,111
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	140	164	18,508
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	150	161	18,148
小計		-	-	-	-	8,096,694
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	40	44	3,764
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2019/11/01	130	129	11,034
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2020/02/01	130	128	11,005
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2020/03/01	210	208	17,816
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/05/01	110	109	9,352
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2020/06/01	120	122	10,467
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/08/01	100	99	8,488
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2020/09/01	250	243	20,842
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2020/11/01	100	99	8,517
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/03/01	230	222	19,026
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2021/06/01	120	122	10,515
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/09/01	190	182	15,599
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2022/03/01	140	132	11,309
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/06/01	130	132	11,296
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2022/09/01	140	133	11,424
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2023/03/01	140	137	11,716
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/06/01	120	116	9,921
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/09/01	120	118	10,131
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	30	29	2,559
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	130	131	11,230
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	110	109	9,364
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	120	113	9,669
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	150	134	11,496
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/06/01	40	57	4,906
CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	120	116	9,950	
CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	50	49	4,229	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	100	131	11,222	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	110	155	13,257	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	120	165	14,179
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	140	177	15,187
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	160	193	16,552
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	140	149	12,798
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	30	27	2,321
小計		-	-	-	-	361,158
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	4.5000	2020/04/15	230	237	19,558
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/11/21	250	248	20,440
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/05/15	280	304	25,066
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	160	159	13,107
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	230	258	21,283
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	130	130	10,702
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	230	261	21,481
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	250	254	20,952
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	250	261	21,516
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	300	334	27,525
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	280	325	26,763
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	260	262	21,574
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	250	241	19,853
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	240	241	19,882
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	200	210	17,310
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	150	150	12,407
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	80	78	6,443
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	130	155	12,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	60	58	4,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	110	121	9,993
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	70	71	5,913	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	40	37	3,092	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	110	106	8,735	
小計		-	-	-	-	371,210
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	3.2500	2020/09/01	100	102	8,387
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/06/01	80	80	6,601
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	80	82	6,806
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	110	112	9,258
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	50	51	4,268
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	30	30	2,472

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	
					千シンガポールドル	千円
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	2.1250	2026/06/01	50	49	4,041
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	70	75	6,232
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	40	40	3,344
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	10	10	848
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	40	41	3,383
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	50	54	4,447
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	30	28	2,302
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	40	39	3,264
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	50	49	4,053
小計		-	-	-	-	69,712
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	2020/09/07	170	179	25,961
	UK TREASURY	3.7500	2021/09/07	140	151	21,960
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	180	249	36,098
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	180	269	38,963
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	200	273	39,592
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	160	239	34,616
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	130	163	23,674
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	150	198	28,721
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	140	196	28,518
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	160	227	32,968
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	160	260	37,667
	UK TREASURY	4.7500	2020/03/07	170	178	25,904
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	130	176	25,597
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	120	132	19,209
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	140	225	32,653
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	140	208	30,122
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	150	186	26,962
	UK TREASURY	8.0000	2021/06/07	120	142	20,580
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	100	144	20,856
	UK TREASURY	1.5000	2021/01/22	240	244	35,356
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	170	174	25,237
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	210	189	27,454
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	220	219	31,791
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	150	153	22,221
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	100	92	13,340
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	80	80	11,589
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	220	227	32,976

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	千円
イギリス		%		千円	千円	千円
国債証券	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	30	28	4,151
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	150	144	20,952
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	160	170	24,643
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	120	131	19,101
	UK TREASURY	2.0000	2020/07/22	240	245	35,514
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	160	169	24,588
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	160	244	35,338
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	220	276	40,023
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	140	204	29,545
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	210	275	39,939
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	130	200	28,998
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	240	237	34,400
	UK TREASURY	0.7500	2023/07/22	250	248	35,940
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	130	127	18,495
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	170	203	29,510
小計		-	-	-	-	1,171,742
デンマーク				千円	千円	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0000	2019/11/15	720	753	13,018
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2020/11/15	410	417	7,206
	KINGDOM OF DENMARK	3.0000	2021/11/15	830	916	15,844
	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	490	531	9,176
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	720	803	13,880
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	830	842	14,552
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	1,190	2,029	35,072
小計		-	-	-	-	108,751
ノルウェー				千円	千円	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.7500	2021/05/25	790	838	11,136
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/05/24	650	663	8,806
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	420	449	5,965
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	310	310	4,123
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	320	313	4,166
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	340	337	4,476
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	210	211	2,806
小計		-	-	-	-	41,482
スウェーデン				千円	千円	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0000	2020/12/01	880	977	12,229
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/06/01	940	1,062	13,290
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	760	815	10,202

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千スウェーデン・クローナ	千円
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	2.5000	2025/05/12	520	595	7,450
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	620	648	8,114
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	560	568	7,115
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	430	601	7,519
小計		-	-	-	-	65,923
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	5.0000	2019/12/11	1,980	1,910	10,582
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2020/06/11	2,570	2,551	14,134
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2021/06/10	3,300	3,141	17,404
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	2,550	2,380	13,185
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	1,670	1,619	8,970
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	2,490	2,625	14,547
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	1,490	1,239	6,865
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	2,400	2,186	12,115
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	840	806	4,466
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	1,450	1,291	7,154
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	720	628	3,480
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	900	954	5,290
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	1,230	1,132	6,272
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	1,830	1,539	8,528
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	600	515	2,856
小計		-	-	-	-	135,853
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	4.3780	2019/11/29	260	262	7,058
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/07/31	270	271	7,304
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1600	2021/07/15	310	314	8,447
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	280	276	7,437
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	280	275	7,418
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	210	211	5,687
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	200	198	5,330
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	120	121	3,277
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	60	58	1,581
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	250	244	6,574
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	80	77	2,080
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	110	110	2,960
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	120	117	3,148
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/04/15	30	28	773
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	200	184	4,953

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	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	4.2540	2035/05/31	70	65	1,769
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	110	109	2,933
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	100	99	2,676
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	80	76	2,063
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.2480	2028/09/15	60	64	1,734
小計		-	-	-	-	85,214
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	7.2500	2020/01/15	260	262	2,106
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/03/31	450	443	3,557
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/02/28	840	820	6,580
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	2,030	2,186	17,537
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/01/31	1,240	1,109	8,901
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/02/28	1,020	831	6,666
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/03/31	830	741	5,943
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/02/28	810	746	5,988
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/03/31	890	630	5,056
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/01/31	1,140	1,007	8,078
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/01/31	730	668	5,361
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/02/28	860	596	4,780
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/01/31	1,260	1,118	8,967
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/02/28	1,730	1,531	12,285
小計		-	-	-	-	101,812
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	1.5000	2020/04/25	280	280	8,342
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.2500	2020/10/25	330	353	10,516
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	590	655	19,517
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	420	473	14,120
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	550	588	17,543
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	330	337	10,059
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	350	337	10,051
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	300	285	8,502
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	140	134	4,016
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	70	85	2,552
小計		-	-	-	-	105,223
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	9,301
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	100	102	13,165
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	40	38	5,016

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ						
%						
千ユーロ						
千ユーロ						
千円						
アイルランド						
国債証券	IRISH TREASURY	1.3500	2031/03/18	30	30	3,870
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	50	50	6,468
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	80	82	10,595
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	90	101	13,040
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	50	50	6,451
	IRISH TREASURY	0.9000	2028/05/15	80	79	10,210
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	70	81	10,511
	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	60	69	9,024
	TREASURY 4 1/2% 2020	4.5000	2020/04/18	90	96	12,431
	TREASURY 5% 2020	5.0000	2020/10/18	60	66	8,550
	TREASURY 5.4% 2025	5.4000	2025/03/13	110	143	18,473
小計		-	-	-	-	137,112
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2020/01/15	140	141	18,260
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5000	2020/07/15	130	139	17,928
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/07/15	160	176	22,720
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	140	141	18,290
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	140	153	19,784
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	140	163	21,108
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	140	152	19,690
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	130	130	16,820
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	150	167	21,547
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	140	141	18,193
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	150	152	19,699
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	140	144	18,586
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	120	175	22,590
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	110	112	14,507
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	130	159	20,599
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	150	228	29,443
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	140	219	28,333
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	130	181	23,441
小計		-	-	-	-	371,548
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2020/09/28	180	194	25,082
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/09/28	150	170	21,935
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	130	148	19,210
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	150	176	22,713

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	130	144	18,578
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	90	90	11,711
	BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	140	159	20,517
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	70	71	9,169
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	150	154	19,912
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	100	129	16,663
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	130	134	17,350
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	130	131	16,913
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	170	242	31,341
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	130	129	16,714
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	100	98	12,722
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	80	108	13,980
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	40	39	5,154
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	70	86	11,147
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	180	276	35,618
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	40	39	5,096
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	60	63	8,193
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	160	238	30,788
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	90	128	16,560
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	100	95	12,285
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	40	42	5,451
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	40	40	5,216
小計						430,031
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2019/11/25	200	202	26,083
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/02/25	240	241	31,193
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2020/04/25	350	370	47,787
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/05/25	210	211	27,331
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2020/10/25	350	370	47,807
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	230	233	30,126
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/02/25	260	262	33,882
	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/04/25	360	397	51,206
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/05/25	280	283	36,519
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	370	409	52,834
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	430	478	61,759
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	230	232	29,939
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	310	339	43,853

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	250	251	32,381
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	450	487	62,896
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	430	521	67,238
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	160	159	20,534
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	320	358	46,215
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	340	372	48,025
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	340	345	44,555
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	270	375	48,466
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	280	293	37,800
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	330	406	52,418
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	310	311	40,241
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	280	274	35,430
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	290	300	38,726
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	350	415	53,593
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	310	310	40,110
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	160	159	20,578
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	330	487	62,841
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	310	364	46,952
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	430	454	58,673
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	300	483	62,364
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	90	90	11,681
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	250	383	49,433
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	270	266	34,408
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	240	350	45,261
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	140	147	19,064
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	310	490	63,227
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	230	311	40,148
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	230	245	31,653
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	140	222	28,659
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	120	194	25,143
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	100	94	12,248
小計		-	-	-	-	1,801,301
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2020/04/17	170	171	22,132
	BUNDESobligation	0.2500	2020/10/16	170	172	22,295
	BUNDESobligation	0.0000	2021/04/09	200	202	26,154
	BUNDESobligation	0.0000	2021/10/08	180	182	23,567

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2022/04/08	170	172	22,264
BUNDESobligation	0.0000	2022/10/07	150	152	19,634
BUNDESobligation	0.0000	2023/10/13	120	121	15,647
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2020/01/04	210	219	28,304
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0000	2020/07/04	200	211	27,333
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.2500	2020/09/04	230	242	31,217
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/01/04	170	181	23,393
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	330	363	46,846
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	190	204	26,430
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	380	407	52,574
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	180	194	25,040
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	310	335	43,245
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	160	177	22,869
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	270	297	38,376
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	170	185	23,922
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	180	191	24,712
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	200	206	26,688
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	220	234	30,285
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	240	247	31,922
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	240	237	30,647
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	250	251	32,412
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	240	245	31,636
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	200	203	26,244
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	140	138	17,846
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	90	147	18,994
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	190	304	39,323
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	210	324	41,869
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	130	213	27,589
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	150	265	34,240
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	140	209	26,992
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	250	335	43,331
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	230	312	40,333
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	100	105	13,568
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/12/13	120	120	15,588
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/03/13	130	131	16,913
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/06/12	120	121	15,638
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	100	154	19,871

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	140	207	26,819
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	110	156	20,167
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	150	238	30,798
	小計	-	-	-	-	1,225,689
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3000	2019/10/31	170	177	22,899
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2020/01/31	210	214	27,660
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2020/04/30	230	244	31,500
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.1500	2020/07/30	180	184	23,753
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8500	2020/10/31	170	186	24,049
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/01/31	190	190	24,557
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/04/30	230	260	33,656
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7500	2021/07/30	200	203	26,305
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/10/31	30	29	3,857
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	210	247	31,973
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	190	191	24,643
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	170	170	21,988
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	200	241	31,086
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.3500	2023/07/30	90	88	11,469
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	200	236	30,448
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	160	192	24,878
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	190	219	28,371
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	230	254	32,815
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	200	207	26,742
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	210	258	33,322
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	210	224	28,909
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	180	188	24,358
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	190	253	32,742
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	200	199	25,722
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	170	170	22,005
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	210	208	26,947
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	190	186	24,117
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	150	146	18,923
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	170	224	28,941
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	240	337	43,523
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	200	201	25,991
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	200	289	37,374

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ			%	千ユーロ	千円	
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	140	143	18,480
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	180	230	29,756
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	170	238	30,816
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	190	261	33,708
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	130	190	24,613
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	160	165	21,350
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	80	78	10,121
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	80	87	11,256
小計			-	-	-	1,035,642
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0500	2019/12/01	140	140	18,133
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2020/02/01	210	218	28,232
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2020/03/01	220	229	29,542
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7000	2020/05/01	200	198	25,658
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2020/06/15	120	118	15,297
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2020/09/01	240	250	32,357
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2000	2020/10/15	140	136	17,660
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2020/11/01	170	167	21,612
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/03/01	220	229	29,657
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2021/04/15	150	144	18,575
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/05/01	160	167	21,550
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2021/06/01	170	164	21,206
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/08/01	490	511	65,941
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	300	300	38,725
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	530	512	66,161
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	180	199	25,674
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	330	317	40,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	200	221	28,541
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	320	298	38,470
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	180	193	24,915
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	230	249	32,229
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	180	162	21,022
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	110	140	18,183
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	220	235	30,432
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	150	141	18,254
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	180	186	24,037
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	320	310	40,097

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	230	254	32,784
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	320	289	37,338
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	240	222	28,642
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	200	215	27,838
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	170	151	19,586
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	160	138	17,836
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	160	146	18,851
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	190	170	22,034
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	250	307	39,598
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	170	151	19,564
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	220	243	31,359
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	90	84	10,879
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	260	297	38,388
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	210	207	26,765
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	280	342	44,197
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	200	159	20,571
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	190	229	29,587
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	150	128	16,573
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	230	261	33,693
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	140	113	14,586
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	260	264	34,083
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	110	94	12,244
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	210	237	30,595
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	210	236	30,470
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	160	175	22,676
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	150	132	17,077
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	150	120	15,514
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	140	125	16,234
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	60	46	6,045
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	120	152	19,657
小計		-	-	-	-	1,528,414
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.3750	2020/04/15	60	63	8,171
	FINNISH GOVERNMENT	0.3750	2020/09/15	50	50	6,559
	FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/04/15	60	65	8,479
	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	90	96	12,435
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	50	53	6,914

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	50	50	6,470
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	40	44	5,710
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	50	62	8,056
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	40	41	5,379
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	50	50	6,523
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	50	49	6,434
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	70	84	10,845
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	40	39	5,098
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	40	40	5,246
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	40	52	6,720
小計						
		-	-	-	-	109,044
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9000	2020/07/15	130	139	18,015
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/09/15	150	166	21,522
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	80	90	11,733
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	70	70	9,113
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	100	114	14,797
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	160	174	22,511
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	90	98	12,684
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	100	106	13,730
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	80	106	13,719
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	110	112	14,552
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	80	79	10,313
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	80	119	15,357
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	90	91	11,755
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	70	83	10,731
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	130	193	25,013
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	60	83	10,743
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	50	50	6,513
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	40	67	8,767
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	20	18	2,329
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	40	43	5,672
小計						
		-	-	-	-	259,576
ユーロ小計						
		-	-	-	-	6,898,363
合計						
		-	-	-	-	17,613,140

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	17,613,140	98.6
コール・ローン等、その他	253,504	1.4
投資信託財産総額	17,866,645	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1シンガポール・ドル82.17円、1イギリス・ポンド144.81円、1デンマーク・クローネ17.28円、1ノルウェー・クローネ13.28円、1スウェーデン・クローナ12.51円、1メキシコ・ペソ5.54円、1マレーシア・リングgit26.90円、1南アフリカ・ランド8.02円、1ポーランド・ズロチ29.79円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（17,731,935千円）の投資信託財産総額（17,866,645千円）に対する比率は99.2%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	17,915,615,404円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	132,034,626
公 社 債(評価額)	17,613,140,774
未 収 入 金	49,636,345
未 収 利 息	113,252,488
前 払 費 用	7,551,171
(B)負債	146,922,591
未 払 金	128,197,594
未 払 解 約 金	18,722,533
そ の 他 未 払 費 用	2,464
(C)純 資 産 総 額(A - B)	17,768,692,813
元 本	13,426,526,479
次 期 繰 越 損 益 金	4,342,166,334
(D)受 益 権 総 口 数	13,426,526,479口
1万口当たり基準価額(C / D)	13,234円

(注1)	期首元本額	12,105,288,821円
	期中追加設定元本額	2,723,768,228円
	期中一部解約元本額	1,402,530,570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。	
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	1,461,969,133円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,584,015,447円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	903,148,588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	7,278,919,564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)	528,387,080円
	D Cニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2055	5,967,897円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	59,712,782円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2045	3,292,189円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2035	4,935,002円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2025	2,849,336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)	18,318,542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)	1,959,566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)	11,639,679円

損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	205,719,770円
受 取 利 息	205,757,393
支 払 利 息	△ 37,623
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 200,798,492
売 買 益	180,386,988
売 買 損	△ 381,185,480
(C)信 託 報 酬 等	△ 3,607,130
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	1,314,148
(E)前 期 繰 越 損 益 金	3,921,668,054
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	879,729,378
(G)解 約 差 損 益 金	△ 460,545,246
(H)合 計(D + E + F + G)	4,342,166,334
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,342,166,334

- (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。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 1 期

(計算期間：2018年1月30日～2018年11月20日)

運用方針

主に新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）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

新興国の米ドル建て公社債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 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

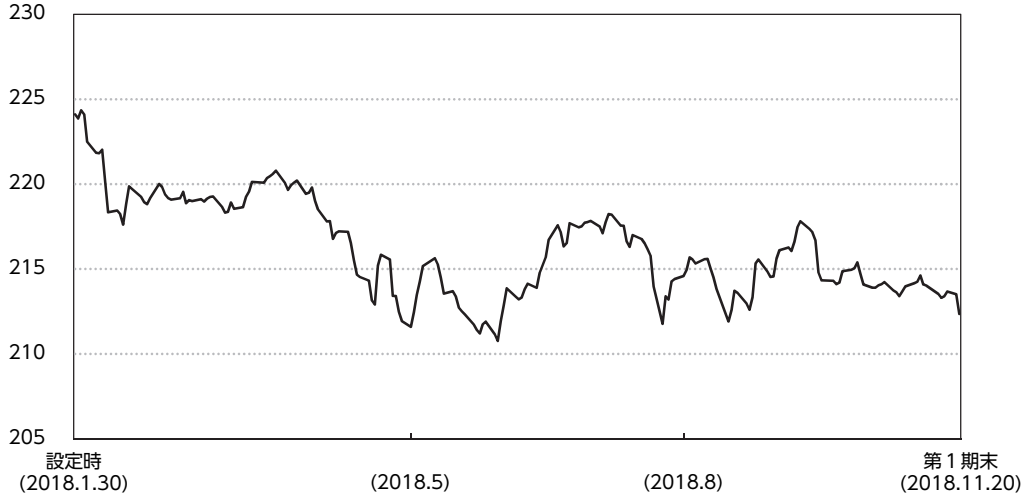
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年1月30日～2018年11月20日

新興国債券市況

【J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）の推移】

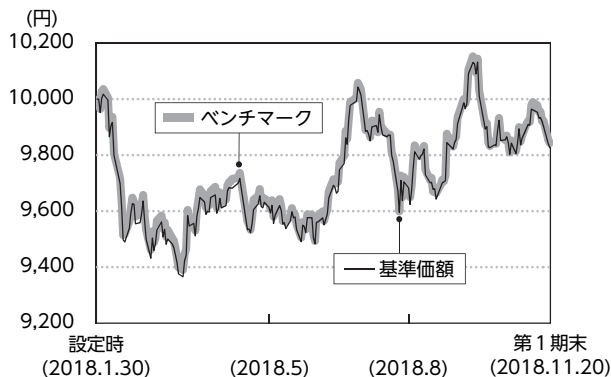


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の新興国債券市場は、米ドル建て新興国債券金利が上昇（債券価格は下落）したことから下落しました。また、米国10年国債金利が上昇し、新興国債券の米国国債に対するスプレッド（上乗せ金利）も拡大しました。

設定時以降、ベースとなる米国10年国債金利が日欧の金融政策正常化への懸念等を背景に上昇したことから、新興国債券市場は下落しました。3月になると、米保護主義政策に対する懸念等から金利が低下し、その後も米中貿易摩擦や新興国不安等により低下傾向となりましたが、新興国不安等によってスプレッドが拡大する場面もあり、新興国債券市場は上下しながら推移しました。9月には、新興国不安の一服などから新興国債券市場は上昇しましたが、期末にかけては、株価の大幅下落を受けてスプレッドが拡大する場面などもあり、結局、当期の新興国債券市場は下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期を通じて見るとマイナス要因が上回り下落しました。米ドルが対円で上昇したことはプラス要因となったものの、米ドル建て新興国債券金利の上昇がマイナス要因となりました。

当期の米国10年国債金利は、米中貿易摩擦に対する懸念や新興国不安などから低下する場面がありましたが、好調な米景気とそれに伴う利上げ継続などから、期を通じて見ると上昇しました。また、米保護主義政策への懸念から、新興国債券の米国国債に対するスプレッドは拡大しました。そのため、期を通じて見ると米ドル建て新興国債券金利が上昇したため、基準価額下落の要因となりました。

(注) ベンチマークは J P モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除く B 格以下、円換算ベース) で、設定時を 10,000 として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。J P モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除く B 格以下) は J P モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (以下「EMB I +」といいます) から格付が B 格以下の債券等を除いたものです。EMB I + は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。J P モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除く B 格以下) の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。以下同じです。

ポートフォリオ

新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、ベンチマーク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 -1.7% となり、ベンチマーク騰落率 (-1.6%) にほぼ連動しました。

今後の運用方針

新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、ベンチマーク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
2018年1月30日	10,000	-		10,000	-		-	1,000
1期(2018年11月20日)	9,827	△1.7		9,844	△1.6		97.1	995

(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) ベンチマークはJ.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除くB格以下、円換算ベース) で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。J.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除くB格以下) はJ.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (以下「EMB I+」といいます) から格付がB格以下の債券等を除いたものです。EMB I+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。J.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (除くB格以下) の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・転載を禁じます。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
(設定日)2018年1月30日	円	%			%		%
	10,000	-		10,000	-		-
1月末	9,953	△0.5		9,965	△0.3		97.3
2月末	9,636	△3.6		9,658	△3.4		96.5
3月末	9,547	△4.5		9,569	△4.3		97.3
4月末	9,682	△3.2		9,715	△2.9		97.8
5月末	9,559	△4.4		9,575	△4.3		97.2
6月末	9,647	△3.5		9,671	△3.3		97.8
7月末	9,882	△1.2		9,882	△1.2		97.3
8月末	9,730	△2.7		9,748	△2.5		97.9
9月末	10,091	0.9		10,106	1.1		97.5
10月末	9,894	△1.1		9,900	△1.0		97.4
(期末)2018年11月20日	9,827	△1.7		9,844	△1.6		97.1

(注) 騰落率は設定日比です。

1万口当たりの費用明細

2018年1月30日～2018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	0.019%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.017)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.002)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	2	0.019	

(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（9,720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1月30日～2018年11月20日

公社債

			買付額	売付額
			千米ドル	千米ドル
外国	アメリカ	国債証券	9,625	206 (24)

(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1月30日～2018年11月20日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
RUSSIAN FEDERATION	44,709	REPUBLIC OF PHILIPPINES	11,656
REPUBLIC OF INDONESIA	30,175	RUSSIAN FEDERATION	11,011
RUSSIAN FEDERATION	29,697	—	—
CROATIA	29,497		
REPUBLIC OF INDONESIA	24,613		
FED REPUBLIC OF BRAZIL	24,210		
REPUBLIC OF TURKEY	23,504		
REPUBLIC OF INDONESIA	23,328		
RUSSIAN FEDERATION	23,281		
RUSSIAN FEDERATION	23,128		

(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

2018年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	8,704	8,577	966,387	97.1	26.9	77.9	13.4	5.8

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

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

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

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

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	CROATIA	6.0000	2024/01/26	240	258	29,096
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.8750	2021/01/22	100	101	11,478
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.2500	2025/01/07	200	193	21,771
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0000	2026/04/07	200	209	23,629
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	7.1250	2037/01/20	100	110	12,396
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.6250	2041/01/07	100	92	10,393
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.6250	2047/02/21	200	181	20,427
	HUNGARY	6.2500	2020/01/29	80	82	9,284
	HUNGARY	6.3750	2021/03/29	80	84	9,514
	HUNGARY	5.3750	2023/02/21	60	62	7,057
	HUNGARY	5.7500	2023/11/22	60	63	7,189
	HUNGARY	5.3750	2024/03/25	70	73	8,311
	HUNGARY	7.6250	2041/03/29	40	53	6,048
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.0000	2024/02/26	200	195	22,004
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8.1250	2024/05/21	30	34	3,942
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.8750	2027/04/25	200	187	21,125
	REPUBLIC OF COLOMBIA	6.1250	2041/01/18	100	105	11,920
	REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0000	2045/06/15	200	185	20,843
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.8750	2021/05/05	200	204	22,990
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.8750	2024/01/15	200	209	23,643
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.7500	2026/01/08	200	198	22,408
	REPUBLIC OF INDONESIA	7.7500	2038/01/17	100	124	13,988
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.2500	2047/01/08	250	238	26,882
	REPUBLIC OF PANAMA	3.8750	2028/03/17	200	191	21,548
	REPUBLIC OF PANAMA	6.7000	2036/01/26	90	106	12,041
	REPUBLIC OF PERU	4.1250	2027/08/25	100	100	11,312
	REPUBLIC OF PERU	6.5500	2037/03/14	40	48	5,464
	REPUBLIC OF PERU	5.6250	2050/11/18	80	89	10,050
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.0000	2021/01/15	100	100	11,378
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	7.7500	2031/01/14	100	131	14,824
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.3750	2032/01/15	100	120	13,539
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.3750	2034/10/23	100	122	13,770
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.7000	2042/02/02	200	179	20,219
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.5000	2020/03/09	120	121	13,658

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.6650	2024/01/17	110	105	11,874
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.0000	2046/10/12	200	160	18,030
	REPUBLIC OF TURKEY	7.0000	2020/06/05	100	101	11,380
	REPUBLIC OF TURKEY	6.2500	2022/09/26	200	195	22,015
	REPUBLIC OF TURKEY	5.7500	2024/03/22	200	187	21,131
	REPUBLIC OF TURKEY	7.3750	2025/02/05	100	99	11,240
	REPUBLIC OF TURKEY	4.8750	2026/10/09	200	170	19,196
	REPUBLIC OF TURKEY	11.8750	2030/01/15	50	65	7,380
	REPUBLIC OF TURKEY	6.7500	2040/05/30	100	87	9,848
	REPUBLIC OF TURKEY	6.6250	2045/02/17	200	170	19,171
	REPUBLIC OF TURKEY	5.7500	2047/05/11	200	152	17,235
	ROMANIA	6.7500	2022/02/07	70	75	8,479
	ROMANIA	4.3750	2023/08/22	50	49	5,619
	ROMANIA	4.8750	2024/01/22	30	30	3,442
	ROMANIA	6.1250	2044/01/22	30	32	3,625
	RUSSIAN FEDERATION	5.0000	2020/04/29	200	203	22,915
	RUSSIAN FEDERATION	4.8750	2023/09/16	200	203	22,932
	RUSSIAN FEDERATION	4.7500	2026/05/27	200	195	22,071
	RUSSIAN FEDERATION	7.5000	2030/03/31	124	135	15,264
	RUSSIAN FEDERATION	5.2500	2047/06/23	400	364	41,093
	UNITED MEXICAN STATES	4.0000	2023/10/02	110	107	12,145
	UNITED MEXICAN STATES	3.6000	2025/01/30	200	188	21,227
	UNITED MEXICAN STATES	4.1500	2027/03/28	200	189	21,348
	UNITED MEXICAN STATES	6.7500	2034/09/27	100	113	12,745
	UNITED MEXICAN STATES	6.0500	2040/01/11	100	103	11,605
	UNITED MEXICAN STATES	4.7500	2044/03/08	200	175	19,717
	UNITED MEXICAN STATES	5.5500	2045/01/21	100	97	11,013
	UNITED MEXICAN STATES	4.6000	2046/01/23	200	171	19,266
	UNITED MEXICAN STATES	5.7500	2110/10/12	90	81	9,212
合計		—	—	—	—	966,387

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	966,387	97.1
コール・ローン等、その他	28,865	2.9
投資信託財産総額	995,253	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円です。

(注2) 外貨建純資産（992,826千円）の投資信託財産総額（995,253千円）に対する比率は99.8%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	997,324,300円
コール・ローン等	15,156,958
公社債(評価額)	966,387,788
未収入金	2,110,555
未収利息	13,352,115
前払費用	316,884
(B)負債	2,182,876
未払金	2,093,042
未払解約金	89,792
その他未払費用	42
(C)純資産総額(A-B)	995,141,424
元本	1,012,672,810
次期繰越損益金	△ 17,531,386
(D)受益権総口数	1,012,672,810口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,827円

(注1) 設定元本額 1,000,000,000円
期中追加設定元本額 20,717,858円
期中一部解約元本額 8,045,048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。
ニッセイ新興国債券インデックスファンド
(適格機関投資家限定) 997,054,316円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
パランスファンド(8資産均等型) 15,618,494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17,531,386円です。

損益の状況

当期(2018年1月30日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	41,471,739円
受取利息	41,477,904
支払利息	△ 6,165
(B)有価証券売買損益	△58,460,283
売買益	34,116,625
売買損	△92,576,908
(C)信託報酬等	△ 182,332
(D)当期損益金(A+B+C)	△17,170,876
(E)追加信託差損益金	△ 569,111
(F)解約差損益金	208,601
(G)合計(D+E+F)	△17,531,386
次期繰越損益金(G)	△17,531,386

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイJ-R E I T インデックスマザーファンド

運用報告書

第 23 期

(計算期間：2018年5月15日～2018年11月12日)

運用方針	<p>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。</p> <p>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。</p>	運用方法	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none">・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。
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		



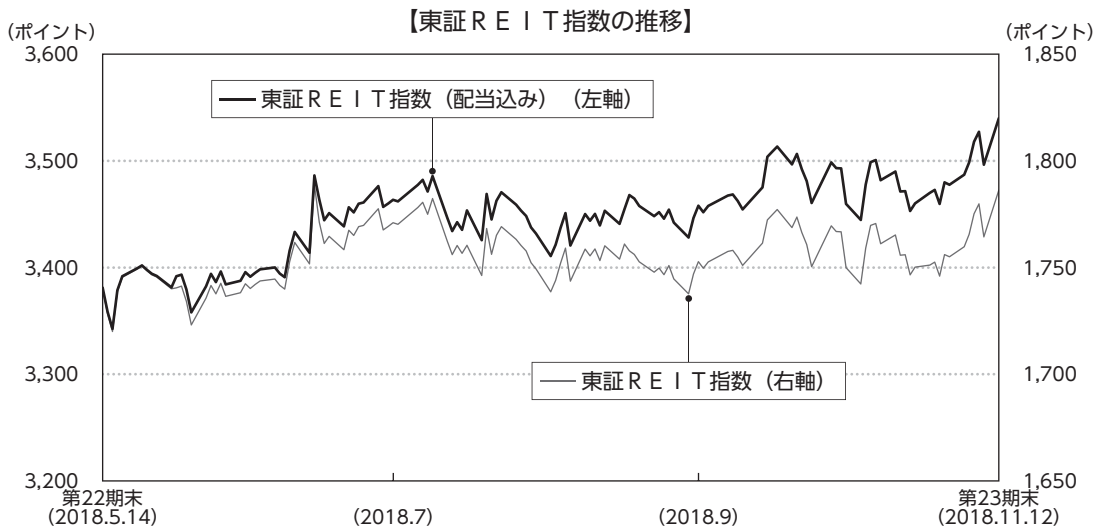
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月15日～2018年11月12日

Jリート市況

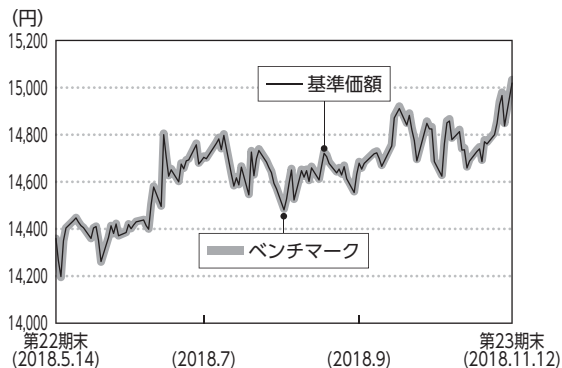


(注) 各指数は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期のJリート市場は上昇しました。

期初のJリート市場は、長期金利が引き続き低水準で推移したことに加え、東京都心部におけるオフィス空室率の低下や賃料上昇が続く良好な外部環境を背景に上昇しました。その後は、日銀の黒田総裁が長期金利の上昇を容認する発言をしたことや、相次ぐエクイティファイナンスによる需給環境の悪化懸念を受けてJリート市場は上値が重くなる場面もありました。しかし、引き続き堅調な不動産市況を背景としたJリート各社の着実な分配金成長や、Jリートによる自己投資口の取得、資産入れ替えなどの投資主価値の向上に資する取り組みが評価されたことでJリート市場は再び上昇基調に転じ、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

当期の基準価額は、Jリート市場が上昇したことを受けて上昇しました。

期初のJリート市場は、長期金利が引き続き低水準で推移したことに加え、東京都心部におけるオフィス空室率の低下や賃料上昇が続く良好な外部環境を背景に上昇しました。その後は、日銀の黒田総裁が長期金利の上昇を容認する発言をしたことや、相次ぐエクイティファイナンス（新株発行を伴う資金調達）による需給環境の悪化懸念を受けてJリート市場は上値が重くなる場面もありました。しかし、

引き続き堅調な不動産市況を背景としたJリート各社の着実な分配金成長や、Jリートによる自己投資口の取得、資産入れ替えなどの投資主価値の向上に資する取り組みが評価されたことでJリート市場は再び上昇基調に転じ、基準価額も同様に推移しました。

(注) ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。東証REIT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・ノウハウおよび東証REIT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。また、株式会社東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の正確性、完全性を保証するものではなく、その算出・公表の誤謬・遅延等に関して責任を負いません。株式会社東京証券取引所は、当商品に関する義務を持たず、当商品の運用成績に関して一切責任を有しません。以下同じです。

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+4.6%となり、ベンチマーク騰落率（+4.7%）にほぼ連動しました。

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	ベンチマーク		投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		期中 騰落率	期中 騰落率		
	円	%	%	%	百万円
19期 (2016年11月14日)	13,340	△ 8.6	12,986 △ 8.7	98.7	17,444
20期 (2017年 5月12日)	13,941	4.5	13,574 4.5	98.7	14,573
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

(注) ベンチマークは東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）で、設定時を10,000として指数化しています。東証ＲＥＩＴ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・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ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。また、株式会社東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の正確性、完全性を保証するものではなく、その算出・公表の誤謬・遅延等に関して責任を負いません。株式会社東京証券取引所は、当商品に関する義務を持たず、当商品の運用成績に関して一切責任を有しません。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	ベンチマーク		投資信託証券 組入比率
		騰落率	騰落率	
	円	%	%	%
(期首) 2018年 5月14日	14,359	－	13,977 ー	98.4
5月末	14,352	△0.0	13,970 △0.1	98.7
6月末	14,651	2.0	14,265 2.1	98.6
7月末	14,726	2.6	14,339 2.6	98.4
8月末	14,678	2.2	14,293 2.3	97.8
9月末	14,911	3.8	14,523 3.9	98.4
10月末	14,686	2.3	14,302 2.3	98.4
(期末) 2018年11月12日	15,019	4.6	14,633 4.7	98.4

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2018年5月15日～2018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)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	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（14,635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5月15日～2018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
日本アコモデーションファンド投資法人	0.031	15,796	0.044	22,641
MCUBS Midcity投資法人	0.101	8,479	0.126	10,345
森ヒルズリート投資法人	0.229	32,299	0.133	18,674
産業ファンド投資法人	0.105	12,407	0.146	17,431
アドバンス・レジデンス投資法人	0.146	42,104	0.090	25,748
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.189	31,640	0.046	7,652
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.076	37,425	0.042	20,820
GLP投資法人	0.882	100,451	0.188	22,121
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.034	9,011	0.045	11,685
日本プロロジスリート投資法人	0.118	26,605	0.157	35,472
星野リゾート・リート投資法人	0.014	7,825	0.032	18,067
Oneリート投資法人	0.077	18,885	0.011	2,789
イオンリート投資法人	0.203	24,849	0.094	11,378
ヒューリックリート投資法人	0.286	47,422	0.064	10,828
日本リート投資法人	0.121	40,445	0.027	9,214
国内 インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	0.528	8,320	0.702	10,837
日本ヘルスケア投資法人	0.006	1,045	0.013	2,175
積水ハウス・リート投資法人	0.277	19,988	0.235	16,875
トーセイ・リート投資法人	0.075	8,276	0.021	2,366
ケネディクス商業リート投資法人	0.032	7,740	0.042	10,144
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.025	2,852	0.012	1,328
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.061	5,673	0.017	1,605
野村不動産マスターファンド投資法人	0.263	40,304	0.377	58,481
いちごホテルリート投資法人	0.044	6,165	0.015	2,057
ラサールロジポート投資法人	0.067	7,132	0.098	10,624
スターアジア不動産投資法人	0.161	17,186	0.024	2,573
マリモ地方創生リート投資法人	0.016	1,829	0.008	908
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.015	4,969	0.059	19,038
大江戸温泉リート投資法人	0.014	1,213	0.034	2,909
さくら総合リート投資法人	0.023	2,085	0.079	7,178
投資法人みらい	0.289	54,602	0.018	3,449
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.046	6,831	0.020	2,969

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
	千口	千円	千口	千円
三菱地所物流リート投資法人	0.032	7,967	0.011	2,930
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.008	881	0.012	1,330
ザイマックス・リート投資法人	0.008	906	0.012	1,360
タカラレーベン不動産投資法人	0.292	26,672	0.002	178
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.301	28,607	0.001	95
日本ビルファンド投資法人	0.087	55,504	0.127	78,860
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.089	51,944	0.121	69,924
日本リテールファンド投資法人	0.167	34,005	0.242	49,090
オリックス不動産投資法人	0.177	30,940	0.242	42,009
日本プライムリアルティ投資法人	0.056	22,550	0.079	31,448
プレミア投資法人	0.141	16,029	0.086	9,597
東急リアル・エステート投資法人	0.060	9,249	0.087	13,149
グローバル・ワン不動産投資法人	0.057	6,446	0.075	8,386
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.196	33,962	0.287	49,246
森トラスト総合リート投資法人	0.063	10,167	0.092	14,761
インヴィンシブル投資法人	1	79,371	0.263	12,815
フロンティア不動産投資法人	0.030	13,341	0.044	19,624
平和不動産リート投資法人	0.055	6,023	0.081	8,767
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.058	12,892	0.098	21,256
福岡リート投資法人	0.044	7,580	0.066	11,411
ケネディクス・オフィス投資法人	0.057	39,013	0.036	24,498
いちごオフィスリート投資法人	0.151	13,703	0.075	6,671
大和証券オフィス投資法人	0.045	30,438	0.024	15,871
阪急阪神リート投資法人	0.038	5,284	0.098	13,213
スターツプロシード投資法人	0.014	2,349	0.020	3,312
大和ハウスリート投資法人	0.236	63,254	0.113	29,993
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.259	21,341	0.360	29,608
日本賃貸住宅投資法人	0.101	9,018	0.148	13,211
ジャパンエクセレント投資法人	0.080	11,674	0.117	16,743

(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

2018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	口数	評価額
	千口	千口	千口	千円
日本アコモデーションファンド投資法人	0.658	0.645		337,980
MCUBS MidCity投資法人	2	2		190,619
森ヒルズリート投資法人	2	2		309,942
産業ファンド投資法人	2	2		255,606
アドバンス・レジデンス投資法人	1	1		562,383
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1		198,662
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.896	0.930		451,050
GLP投資法人	4	4		541,268
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.751	0.740		202,908
日本プロロジスリート投資法人	2	2		622,398
星野リゾート・リート投資法人	0.313	0.295		158,415
Oneリート投資法人	0.217	0.283		71,514
イオンリート投資法人	1	1		251,662
ヒューリックリート投資法人	1	1		257,779
日本リート投資法人	0.532	0.626		230,994
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	11	11		186,431
日本ヘルスケア投資法人	0.096	0.089		15,379
積水ハウス・リート投資法人	4	5		354,424
トーセイ・リート投資法人	0.319	0.373		40,731
ケネディクス商業リート投資法人	0.721	0.711		171,990
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.244	0.257		28,861
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.344	0.388		34,997
野村不動産マスターファンド投資法人	5	5		843,525
いちごホテルリート投資法人	0.310	0.339		45,934
ラサールロジポート投資法人	1	1		156,648
スターアジア不動産投資法人	0.465	0.602		64,052
マリモ地方創生リート投資法人	0.159	0.167		18,203
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.375	0.331		110,719
大江戸温泉リート投資法人	0.333	0.313		27,199
さくら総合リート投資法人	0.476	0.420		37,128
投資法人みらい	0.252	0.523		96,127
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.429	0.455		63,563

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	
	□数	□数	評価額
	千□	千□	千円
三菱地所物流リート投資法人	0.184	0.205	51,967
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.198	0.194	20,602
ザイマックス・リート投資法人	0.183	0.179	20,459
タカラレーベン不動産投資法人	－	0.290	26,042
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	－	0.300	27,510
日本ビルファンド投資法人	1	1	1,275,841
ジャパンリアルエステイト投資法人	1	1	1,181,460
日本リテールファンド投資法人	3	3	786,938
オリックス不動産投資法人	3	3	685,828
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	510,234
プレミア投資法人	1	1	226,566
東急リアル・エステート投資法人	1	1	209,981
グローバル・ワン不動産投資法人	1	1	143,096
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	4	759,094
森トラスト総合リート投資法人	1	1	225,387
インヴィンシブル投資法人	5	6	315,009
フロンティア不動産投資法人	0.674	0.660	291,720
平和不動産リート投資法人	1	1	137,832
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	1	292,352
福岡リート投資法人	1	1	170,309
ケネディクス・オフィス投資法人	0.579	0.600	435,000
いちごオフィスリート投資法人	1	1	150,696
大和証券オフィス投資法人	0.427	0.448	323,008
阪急阪神リート投資法人	0.865	0.805	117,127
スターツプロシード投資法人	0.312	0.306	51,622
大和ハウスリート投資法人	2	2	601,663
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5	5	451,687
日本賃貸住宅投資法人	2	2	196,380
ジャパンエクセレント投資法人	1	1	258,291
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	100 59	103 61 16,882,809 <98.4%>

(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) □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

2018年11月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託証券	16,882,809	97.9%
コール・ローン等、その他	369,033	2.1%
投資信託財産総額	17,251,842	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

(2018年11月12日現在)

項目	当期末
(A) 資産	17,251,842,891円
コール・ローン等	230,903,384
投資信託証券(評価額)	16,882,809,810
未収配当金	138,129,697
(B) 負債	90,041,164
未払解約金	90,037,790
その他未払費用	3,374
(C) 純資産総額(A-B)	17,161,801,727
元本	11,426,849,852
次期繰越損益金	5,734,951,875
(D) 受益権総口数	11,426,849,852口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,019円

- (注1) 期首元本額 11,429,877,864円
 期中追加設定元本額 2,233,455,774円
 期中一部解約元本額 2,236,483,786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) 1,702,150,409円
 DCニッセイJ-REITインデックスファンド 1,003,304,088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 5,914,261,020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) 1,915,555,173円
 DCニッセイJ-REITインデックスファンドA 620,233,028円
 DCニッセイJ-REITインデックスファンドB 241,557,627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) 15,836,477円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) 1,916,821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) 693,887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) 999,147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) 10,342,175円

損益の状況

当期(2018年5月15日~2018年11月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	319,081,043円
受取配当金	319,155,884
受取利息	1,723
その他収益	4
支払利息	△ 76,568
(B) 有価証券売買損益	434,329,609
売却益	654,013,885
売却損	△ 219,684,276
(C) 信託報酬等	△ 16,768
(D) 当期損益金(A+B+C)	753,393,884
(E) 前期繰越損益金	4,982,451,344
(F) 追加信託差損益金	1,034,827,316
(G) 解約差損益金	△ 1,035,720,669
(H) 合計(D+E+F+G)	5,734,951,875
次期繰越損益金(H)	5,734,951,875

- (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 1 期

(計算期間：2017年9月28日～2018年11月20日)

運用方針

主に日本を除く世界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REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）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

日本を除く世界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。



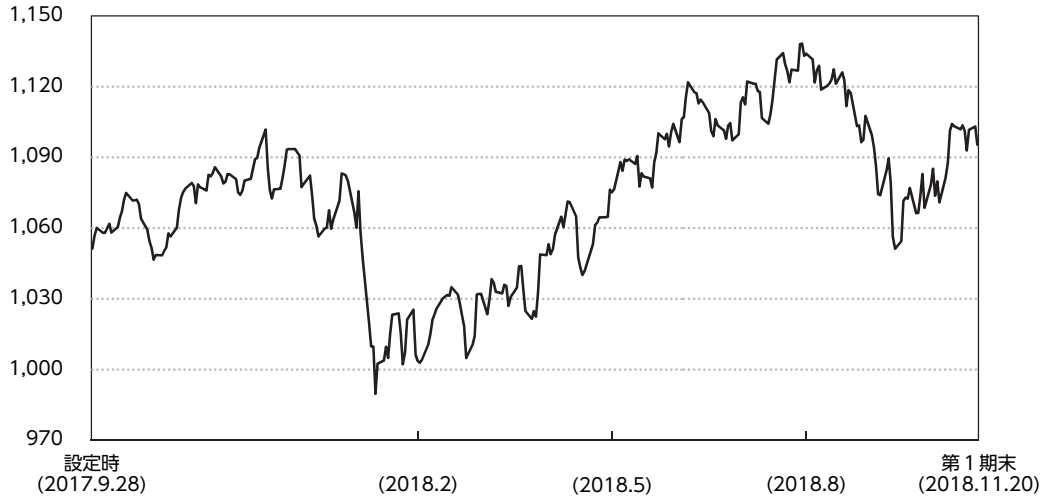
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過 2017年9月28日～2018年11月20日

先進国リート市況

【S & P先進国REITインデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】



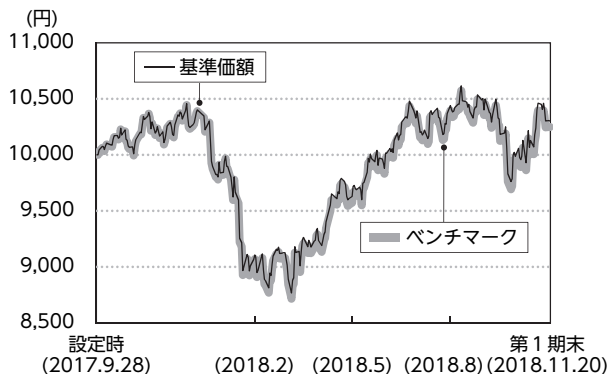
(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の先進国REIT市場は、設定時より堅調な米株式市場とともに上昇して始まりました。

1月中旬以降は、中国による米国債の購入制限・停止などの報道や、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げペースを早めるとの警戒感から米株式市場が急落したことを受けて、先進国リート市場も下落しました。

期末にかけては、米中貿易摩擦問題やイギリスの欧州連合（EU）離脱交渉に対する不透明感等のリスク要因はあったものの、米長期金利が低下（債券価格は上昇）したことなどを背景に、先進国リート市場は上昇基調となりました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、設定時より堅調な米株式市場に連動するかたちで先進国リート市場が推移したことから、上昇して始まりました。1月中旬以降は、中国による米国債の購入制限・停止などの報道を受けて為替が円高で推移したことや、F R Bが利上げペースを早めるとの警戒感から米株式市場が急落したことを受けて、基準価額は下落しました。その後、期末にかけては、米中貿易摩擦問題やイギリスのEU離脱交渉に対する不透明感等のリスク要因はあったものの、米長期金利が低下したことなどを背景に先進国リート市場が上昇基調となったことから、基準価額は上昇して当期末を迎えました。

(注) ベンチマークは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）で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。S & P先進国REITインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）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SPDJ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、SPDJ、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。以下同じです。

ポートフォリオ

日本を除く世界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）している先進国のリート（不動産投資信託）に投資することにより、ベンチマークに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+3.0%となり、ベンチマーク騰落率（+2.5%）におおむね連動しました。

今後の運用方針

日本を除く世界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）している先進国のリートに投資することにより、ベンチマーク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		ベンチマーク		株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
(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

(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) ベンチマークは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)で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。S & P先進国REITインデックス(除く日本)はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJ I」)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SPDJ I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、SPDJ I、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。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		ベンチマーク		株式組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率		
(設定日)2017年9月28日	円	%		%	%	%
9月末	10,045	0.5	10,034	0.3	0.2	94.6
10月末	10,010	0.1	9,995	△ 0.1	0.2	98.3
11月末	10,190	1.9	10,174	1.7	0.0	98.0
12月末	10,402	4.0	10,391	3.9	0.0	98.1
2018年1月末	9,625	△ 3.8	9,598	△ 4.0	0.0	97.6
2月末	8,971	△ 10.3	8,930	△ 10.7	0.0	98.3
3月末	9,129	△ 8.7	9,075	△ 9.2	0.0	98.1
4月末	9,402	△ 6.0	9,347	△ 6.5	0.0	97.9
5月末	9,748	△ 2.5	9,701	△ 3.0	0.0	97.0
6月末	10,131	1.3	10,084	0.8	0.0	97.7
7月末	10,168	1.7	10,120	1.2	0.0	98.1
8月末	10,484	4.8	10,446	4.5	0.0	97.1
9月末	10,359	3.6	10,302	3.0	—	97.8
10月末	10,216	2.2	10,147	1.5	—	98.3
(期末)2018年11月20日	10,304	3.0	10,249	2.5	—	98.3

(注) 騰落率は設定日比です。

1万口当たりの費用明細

2017年9月28日～2018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)	4円 0	0.038% 0.000	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(4)	(0.038)	
有価証券取引税 (投資信託証券)	5 (5)	0.051 (0.051)	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)	19 (11)	0.190 (0.112)	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)	(8)	(0.078)	・ 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	28	0.279	

(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（9,936円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年9月28日～2018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
		7	33	-	-
		(△ 7)	(△ 33)		
	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
		32	4	32	5

(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	2	304	-	-
ACADIA REALTY TRUST	1	37	-	-
AGREE REALTY CORP	0.445	21	-	-
ALEXANDER'S INC	0.059	25	-	-
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	212	0.072	8
PROLOGIS INC	9	575	0.290	19
	(1)			
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	106	-	-
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4	32	1	8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	410	0.137	25
BRANDYWINE REALTY TRUST	2	47	-	-
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	138	0.119	10
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	10	62	4	12
CEDAR REALTY TRUST INC	1	6	-	-
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	104	-	-
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	51	-	-
COUSINS PROPERTIES INC	6	61	-	-
SITE CENTERS CORP	4	43	-	-
	(△ 2)			
DUKE REALTY CORP	5	166	-	-
EASTGROUP PROPERTIES	0.533	46	-	-
EPR PROPERTIES	1	78	-	-
EQUITY RESIDENTIAL	6	405	0.330	22
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	266	0.043	10
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	143	-	-
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1	55	-	-
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	0.874	9	0.874	9
GGP INC	10	208	-	-
	(△ 10)			
GETTY REALTY CORP	0.508	14	-	-
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.430	9	-	-
HCP INC	8	218	0.475	13
WELLTOWER INC	6	432	0.268	18
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1	61	-	-
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.611	11	-	-
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	83	-	-
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2	72	-	-
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	235	-	-

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
EQUITY COMMONWEALTH	1	58	0.887	27
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1	11	—	—
ISTAR FINANCIAL INC	3	35	3	34
KILROY REALTY CORP	1	113	—	—
KIMCO REALTY CORP	6	131	—	—
LEXINGTON REALTY TRUST	3	34	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	93	—	—
LTC PROPERTIES INC	0.615	28	—	—
MACERICH CO/THE	1	93	—	—
MACK-CALI REALTY CORP	1	43	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	195	0.089	8
MONMOUTH REIT -CL A	1	18	—	—
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.637	48	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3	100	—	—
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.246	6	—	—
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	22	—	—
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.309	41	—	—
PUBLIC STORAGE	2	530	0.164	34
外 RPT REALTY	1	16	—	—
国 REGENCY CENTERS CORP	2	178	0.196	12
SAUL CENTERS INC	0.186	11	—	—
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	70	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	5	835	0.234	42
SL GREEN REALTY CORP	1	155	—	—
LIFE STORAGE INC	0.723	58	—	—
SUN COMMUNITIES INC	1	127	0.155	15
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	36	—	—
TAUBMAN CENTERS INC	0.943	47	—	—
UDR INC	4	165	—	—
UMH PROPERTIES INC	0.479	7	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.194	14	—	—
VENTAS INC	6	384	0.313	18
VORNADO REALTY TRUST	2	224	—	—
WP CAREY INC	1	119	0.135	8
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1	39	—	—
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1	58	—	—
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1	50	—	—
REALTY INCOME CORP	4	279	0.315	19
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	118	0.092	8

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	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
KITE REALTY GROUP TRUST	1	30	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	163	—	—
CUBESMART	2	76	0.307	9
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	396	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2	93	—	—
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3	33	—	—
EDUCATION REALTY TRUST INC	1	40	1	47
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	72	—	—
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3	56	—	—
URSTADT BIDDLE - CL A	0.462	10	—	—
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	17	—	—
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	1	83	—	—
	(△ 1)			
DOUGLAS EMMETT INC	2	97	—	—
IRON MOUNTAIN INC	4	183	—	—
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	45	—	—
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	79	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	38	—	—
外 CHESAPEAKE LODGING TRUST	0.934	25	—	—
国 TERRENO REALTY CORP	0.813	29	—	—
CORESITE REALTY CORP	0.567	61	—	—
RLJ LODGING TRUST	3	68	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.644	25	—	—
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1	32	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	0.958	20	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	1	39	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1	25	—	—
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1	32	—	—
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3	46	—	—
VEREIT	15	124	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3	94	—	—
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	82	—	—
SELECT INCOME REIT	1	23	—	—
WHITESTONE REIT	0.599	7	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.942	61	—	—
CORECIVIC INC	2	64	—	—
GEO GROUP INC/THE	2	55	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3	85	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	0.698	9	0.698	10

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
GRAMERCY PROPERTY TRUST	2	78	2	73
CYRUSONE INC	1	104	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	2	48	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	38	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7	59	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1	40	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	127	—	—
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	11	—	—
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	93	—	—
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.870	44	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	40	—	—
STARWOOD WAYPOINT HOMES	1	72	—	—
	(△ 1)			
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	42	—	—
CARETRUST REIT INC	1	22	—	—
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1	12	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	0.508	9	—	—
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	11	—	—
外 STORE CAPITAL CORP	2	72	—	—
国 PARAMOUNT GROUP INC	3	50	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	1	40	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.677	14	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1	34	—	—
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.688	16	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.298	6	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	61	—	—
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.376	3	—	—
CITY OFFICE REIT INC	0.423	5	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	1	40	—	—
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	16	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.951	23	—	—
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.390	18	—	—
FOREST CITY REALTY TRUST- A	4	121	0.713	18
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.266	7	—	—
FARMLAND PARTNERS INC	3	23	2	13
MANULIFE US REAL ESTATE INV	14	13	—	—
		(△0.372)		
TIER REIT INC	0.743	14	—	—
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	2	13	2	10

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	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
PARKWAY INC	0.673	15	0.673	12
QUALITY CARE PROPERTIES	1	22	1	30
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	0.494	5	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	3	93	—	—
COLONY CAPITAL INC	11	123	1	11
INVITATION HOMES INC	1	31	—	0.016
	(3)			
JBG SMITH PROPERTIES	1	53	—	—
ALEXANDER & BALDWIN INC	0.191	4	1	26
	(1)	(41)		
CLIPPER REALTY INC	1	16	0.776	10
		(△0.011)		
GLADSTONE LAND CORP	0.168	2	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1	12	—	—
INFREIT INC	0.605	13	—	—
VICI PROPERTIES INC	1	23	—	—
AMERICOLD REALTY TRUST	0.888	17	—	—
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	0.305	6	—	—
外国 SPIRIT MTA REIT	1	13	0.886	9
	(0.712)			
RETAIL VALUE INC	0.318	10	—	0.003
	(0.237)			
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	—	3	76
	(3)	(△ 119)		
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	0.491	5	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.080	3	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.300	11	—	—
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	29	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	61	—	—
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.500	23	—	—
	(△0.500)	(△ 23)		
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1	18	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	0.500	10	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2	46	—	—
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	0.300	4	0.300	3
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	0.300	6	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	57	—	—
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	0.700	27	—	—

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
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1	14	—	—
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	0.600	8	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	0.600	6	—	—
Dream Global Real Estate Investment Trust	1	14	—	—
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	0.600	4	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.300	14	—	—
CHOICE PROPERTIES REIT	0.700	9	—	—
	(1)	(9)		
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.200	3	—	—
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	14	2	18
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	0.400	5	—	—
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	0.400	3	—	—
SLATE RETAIL REIT	0.300	4	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	0.500	6	—	—
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.200	2	—	—
SLATE OFFICE REIT	0.400	3	—	—
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	0.400	2	—	—
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	16	161	—	—
外 国 (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
GPT GROUP	29	148	—	—
GOODMAN GROUP	26	222	—	—
STOCKLAND	39	168	—	—
WESTFIELD CORP	30	235	30	269
BWP TRUST	7	22	—	—
MIRVAC GROUP	62	142	—	—
INVESTA OFFICE FUND	7	34	—	—
CHARTER HALL RETAIL REIT	5	20	—	—
ABACUS PROPERTY GROUP	5	18	—	—
VICINITY CENTRES	53	140	—	—
CHARTER HALL GROUP	7	38	—	—
CROMWELL PROPERTY GROUP	24	23	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	11	25	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	3	12	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	3	8	—	—
GDI PROPERTY GROUP	7	8	—	—
INDUSTRIA REIT	1	3	—	—
NATIONAL STORAGE REIT	7	11	—	—
SCENTRE GROUP	88	344	—	—
ARENA REIT	4	9	—	—

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
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	3	9	—	—
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	2	7	—	—
VIVA ENERGY REIT	6	14	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	2	10	—	—
PROPERTYLINK GROUP	7	7	—	—
RURAL FUNDS GROUP	3	8	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	31	169	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	35	2,238	—	—
PROSPERITY REIT	18	59	—	—
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17	83	17	83
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	15	77	15	72
FORTUNE REIT	21	191	—	—
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	14	49	14	56
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	37	100	—	—
		(△0.639)		
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40	66	—	—
		(△0.048)		
CAPITALAND MALL TRUST	41	84	—	—
KEPPEL REIT	27	32	—	—
		(△0.019)		
SUNTEC REIT	34	64	—	—
		(△0.576)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	31	39	—	—
		(△0.237)		
STARHILL GLOBAL REIT	21	15	18	12
		(△0.063)		
ASCOTT RESIDENCE TRUST	19	23	—	—
		(△0.617)		
FRASERS COMMERCIAL TRUST	9	12	9	12
		(△0.248)		
FRASERS CENTREPOINT TRUST	8	18	8	18
ESR REIT	17	9	—	—
		(△0.050)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	11	18	—	—
		(△0.073)		
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	8	13	—	—
		(△0.071)		

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
(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
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	8	12 (△0.055)	—	—
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	8	11 (△0.416)	—	—
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	29	12 (△0.447)	—	—
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	6	15 (△0.181)	4	11
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	18	33 (△0.045)	6	12
CACHE LOGISTICS TRUST	16	13 (△0.021)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	29	44	—	—
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	11	9 (△0.171)	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	13	8	—	—
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	12	5	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	35	40 (△0.728)	—	—
外国 SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	9	6	—	—
SPH REIT	9	9	—	—
OUE HOSPITALITY TRUST	17	13	—	—
KEPPEL DC REIT	11	14	9	12
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	17	18 (△0.441)	12	12
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	22	29	—	—
(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
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	15	19	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	15	20	—	—
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	5	11	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD	12	13	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	5	9	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	16	97	—	—
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
HAMMERSON PLC	12	68	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	12	120	—	—
SEGRO PLC	16	87	—	—
WORKSPACE GROUP PLC	1	16	—	—
INTU PROPERTIES PLC	29	55	6	12

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	
	□数	金額	□数	金額
(イギリス)	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	9	11	—	—
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5	30	—	—
	(△0.700)	(△ 4)		
SHAFTESBURY PLC	3	38	—	—
BIG YELLOW GROUP PLC	2	17	—	—
DERWENT LONDON PLC	1	47	—	—
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	8	4	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	10	17	—	—
HANSTEEN HOLDINGS PLC	12	17	—	—
		(△ 4)		
RDI REIT PLC	19	7	—	—
TRITAX BIG BOX REIT PLC	21	30	—	—
SAFESTORE HOLDINGS PLC	3	13	—	—
ASSURA PLC	37	22	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	8	9	—	—
REGIONAL REIT LTD	4	4	—	—
CAPITAL & REGIONAL PLC	8	4	—	—
NEWRIVER REIT PLC	4	16	—	—
外 UNITE GROUP PLC	4	28	—	—
国 CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	3	3	—	—
LXI REIT PLC	2	2	—	—
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	1	1	1	1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	3	2	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	2	35	2	37
(イスラエル)		千イスラエル・シケル		千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	10	16	10	14
(ユーロ/アイルランド)		千ユーロ		千ユーロ
GREEN REIT PLC	10	16	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	5	8	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	0.626	24	—	—
(ユーロ/オランダ)				
EUROCOMMERCIAL-CVA	0.759	27	—	—
VASTNED RETAIL NV	0.245	9	—	—
NSI NV	0.282	9	—	—
NSI NV	0.305	32	0.305	32
(ユーロ/ベルギー)				
RETAIL ESTATES	0.098	7	—	—
BEFIMMO S.C.A.	0.358	18	0.358	17
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	0.245	5	—	—

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
(ユーロ/ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.251	23	—	—
AEDIFICA	0.279	21	—	—
RETAIL ESTATES-RTS	—	—	0.098	—
	(0.098)			
COFINIMMO SA - RTS	—	—	0.305	—
	(0.305)			
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	—	—	—	—
	(0.245)			
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	2	435	—	—
	(△ 2)			
(ユーロ/フランス)				
KLEPIERRE	3	110	—	—
GECINA SA	0.784	107	—	—
COVIVIO	0.826	70	—	—
MERCIALYS	0.857	14	—	—
ICADE	0.700	52	—	—
ALTAREA	0.057	11	—	—
		(△0.557)		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.034	6	—	—
	(2)			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	23	—	—
		(△ 1)		
(ユーロ/ドイツ)				
HAMBORNER REIT AG	1	11	—	—
HAMBORNER REIT AG	1	11	—	—
		(△0.430)		
(ユーロ/スペイン)				
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	5	61	—	—
		(△ 1)		
AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	1	17	—	—
	(△ 1)			
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	1	26	1	30
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	4	39	—	0.000
	(1)			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	15	11	—	—
(ユーロ/イタリア)				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6	9	—	0.001
	(△ 5)			
IMMOBILIARE GRANDE DIST-RTS	—	—	0.556	—
	(0.556)			

(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

2017年9月28日～2018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
ALEXANDER & BALDWIN INC	0.718	3,735	5,202	INVESTORE PROPERTY LTD	3	378	116
INVESTORE PROPERTY LTD	3	354	108	—	—	—	—

(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

2018年11月20日現在

外国（外貨建）投資信託証券

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
BOSTON PROPERTIES INC	2	313	35,358
ACADIA REALTY TRUST	1	36	4,166
AGREE REALTY CORP	0.445	26	2,934
ALEXANDER'S INC	0.059	18	2,088
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	210	23,742
PROLOGIS INC	10	697	78,634
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	112	12,632
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3	15	1,750
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	412	46,453
BRANDYWINE REALTY TRUST	2	38	4,358
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	129	14,556
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6	17	1,952
CEDAR REALTY TRUST INC	1	4	478
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	123	13,938
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	38	4,303
COUSINS PROPERTIES INC	6	54	6,130
SITE CENTERS CORP	2	26	3,016
DUKE REALTY CORP	5	166	18,713
EASTGROUP PROPERTIES	0.533	52	5,967
EPR PROPERTIES	1	80	9,084
EQUITY RESIDENTIAL	5	408	46,063
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	264	29,802

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	当期末			
	□数	評価額		
		外貨建金額	千米ドル	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千円	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	150	16,982	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1	59	6,686	
GETTY REALTY CORP	0.508	14	1,663	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.430	8	930	
HCP INC	7	215	24,308	
WELLTOWER INC	6	422	47,649	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1	56	6,365	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.611	10	1,235	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	70	7,899	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2	67	7,596	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	242	27,365	
EQUITY COMMONWEALTH	1	32	3,625	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1	10	1,133	
KILROY REALTY CORP	1	110	12,427	
KIMCO REALTY CORP	6	106	11,970	
LEXINGTON REALTY TRUST	3	28	3,191	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	100	11,288	
LTC PROPERTIES INC	0.615	27	3,123	
MACERICH CO/THE	1	84	9,499	
MACK-CALI REALTY CORP	1	40	4,610	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	179	20,220	
MONMOUTH REIT -CL A	1	17	1,938	
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.637	47	5,399	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3	113	12,760	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.246	6	726	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	17	1,941	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.309	42	4,781	
PUBLIC STORAGE	2	498	56,219	
RPT REALTY	1	16	1,885	
REGENCY CENTERS CORP	2	170	19,206	
SAUL CENTERS INC	0.186	10	1,132	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	50	5,699	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4	928	104,592	
SL GREEN REALTY CORP	1	143	16,127	
LIFE STORAGE INC	0.723	70	7,972	
SUN COMMUNITIES INC	1	134	15,116	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	34	3,925	
TAUBMAN CENTERS INC	0.943	49	5,580	
UDR INC	4	181	20,450	
UMH PROPERTIES INC	0.479	6	705	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.194	13	1,508	

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	当期末		
	□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
VENTAS INC	5	352	39,741
VORNADO REALTY TRUST	2	210	23,698
WP CAREY INC	1	110	12,467
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1	34	3,883
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1	52	5,864
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1	60	6,797
REALTY INCOME CORP	4	293	33,060
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	128	14,444
KITE REALTY GROUP TRUST	1	25	2,842
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	196	22,153
CUBESMART	2	79	9,003
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	389	43,837
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2	89	10,067
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3	32	3,673
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	93	10,589
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3	53	6,001
URSTADT BIDDLE - CL A	0.462	9	1,066
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	12	1,441
DOUGLAS EMMETT INC	2	88	9,917
IRON MOUNTAIN INC	4	165	18,657
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	42	4,771
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	73	8,277
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	38	4,283
CHESAPEAKE LODGING TRUST	0.934	27	3,052
TERRENO REALTY CORP	0.813	31	3,603
CORESITE REALTY CORP	0.567	53	6,011
RLJ LODGING TRUST	3	61	6,895
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.644	25	2,895
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1	30	3,413
CHATHAM LODGING TRUST	0.958	18	2,122
STAG INDUSTRIAL INC	1	37	4,280
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1	17	1,982
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1	15	1,785
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3	43	4,886
VEREIT	15	114	12,855
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3	85	9,645
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	74	8,395
SELECT INCOME REIT	1	19	2,171
WHITESTONE REIT	0.599	8	944
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.942	70	7,994
CORECIVIC INC	2	53	6,056

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	当期末			
	□数	評価額		
		外貨建金額	千円	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千円	
GEO GROUP INC/THE	2	47	5,315	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3	77	8,694	
CYRUSONE INC	1	97	10,979	
PHYSICIANS REALTY TRUST	2	46	5,186	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	44	4,966	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7	54	6,185	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1	30	3,449	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	117	13,203	
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	10	1,171	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	76	8,649	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.870	33	3,777	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	40	4,612	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	33	3,747	
CARETRUST REIT INC	1	22	2,565	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1	12	1,416	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	0.508	7	861	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	6	766	
STORE CAPITAL CORP	2	83	9,383	
PARAMOUNT GROUP INC	3	44	5,051	
URBAN EDGE PROPERTIES	1	32	3,711	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.677	11	1,336	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1	33	3,719	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.688	19	2,160	
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.298	10	1,186	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	51	5,750	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.376	3	353	
CITY OFFICE REIT INC	0.423	4	522	
GLOBAL NET LEASE INC	1	40	4,586	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	20	2,323	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.951	25	2,873	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.390	14	1,609	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	4	104	11,742	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.266	7	882	
FARMLAND PARTNERS INC	1	8	975	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	14	11	1,309	
TIER REIT INC	0.743	17	1,917	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	0.494	3	412	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	3	100	11,357	
COLONY CAPITAL INC	9	56	6,326	
INVITATION HOMES INC	4	96	10,849	
JBG SMITH PROPERTIES	1	62	7,095	
CLIPPER REALTY INC	0.655	8	965	

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	当期末			
	□数	評価額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千□	千米ドル		
GLADSTONE LAND CORP	0.168	2		244
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1	12		1,411
INFRAREIT INC	0.605	12		1,445
VICI PROPERTIES INC	1	23		2,657
AMERICOLD REALTY TRUST	0.888	23		2,641
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	0.305	6		737
SPIRIT MTA REIT	1	11		1,274
RETAIL VALUE INC	0.555	15		1,751
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	0.491	4		472
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.080	4		459
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	372 156	13,012 -	1,466,165 <72.7%>
(カナダ)		千カナダ・ドル		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.300	13		1,113
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM	1	31		2,653
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	73		6,312
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1	15		1,293
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM	0.500	11		1,019
H&R REAL ESTATE INVESTMNT-UTS	2	45		3,898
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	0.300	7		670
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	59		5,086
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	0.700	31		2,658
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1	11		942
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	0.600	7		677
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	0.600	6		545
Dream Global Real Estate Investm	1	17		1,518
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	0.600	7		643
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.300	16		1,422
CHOICE PROPERTIES REIT	1	21		1,817
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.200	3		297
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	0.400	5		443
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	0.400	3		341
SLATE RETAIL REIT	0.300	3		322
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	0.500	8		691
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.200	2		243
SLATE OFFICE REIT	0.400	2		249
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	0.400	3		315
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	19 24	411 -	35,178 <1.7%>

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	当期末			
	□数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	千□	千オーストラリア・ドル	千円	
DEXUS	16	173	14,274	
GPT GROUP	29	158	13,000	
GOODMAN GROUP	26	274	22,600	
STOCKLAND	39	143	11,820	
BWP TRUST	7	25	2,117	
MIRVAC GROUP	62	136	11,229	
INVESTA OFFICE FUND	7	43	3,538	
CHARTER HALL RETAIL REIT	5	22	1,818	
ABACUS PROPERTY GROUP	5	16	1,341	
VICINITY CENTRES	53	142	11,735	
CHARTER HALL GROUP	7	48	4,025	
CROMWELL PROPERTY GROUP	24	25	2,056	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	11	28	2,377	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	3	14	1,158	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	3	9	771	
GDI PROPERTY GROUP	7	9	805	
INDUSTRIA REIT	1	4	336	
NATIONAL STORAGE REIT	7	13	1,117	
SCENTRE GROUP	88	343	28,235	
ARENA REIT	4	9	759	
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	3	9	787	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	2	6	573	
VIVA ENERGY REIT	6	14	1,199	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	2	9	803	
PROPERTYLINK GROUP	7	9	754	
RURAL FUNDS GROUP	3	8	719	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	440 26	1,702 -	139,960 <6.9%>
(香港)			千香港ドル	
CHAMPION REIT	31	165	2,384	
LINK REIT	35	2,603	37,444	
PROSPERITY REIT	18	50	729	
FORTUNE REIT	21	186	2,687	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	105 4	3,007 -	43,246 <2.1%>
(シンガポール)			千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	37	95	7,825	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40	68	5,615	
CAPITALAND MALL TRUST	41	91	7,522	
KEPPEL REIT	27	30	2,544	
SUNTEC REIT	34	61	5,046	

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	当期末			
	□数	評価額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	千□	千シンガポール・ドル		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	31	38		3,141
STARHILL GLOBAL REIT	2	1		136
ASCOTT RESIDENCE TRUST	19	21		1,739
FRASERS COMMERCIAL TRUST	0.100	0.138		11
ESR REIT	17	8		706
CDL HOSPITALITY TRUSTS	11	17		1,422
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	8	11		938
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	8	11		936
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	8	9		752
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	29	6		514
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	1	3		297
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	11	21		1,742
CACHE LOGISTICS TRUST	16	10		901
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	29	47		3,937
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	11	8		714
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	13	7		645
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	12	4		397
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	35	37		3,106
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	9	5		466
SPH REIT	9	9		805
OUE HOSPITALITY TRUST	17	11		945
KEPPEL DC REIT	1	2		212
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	5	5		452
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	494	650	53,479
		28	—	<2.7%>
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル		
KIWI PROPERTY GROUP LTD	22	29		2,282
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	15	21		1,661
GOODMAN PROPERTY TRUST	15	24		1,863
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	5	10		820
ARGOSY PROPERTY LTD	12	14		1,085
STRIDE PROPERTY GROUP	5	10		821
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	76	110	8,534
		6	—	<0.4%>
(イギリス)		千イギリス・ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	16	94		13,653
HAMMERSON PLC	12	54		7,870
LAND SECURITIES GROUP PLC	12	103		14,922
SEGRO PLC	16	99		14,374
WORKSPACE GROUP PLC	1	16		2,429
INTU PROPERTIES PLC	22	41		6,079

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	当期末			
	□数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	千□	千イギリス・ポンド	千円	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	9	10	1,481	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	4	30	4,413	
SHAFTESBURY PLC	3	34	5,063	
BIG YELLOW GROUP PLC	2	21	3,069	
DERWENT LONDON PLC	1	51	7,399	
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	8	4	665	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	10	19	2,894	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	12	12	1,797	
RDI REIT PLC	19	6	978	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	21	29	4,205	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	3	17	2,523	
ASSURA PLC	37	21	3,115	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	8	8	1,177	
REGIONAL REIT LTD	4	4	610	
CAPITAL & REGIONAL PLC	8	3	462	
NEWRIVER REIT PLC	4	11	1,621	
UNITE GROUP PLC	4	34	4,998	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	3	3	471	
LXI REIT PLC	2	2	364	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	3	2	381	
小計	□数・金額	255	739	107,026
	銘柄数<比率>	26	—	<5.3%>
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ	
GREEN REIT PLC	10	15	1,939	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	5	7	1,010	
小計	□数・金額	16	22	2,949
	銘柄数<比率>	2	—	<0.1%>
(ユーロ/オランダ)				
WERELDHAVE NV	0.626	18	2,371	
EUROCOMMERCIAL-CVA	0.759	22	2,907	
VASTNED RETAIL NV	0.245	8	1,044	
NSI NV	0.282	10	1,325	
小計	□数・金額	1	59	7,649
	銘柄数<比率>	4	—	<0.4%>
(ユーロ/ベルギー)				
RETAIL ESTATES	0.098	7	920	
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	0.245	4	636	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.251	28	3,677	
AEDIFICA	0.279	20	2,695	
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	0.245	0.113	14	
小計	□数・金額	1	61	7,944
	銘柄数<比率>	5	—	<0.4%>

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		当期末		
		□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千□	千ユーロ	千円
KLEPIERRE		3	98	12,719
GECINA SA		0.784	100	13,014
COVIVIO		0.826	71	9,279
MERCIALYS		0.857	10	1,410
ICADE		0.700	49	6,401
ALTAREA		0.057	10	1,389
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		2	342	44,229
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	8	685	88,444
(ユーロ/ドイツ)		7	—	<4.4%>
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1	23	3,063
HAMBORNER REIT AG		1	11	1,427
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3	34	4,491
(ユーロ/スペイン)		2	—	<0.2%>
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		1	11	1,544
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		5	57	7,469
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		6	58	7,575
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	13	128	16,588
(ユーロ/イタリア)		3	—	<0.8%>
BENI STABILI SPA		15	11	1,504
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		1	6	864
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	16	18	2,368
ユーロ計		2	—	<0.1%>
		61	1,011	130,436
		25	—	<6.5%>
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,824	—	1,984,027
		295	—	<98.3%>

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

(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

2018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	1,984,027	94.6
コール・ローン等、その他	114,033	5.4
投資信託財産総額	2,098,061	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1香港ドル14.38円、1シンガポール・ドル82.17円、1ニュージーランド・ドル77.08円、1イギリス・ポンド144.81円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（2,008,922千円）の投資信託財産総額（2,098,061千円）に対する比率は95.8%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,098,061,490円
コール・ローン等	102,218,153
投資信託証券(評価額)	1,984,027,628
未収入金	7,660,389
未収配当金	4,155,320
(B)負債	80,146,762
未払解約金	80,146,262
その他未払費用	500
(C)純資産総額(A-B)	2,017,914,728
元本	1,958,293,015
次期繰越損益金	59,621,713
(D)受益権総口数	1,958,293,015口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,304円

(注1) 設定元本額 2,000,100,000円
期中追加設定元本額 63,413,199円
期中一部解約元本額 105,220,184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) 1,915,161,338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) 24,070,947円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)
2,834,846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)
1,023,046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) 15,202,838円

損益の状況

当期(2017年9月28日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	113,823,122円
受取配当金	113,648,839
受取利息	212,142
その他収益金	52
支払利息	△ 37,911
(B)有価証券売買損益	△ 46,711,670
売買益	107,912,950
売買損	△ 154,624,620
(C)信託報酬等	△ 3,695,413
(D)当期損益金(A+B+C)	63,416,039
(E)追加信託差損益金	△ 820,696
(F)解約差損益金	△ 2,973,630
(G)合計(D+E+F)	59,621,713
次期繰越損益金(G)	59,621,713

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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