

第4期末 (2017年11月20日)

基準価額	14,711円
純資産総額	684億円
騰落率	23.3%
分配金	0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

追加型投信／海外／株式／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2016年11月22日～2017年11月20日

第4期(決算日 2017年11月20日)

受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第4期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。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

2016年11月22日～2017年11月20日

基準価額等の推移



第4期首	11,931円	既払分配金	0円
第4期末	14,711円	騰落率 (分配金再投資ベース)	23.3%

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

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

(注3) ベンチマークは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。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。以下同じです。

■基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、米国をはじめとする主な海外株式市場が上昇し、為替市場においても円安が進行したことから、上昇基調で推移しました。

期初は、トランプ次期大統領(当時)の政策に対する期待を背景に株式市場が上昇し、その後も、堅調なマクロ経済指標や企業業績を受けて、基準価額も同様の動きとなりました。北朝鮮等の地政学リスクや米政治リスクに対する懸念で弱含む局面もありましたが、期末にかけては、米税制改革への期待から上昇基調を維持しました。また、為替市場においては、欧州で金融緩和政策を微調整する可能性を示唆したことを背景にユーロ高が進むなど、期を通じて円安基調で推移し、基準価額を押し上げる要因となりました。

1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	29円	0.215%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,631円です。
(投信会社)	(15)	(0.108)	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)	(12)	(0.086)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.021)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	1	0.007	
(株式)	(1)	(0.004)	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)	(0.003)	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	3	0.020	
(株式)	(3)	(0.019)	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	10	0.073	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)	(9)	(0.064)	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)	(0.005)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(1)	(0.004)	・ 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	43	0.315	

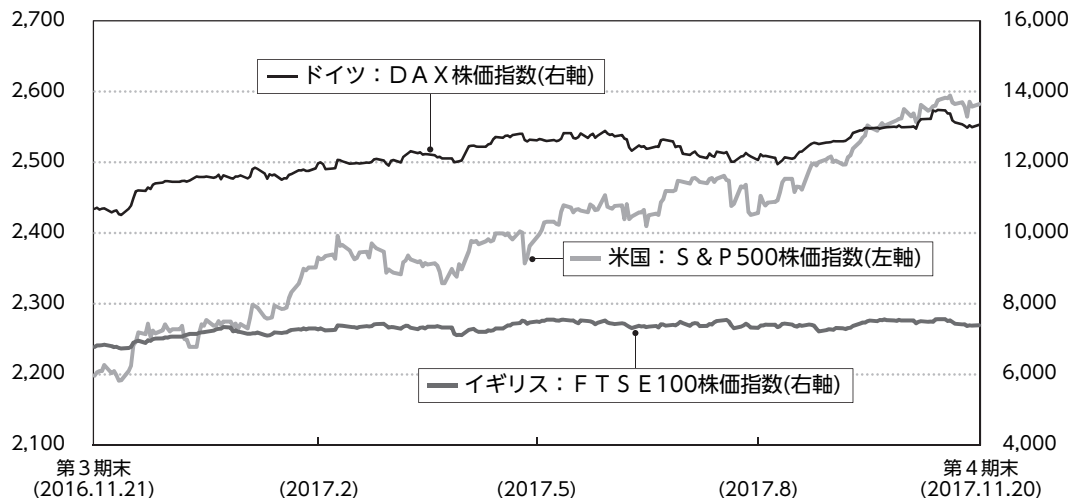
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

(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。

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期は米国をはじめとする主な海外株式市場において、株価が上昇しました。

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

ポートフォリオ

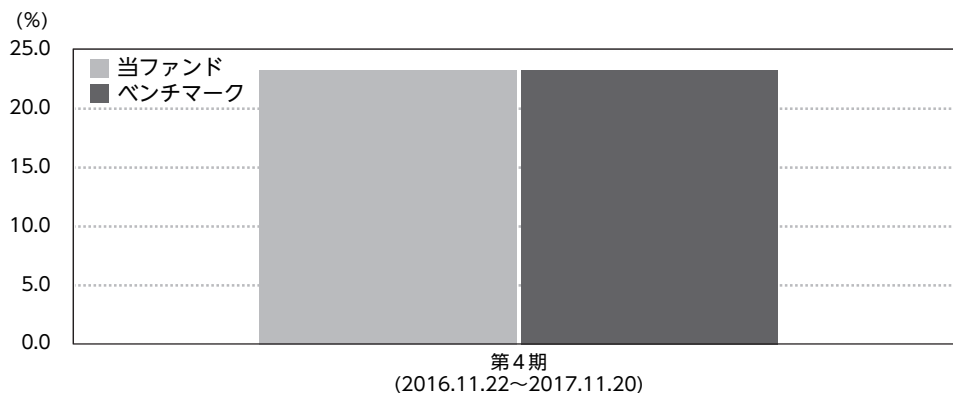
■当ファンド

マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

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。

当期の基準価額騰落率は+23.3%となり、ベンチマーク騰落率（+23.3%）に連動しました。

分配金

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

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2016年11月22日～2017年11月20日
当期分配金(税引前)	－
対基準価額比率	－
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	4,710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

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	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
				基準価額+ 累計分配金						
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
2013年12月10日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	27
1期(2014年11月20日)	12,526	0	25.3	12,526	12,589	25.9	92.0	6.3	2.0	5,755
2期(2015年11月20日)	12,964	0	3.5	12,964	13,046	3.6	93.7	3.6	2.4	19,029
3期(2016年11月21日)	11,931	0	△ 8.0	11,931	12,033	△ 7.8	94.1	3.5	2.4	35,666
4期(2017年11月20日)	14,711	0	23.3	14,711	14,834	23.3	94.3	2.1	2.4	68,498

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークは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。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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	投資信託 証券 組入比率
(期首)2016年11月21日	11,931	-	12,033	-	94.1	3.5	2.4
11月末	12,219	2.4	12,325	2.4	94.3	2.9	2.4
12月末	12,987	8.9	13,100	8.9	94.2	3.1	2.4
2017年1月末	12,942	8.5	13,058	8.5	95.5	1.9	2.4
2月末	13,193	10.6	13,308	10.6	95.1	2.2	2.5
3月末	13,318	11.6	13,434	11.6	95.2	2.2	2.5
4月末	13,409	12.4	13,525	12.4	94.5	2.9	2.4
5月末	13,611	14.1	13,726	14.1	95.5	1.9	2.5
6月末	13,820	15.8	13,938	15.8	95.1	2.2	2.5
7月末	13,923	16.7	14,042	16.7	95.3	2.1	2.5
8月末	13,869	16.2	13,986	16.2	93.9	3.3	2.4
9月末	14,510	21.6	14,634	21.6	95.5	1.9	2.4
10月末	14,844	24.4	14,971	24.4	94.4	3.0	2.3
(期末)2017年11月20日	14,711	23.3	14,834	23.3	94.3	2.1	2.4

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

<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

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2016年11月22日～2017年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	27,421,414	42,214,648	12,682,354	19,327,898

(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
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,014,354千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77,856,799千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.42

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2016年11月22日～2017年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2017年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	26,595,736	41,334,797	68,500,026

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は63,730,699千口です。

投資信託財産の構成

2017年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	68,500,026	99.6
コール・ローン等、その他	276,147	0.4
投資信託財産総額	68,776,174	100.0

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

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（103,836,680千円）の投資信託財産総額（106,065,520千円）に対する比率は97.9%です。

(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

(2017年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	68,776,174,278円
コール・ローン等	62,160,416
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	68,500,026,693
未収入金	213,987,169
(B) 負債	277,393,166
未払解約金	212,737,786
未払信託報酬	63,266,207
その他未払費用	1,389,173
(C) 純資産総額(A-B)	68,498,781,112
元本	46,563,517,420
次期繰越損益金	21,935,263,692
(D) 受益権総口数	46,563,517,420口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,711円

(注) 期首元本額 29,894,160,896円
 期中追加設定元本額 30,857,933,252円
 期中一部解約元本額 14,188,576,728円

損益の状況

当期(2016年11月22日~2017年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 15,096円
受取利息	2,162
支払利息	△ 17,258
(B) 有価証券売買損益	8,240,902,414
売却益	9,736,096,453
売却損	△ 1,495,194,039
(C) 信託報酬等	△ 111,655,147
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,129,232,171
(E) 前期繰越損益金	355,267,794
(分配準備積立金)	(800,759,757)
(繰越欠損金)	(△ 445,491,963)
(F) 追加信託差損益金*	13,450,763,727
(配当等相当額)	(9,527,624,296)
(売買損益相当額)	(3,923,139,431)
(G) 合計(D+E+F)	21,935,263,692
次期繰越損益金(G)	21,935,263,692
追加信託差損益金	13,450,763,727
(配当等相当額)	(9,586,181,258)
(売買損益相当額)	(3,864,582,469)
分配準備積立金	8,484,499,965

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,089,710,217円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	6,594,029,991円
(c) 信託約款に定める収益調整金	13,450,763,727円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	800,759,757円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	21,935,263,692円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	4,710.83円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

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

（2017年3月25日）

■約款変更

・信託報酬率の上限を引き下げたことに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

（2016年11月22日）

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

（2017年8月18日）

■関連会社の実質保有比率

2017年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に19.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	日本を除く世界主要先進国の株式
運用方法	<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	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	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。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 20 期

(計算期間：2017年5月23日～2017年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く世界主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

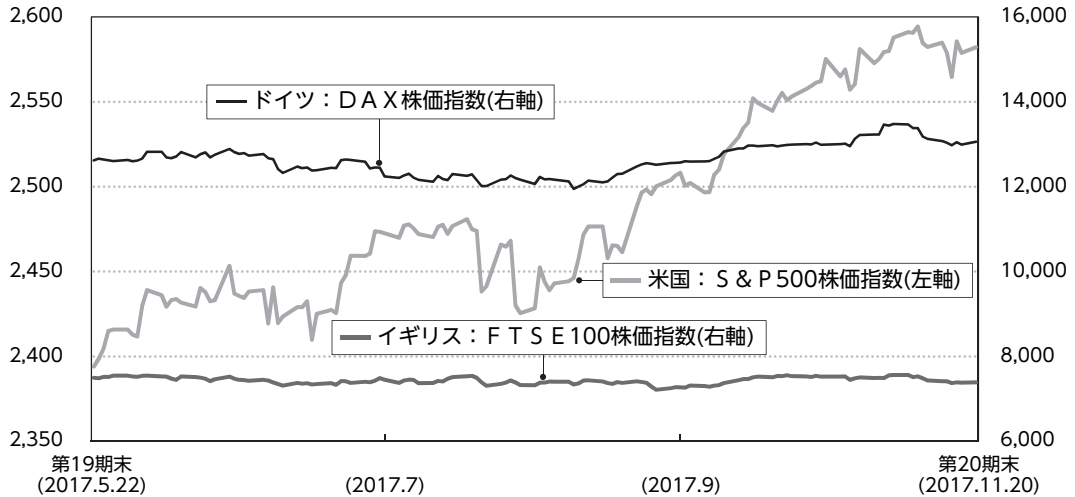
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年5月23日～2017年11月20日

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

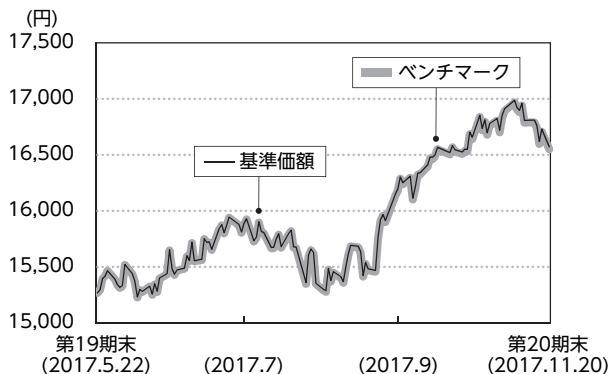


(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期は、米国をはじめとする主な海外株式市場が上昇しました。

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

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期は主な海外株式市場が上昇したことから、基準価額も同様の動きとなりました。期前半は、堅調な企業業績やF R Bによる金融引き締め懸念の後退から、株式市場は上昇しましたが、地政学リスクや米政治リスクに対する懸念の高まりから下落する場面もあり、変動の大きな展開となりました。期後半は、原油価格の上昇や米税制改革に対する期待の高まり、加えて堅調なマクロ経済指標や企業業績を背景に株式市場が上昇したため、基準価額も上昇して当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+8.5%となり、ベンチマーク騰落率（+8.4%）におおむね連動しました。

■ 今後の運用方針

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

■ お知らせ

■ 約款変更

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

(2017年8月18日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
16期(2015年11月20日)	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4	50,880
17期(2016年5月20日)	12,674	△ 12.8	12,494	△ 12.9	93.9	3.3	2.6	50,956
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415
19期(2017年5月22日)	15,268	13.8	15,052	13.7	94.6	2.8	2.4	82,206
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2017年5月23日～2017年11月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2017年5月23日～2017年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1	29	—	—
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	3	40	0.055	0.721
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.523	76	0.136	18
JBG SMITH PROPERTIES	—	—	1	64
	(1)			
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.336	10	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	0.735	16	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.763	18	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	7	69	—	—
GPT GROUP	12	61	—	—
GOODMAN GROUP	7	62	0.051	0.430
STOCKLAND	11	50	0.138	0.608
WESTFIELD CORP	8	68	0.265	1
MIRVAC GROUP	24	55	—	—
VICINITY CENTRES	22	59	0.942	2
SCENTRE GROUP	24	98	1	8
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	10	635	1	62
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	15	39	—	—
		(△0.282)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	10	17	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	11	22	—	—
SUNTEC REIT	14	26	—	—
		(△0.352)		
CAPITALAND COMMERCIAL-RIGHTS	—	—	8	2
	(8)			
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	5	33	0.055	0.336
HAMMERSON PLC	4	24	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	31	0.044	0.450
	(△ 1)	(△ 11)		
SEGRO PLC	9	48	—	—
INTU PROPERTIES PLC	2	6	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2017年5月23日～2017年11月20日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2017年11月20日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
3M CO	130	153	3,525	395,525	資本財
ABBOTT LABORATORIES	373	446	2,480	278,240	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	352	409	3,836	430,439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	134	159	2,319	260,207	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	129	184	1,181	132,529	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	9	11	183	20,550	資本財
ADOBE SYSTEMS INC	108	127	2,322	260,557	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	15	18	168	18,928	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	170	206	235	26,375	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	30	37	187	21,028	資本財
AES CORP	132	171	181	20,409	公益事業
AETNA INC	76	85	1,479	165,982	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	11	14	269	30,188	各種金融
AFLAC INC	88	101	852	95,670	保険
AGCO CORP	12	15	102	11,449	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	70	82	570	64,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	44	55	904	101,442	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	37	44	246	27,609	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	24	28	387	43,460	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	57	640	71,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	14	19	497	55,856	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	31	39	190	21,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	3	3	223	25,108	保険
ALLEGION PLC	-	24	205	23,060	資本財
ALLERGAN PLC	81	86	1,512	169,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11	12	290	32,569	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	50	59	265	29,757	公益事業
ALLSTATE CORP	79	93	939	105,401	保険
ALLY FINANCIAL INC	87	117	313	35,220	各種金融
ALPHABET INC-CL A	64	76	7,936	890,450	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	67	80	8,195	919,455	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	423	496	3,300	370,332	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	87	104	11,819	1,326,049	小売
AMERCO	1	1	65	7,345	運輸
AMEREN CORPORATION	53	63	399	44,818	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	25	32	152	17,066	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	107	126	969	108,767	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	168	195	1,830	205,418	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	-	18	192	21,628	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	222	236	1,421	159,444	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	39	46	413	46,430	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	34	39	618	69,413	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	35	42	331	37,228	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	56	67	329	36,970	各種金融
AMETEK INC	50	59	415	46,609	資本財
AMGEN INC	161	189	3,216	360,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	67	78	705	79,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	121	143	692	77,690	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	78	94	852	95,680	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	25	39	412	46,279	エネルギー
ANSYS INC	18	21	330	37,078	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	31	53	105	11,882	エネルギー
ANTHEM INC	57	68	1,504	168,816	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	57	67	954	107,119	保険
APACHE CORP	82	97	400	44,970	エネルギー
APPLE INC	1,158	1,342	22,838	2,562,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	234	276	1,562	175,273	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	46	62	255	28,718	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26	33	321	36,065	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	124	145	574	64,405	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	95	101	243	27,287	資本財
ARISTA NETWORKS INC	-	12	283	31,819	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	17	22	176	19,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38	46	305	34,223	保険
ASSURANT INC	11	13	135	15,180	保険
AT&T INC	1,335	1,586	5,474	614,210	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	-	26	131	14,744	保険
ATMOS ENERGY CORP	21	27	245	27,570	公益事業
AUTODESK INC	43	51	650	73,003	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	19	22	275	30,958	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	97	115	1,278	143,400	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	13	15	80	9,069	小売
AUTOZONE INC	6	7	455	51,125	小売
AVERY DENNISON CORP	17	22	247	27,809	素材
AVNET INC	25	30	119	13,439	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DTE ENERGY COMPANY	39	46	525	58,997	公益事業
DUKE ENERGY CORP	150	180	1,598	179,364	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	61	72	706	79,251	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	59	70	310	34,884	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	-	36	212	23,833	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	31	37	336	37,724	素材
EATON CORP PLC	97	114	868	97,428	資本財
EATON VANCE CORP	22	28	148	16,646	各種金融
EBAY INC	230	264	941	105,656	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	57	67	885	99,294	素材
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	11	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	71	84	681	76,475	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46	54	578	64,889	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	188	-	-	-	素材
ELECTRONIC ARTS INC	65	79	868	97,387	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	215	255	2,119	237,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	139	165	990	111,132	資本財
ENBRIDGE INC	136	-	-	-	エネルギー
ENTERGY CORP	39	46	403	45,257	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	23	28	82	9,220	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	124	148	1,505	168,958	エネルギー
EQT CORP	37	44	262	29,477	エネルギー
EQUIFAX INC	25	30	345	38,708	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	48	57	716	80,408	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	8	10	235	26,381	保険
EVERSOURCE ENERGY	69	82	527	59,171	公益事業
EXELON CORP	201	238	985	110,534	公益事業
EXPEDIA INC	26	32	396	44,526	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	41	49	293	32,916	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	133	152	944	105,993	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	900	1,090	8,753	982,050	エネルギー
F5 NETWORKS INC	14	16	207	23,250	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	508	608	10,900	1,222,893	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	62	74	359	40,343	資本財
FEDEX CORP	55	66	1,425	159,962	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	67	85	785	88,099	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	162	192	546	61,336	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	64	89	150	16,860	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	33	40	373	41,870	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HENRY SCHEIN INC	17	40	281	31,630	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	31	37	406	45,618	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	61	73	326	36,605	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	360	421	577	64,765	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	42	50	376	42,262	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	32	41	186	20,871	エネルギー
HOLOGIC INC	54	72	288	32,403	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	264	307	5,165	579,485	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	157	186	2,729	306,195	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	259	307	216	24,316	不動産
HORMEL FOODS CORP	62	74	246	27,667	食品・飲料・タバコ
HP INC	371	432	941	105,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	32	37	866	97,250	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	234	278	376	42,237	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10	11	274	30,802	資本財
IDEX CORP	-	19	251	28,199	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	19	22	353	39,634	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	77	104	456	51,217	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	68	80	1,257	141,053	資本財
ILLUMINA INC	31	37	785	88,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	36	44	472	53,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	55	65	559	62,817	資本財
INGREDION INC	14	18	245	27,528	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,028	1,211	5,406	606,607	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	129	152	1,014	113,771	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	196	229	3,419	383,662	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	17	20	302	33,960	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	84	100	547	61,383	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	87	102	196	21,996	メディア
INTUIT INC	52	62	980	109,999	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	8	28	1,116	125,316	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	88	104	363	40,829	各種金融
IQVIA HOLDINGS INC	32	36	378	42,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	-	20	224	25,236	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	23	30	179	20,108	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	54	56	363	40,805	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	46	58	248	27,837	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12	15	206	23,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	19	23	240	27,006	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JM SMUCKER CO	25	29	340	38,253	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	590	693	9,570	1,073,691	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	203	241	878	98,517	資本財
JONES LANG LASALLE INC	8	11	170	19,126	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	776	914	8,972	1,006,608	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	74	98	259	29,116	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	23	28	289	32,424	運輸
KELLOGG CO	57	67	442	49,679	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	233	280	514	57,696	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	77	91	1,046	117,366	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	412	516	879	98,640	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	34	40	410	46,106	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	35	44	192	21,625	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	132	156	1,245	139,731	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	194	234	548	61,533	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	52	62	314	35,231	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	16	19	368	41,352	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	22	26	395	44,398	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	35	41	874	98,086	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	94	101	675	75,755	消費者サービス
LEAR CORP	15	17	309	34,707	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	26	33	155	17,410	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	-	36	225	25,255	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP - B SHS	-	1	5	568	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	44	52	308	34,639	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	-	10	195	21,880	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	64	82	208	23,366	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	67	-	-	-	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-C	23	28	255	28,655	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	50	54	164	18,509	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	132	150	436	49,000	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	84	108	269	30,180	小売
LIBERTY LILAC GROUP-C	21	-	-	-	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	22	92	10,391	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	37	46	192	21,614	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	49	57	424	47,650	保険
LKQ CORP	67	79	300	33,695	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	57	67	2,080	233,418	資本財
LOEWS CORP	61	73	362	40,625	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	335	390	1,650	185,155	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	95	113	1,338	150,185	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	86	102	635	71,345	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	37	44	651	73,037	各種金融
MORGAN STANLEY	304	357	1,738	195,074	各種金融
MOSAIC CO/THE	71	85	195	21,966	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33	42	388	43,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	18	23	297	33,429	各種金融
MURPHY OIL CORP	32	38	107	12,061	エネルギー
MYLAN NV	98	117	440	49,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	22	29	225	25,323	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	81	97	311	34,938	エネルギー
NAVIENT CORP	59	68	85	9,548	各種金融
NETAPP INC	60	69	368	41,315	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	93	110	2,143	240,506	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	96	122	155	17,446	銀行
NEWELL BRANDS INC	94	124	355	39,872	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	39	49	151	16,986	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	114	136	493	55,411	素材
NEWS CORP - CLASS A	76	97	154	17,353	メディア
NEXTERA ENERGY INC	101	120	1,884	211,474	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	77	91	334	37,533	商業・専門サービス
NIKE INC	290	340	2,013	225,864	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	65	85	230	25,848	公益事業
NOBLE ENERGY INC	93	119	310	34,862	エネルギー
NORDSTROM INC	25	30	124	14,013	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	63	75	962	107,973	運輸
NORTHERN TRUST CORP	46	55	525	58,963	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	36	42	1,268	142,306	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	31	46	255	28,719	消費者サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	54	68	99	11,149	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	69	81	448	50,272	素材
NVIDIA CORP	116	153	3,236	363,085	半導体・半導体製造装置
NVR INC	-	0.92	299	33,632	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	63	89	1,029	115,481	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	165	196	1,342	150,567	エネルギー
OGE ENERGY CORP	39	51	182	20,456	公益事業
OMNICOM GROUP	51	61	423	47,537	メディア
ONEOK INC	45	97	495	55,601	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SOUTHWEST AIRLINES CO	31	40	219	24,576	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO	98	-	-	-	エネルギー
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	5	6	71	8,069	家庭用品・パーソナル用品
SPLUNK INC	27	35	290	32,630	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	158	203	126	14,225	電気通信サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	-	44	178	20,033	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	32	39	642	72,041	資本財
STAPLES INC	127	-	-	-	小売
STARBUCKS CORP	315	372	2,117	237,601	消費者サービス
STATE STREET CORP	83	96	892	100,093	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	-	61	227	25,536	素材
STERICYCLE INC	16	21	134	15,124	商業・専門サービス
STRYKER CORP	73	86	1,345	150,946	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	105	123	714	80,146	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	-	13	287	32,306	銀行
SYMANTEC CORP	134	156	439	49,335	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	179	208	705	79,147	各種金融
SYNOPTIS INC	32	38	340	38,234	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	112	130	718	80,621	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	52	61	592	66,417	各種金融
TAPESTRY INC	60	72	301	33,810	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	39	55	232	26,058	エネルギー
TARGET CORP	115	134	782	87,782	小売
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	2	2	32	3,593	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TE CONNECTIVITY LTD	77	91	866	97,231	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	95	112	300	33,666	エネルギー
TEGNA INC	40	-	-	-	メディア
TELEFLEX INC	9	11	308	34,614	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	-	9	77	8,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA, INC.	28	33	1,066	119,644	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	198	234	324	36,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	216	256	2,505	281,044	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	58	68	363	40,808	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	100	1,915	214,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	26	32	303	34,066	小売
TIME WARNER INC	167	200	1,776	199,298	メディア
TJX COS INC	141	165	1,175	131,842	小売
T-MOBILE US INC	63	76	458	51,411	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	30	39	183	20,574	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TORCHMARK CORP	23	28	242	27,184	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	35	42	315	35,418	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	32	212	23,821	小売
TRANSDIGM GROUP INC	11	13	353	39,697	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	61	71	930	104,376	保険
TRIMBLE INC	50	65	269	30,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	23	27	84	9,489	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	96	116	354	39,731	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	229	269	839	94,168	メディア
TWITTER INC	118	159	331	37,183	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	63	74	577	64,766	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	35	45	216	24,309	公益事業
ULTA BEAUTY INC	12	15	326	36,632	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	36	45	58	6,612	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	36	44	52	5,842	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	179	209	2,419	271,463	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	15	19	116	13,045	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	151	179	2,029	227,705	運輸
UNITED RENTALS INC	18	21	325	36,573	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	169	195	2,281	255,913	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	8	11	137	15,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	206	248	5,206	584,101	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	19	22	223	25,064	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	49	58	310	34,822	保険
US BANCORP	368	432	2,246	251,989	銀行
VAIL RESORTS INC	-	10	235	26,470	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	97	114	952	106,874	エネルギー
VALSPAR CORP	15	-	-	-	素材
VALVOLINE INC	33	-	-	-	素材
VANTIV INC - CL A	35	41	293	32,963	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18	23	257	28,892	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	-	26	164	18,510	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	19	23	271	30,410	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	34	40	373	41,862	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	887	1,052	4,781	536,405	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	53	64	944	106,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	71	87	620	69,614	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	75	91	238	26,703	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	405	475	5,221	585,775	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
VMWARE INC-CLASS A	13	18	223	25,029	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	38	47	199	22,404	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	28	34	419	47,029	素材
WABCO HOLDINGS INC	10	13	190	21,419	資本財
WABTEC CORP	17	21	160	17,974	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	199	236	1,683	188,831	食品・生活必需品小売り
WAL-MART STORES INC	335	389	3,799	426,274	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	328	403	4,174	468,293	メディア
WASTE CONNECTIONS INC	38	68	473	53,146	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	96	114	920	103,257	商業・専門サービス
WATERS CORP	17	20	409	45,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	184	224	76	8,632	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	69	81	558	62,678	公益事業
WELLS FARGO & CO	1,035	1,221	6,614	742,132	銀行
WESTAR ENERGY INC	28	37	206	23,135	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP	61	74	683	76,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	104	120	238	26,702	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	54	64	382	42,888	素材
WEYERHAEUSER CO	162	192	699	78,527	不動産
WHIRLPOOL CORP	16	19	314	35,312	耐久消費財・アパレル
WHOLE FOODS MARKET INC	69	-	-	-	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS INC	177	212	579	65,034	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	28	32	527	59,172	保険
WORKDAY INC-CLASS A	26	33	377	42,311	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	19	24	162	18,178	保険
WR GRACE & CO	14	17	128	14,410	素材
WW GRAINGER INC	12	14	280	31,514	資本財
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	23	26	291	32,712	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	17	21	320	35,945	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	111	131	670	75,203	公益事業
XEROX CORP	169	55	156	17,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	54	63	458	51,383	半導体・半導体製造装置
XL GROUP LTD	58	67	260	29,188	保険
XYLEM INC	36	46	308	34,635	資本財
YAHOO! INC	196	-	-	-	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	75	85	669	75,095	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	32	48	170	19,114	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	22	25	102	11,528	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	43	51	579	64,961	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ZIONS BANCORPORATION		-	51	238	26,792	銀行
ZOETIS INC		102	126	897	100,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	67,556 598	79,008 602	579,465 -	65,010,249 <61.6%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		48	59	337	29,665	素材
AGRIUM INC		28	35	487	42,802	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		91	108	689	60,498	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		33	41	120	10,578	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		69	86	138	12,189	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'		16	19	89	7,858	公益事業
BANK OF MONTREAL		139	167	1,659	145,672	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		261	309	2,615	229,605	銀行
BARRICK GOLD CORP		253	299	537	47,199	素材
BCE INC		32	44	272	23,946	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD		100	126	166	14,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOMBARDIER INC		385	467	144	12,729	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC		194	230	1,219	107,097	各種金融
CAE INC		54	68	154	13,584	資本財
CAMECO CORP		78	95	114	10,058	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		85	110	1,271	111,618	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO		168	197	2,007	176,282	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		240	287	1,278	112,221	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		30	38	832	73,102	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		13	17	276	24,284	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		26	32	123	10,809	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B		5	36	217	19,132	素材
CENOVUS ENERGY INC		181	267	347	30,469	エネルギー
CGI GROUP INC		47	54	373	32,792	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP		48	67	191	16,796	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC		4	5	387	34,057	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP		106	128	123	10,806	エネルギー
DOLLARAMA INC		23	28	425	37,398	小売
ELDORADO GOLD CORP		140	-	-	-	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		78	94	91	8,067	各種金融
EMERA INC		12	15	75	6,661	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'		32	42	102	9,019	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC		203	422	1,896	166,504	エネルギー
ENCANA CORP		210	249	377	33,151	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	47	59	100	8,848	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	94	113	320	28,171	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	-	20	278	24,450	ソフトウェア・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	30	45	255	22,408	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	133	157	793	69,672	保険
SUNCOR ENERGY INC	362	430	1,944	170,729	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	122	146	408	35,898	素材
THOMSON REUTERS CORP	72	75	421	36,971	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	403	474	3,490	306,501	銀行
TOURMALINE OIL CORP	45	54	131	11,555	エネルギー
TRANSCANADA CORP	188	225	1,410	123,805	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	198	241	94	8,282	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	64	79	149	13,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERESEN INC	61	-	-	-	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	23	27	123	10,867	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	12	16	135	11,866	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	93	112	301	26,498	素材
YAMANA GOLD INC	185	225	79	6,940	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,591 90	10,451 89	45,412 -	3,987,245 <3.8%>
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD	157	179	447	37,954	公益事業
ALUMINA LTD	512	619	138	11,708	素材
AMCOR LTD	264	314	473	40,122	素材
AMP LTD	679	798	409	34,750	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	116	146	341	28,914	消費者サービス
ASX LTD	42	55	307	26,082	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	488	589	303	25,708	運輸
AUSNET SERVICES	512	619	114	9,688	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	644	763	2,248	190,653	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	87	104	133	11,358	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	102	123	137	11,636	銀行
BHP BILLITON LTD	702	832	2,258	191,528	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	-	149	200	16,987	素材
BORAL LTD	244	320	242	20,594	素材
BRAMBLES LTD	361	426	417	35,358	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	55	72	244	20,738	エネルギー
CHALLENGER LTD	125	160	220	18,681	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED	21	26	130	11,066	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	128	155	123	10,492	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	12	16	297	25,233	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	378	449	3,640	308,665	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	100	127	208	17,698	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	78	104	127	10,790	消費者サービス
CSL LIMITED	100	118	1,680	142,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	13	16	77	6,529	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	12	14	70	5,940	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	313	400	188	15,978	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	134	154	60	5,164	小売
HEALTHSCOPE LTD	380	476	89	7,588	ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD	354	455	180	15,284	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	552	653	468	39,743	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	94	123	260	22,065	素材
MACQUARIE GROUP LTD	68	85	849	72,011	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	585	762	245	20,816	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	585	697	2,096	177,786	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	169	201	478	40,530	素材
OIL SEARCH LTD	283	373	268	22,760	エネルギー
ORICA LTD	79	101	177	15,072	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	390	460	376	31,944	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LTD	131	145	85	7,222	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	308	366	408	34,633	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	30	39	265	22,530	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	13	16	125	10,655	ソフトウェア・サービス
RIO TINTO LTD	94	111	790	67,044	素材
SANTOS LTD	370	483	242	20,555	エネルギー
SEEK LTD	73	93	178	15,097	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	84	112	243	20,671	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	1,170	1,377	454	38,533	素材
SUNCORP GROUP LTD	299	354	497	42,201	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	191	232	116	9,849	消費者サービス
TATTS GROUP LTD	315	349	153	13,010	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	993	1,152	397	33,700	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	80	107	62	5,302	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	154	201	318	27,045	食品・飲料・タバコ
VOCUS GROUP LTD	115	-	-	-	電気通信サービス
WESFARMERS LIMITED	251	297	1,259	106,773	食品・生活必需品小売り
WESTPAC BANKING CORP	735	872	2,778	235,594	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千円	千円	
WOODSIDE PETROLEUM LTD		169	201	620	52,601	エネルギー
WOOLWORTHS LTD		285	340	878	74,503	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,807 58	19,107 58	30,612 -	2,595,667 <2.5%>	
(香港)				千香港ドル		
AIA GROUP LTD		2,624	3,112	20,513	294,567	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		50	67	840	12,074	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA		246	304	992	14,253	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		810	955	3,549	50,967	銀行
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD		270	-	-	-	運輸
CK ASSET HOLDINGS LTD		594	679	4,420	63,483	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		599	699	6,868	98,632	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		140	180	1,227	17,628	公益事業
CLP HOLDINGS LTD		371	436	3,463	49,729	公益事業
FIRST PACIFIC CO		460	560	336	4,824	各種金融
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		508	598	3,331	47,839	消費者サービス
HANG LUNG GROUP LTD		180	240	652	9,374	不動産
HANG LUNG PROPERTIES LTD		451	491	857	12,310	不動産
HANG SENG BANK LTD		169	198	3,681	52,860	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		257	322	1,675	24,057	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		1,724	2,233	3,305	47,467	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		254	301	7,039	101,093	各種金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		130	160	630	9,052	不動産
KERRY PROPERTIES LTD		130	160	540	7,754	不動産
LI & FUNG LTD		1,212	1,472	539	7,740	耐久消費財・アパレル
MGM CHINA HOLDINGS LTD		192	232	433	6,223	消費者サービス
MTR CORP		362	427	1,938	27,843	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,136	1,526	1,740	24,992	不動産
NWS HOLDINGS LTD		320	390	625	8,983	資本財
PCCW LTD		970	1,230	532	7,647	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		300	370	2,466	35,415	公益事業
SANDS CHINA LTD		529	621	2,254	32,367	消費者サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		260	320	574	8,243	消費者サービス
SINO LAND CO		620	820	1,131	16,249	不動産
SJM HOLDINGS LTD		390	470	292	4,204	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		330	380	4,790	68,797	不動産
SWIRE PACIFIC LTD		128	138	1,035	14,863	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD		238	290	778	11,181	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		280	360	1,697	24,374	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
	WH GROUP LTD	1,620	2,100	1,617	23,220	食品・飲料・タバコ
	WHARF HOLDINGS LTD	307	327	834	11,986	不動産
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	–	327	1,508	21,669	不動産
	WHEELOCK & CO LTD	160	200	1,080	15,508	不動産
	WYNN MACAU LTD	313	381	824	11,845	消費者サービス
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	155	185	526	7,558	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19,797 39	24,269 39	91,148 –	1,308,889 <1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポール・ドル		
	CAPITALAND LTD	516	665	234	19,422	不動産
	CITY DEVELOPMENTS LTD	80	98	118	9,819	不動産
	COMFORTDELGRO CORP LTD	470	566	114	9,506	運輸
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	386	457	1,102	91,240	銀行
	GENTING SINGAPORE PLC	1,191	1,516	206	17,059	消費者サービス
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	530	671	222	18,432	不動産
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,383	1,692	65	5,389	食品・飲料・タバコ
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	19	26	102	8,443	小売
	KEPPEL CORP LTD	287	374	276	22,837	資本財
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	681	808	941	77,884	銀行
	SATS LTD	159	202	103	8,540	運輸
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	198	243	74	6,192	資本財
	SINGAPORE AIRLINES LTD	116	145	152	12,645	運輸
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	161	194	144	11,990	各種金融
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	339	411	111	9,249	メディア
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	313	379	125	10,348	資本財
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,813	2,160	794	65,768	電気通信サービス
	STARHUB LTD	150	184	52	4,308	電気通信サービス
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	285	339	849	70,290	銀行
	UOL Group Limited	94	116	100	8,282	不動産
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	380	382	120	9,987	食品・飲料・タバコ
	YANGZIJIAN SHIPBUILDING	368	544	93	7,696	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,919 22	12,172 22	6,107 –	505,337 <0.5%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル		
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	199	249	153	11,727	運輸
	CONTACT ENERGY LTD	146	174	97	7,413	公益事業
	FLETCHER BUILDING LTD	136	165	115	8,807	素材
	MERCURY NZ LTD	149	181	62	4,772	公益事業
	MERIDIAN ENERGY LTD	257	312	90	6,915	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		百株	百株	千円	千円	
RYMAN HEALTHCARE LTD		75	98	90	6,907	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		376	485	175	13,442	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,341	1,667	785	59,985	
		7	7	-	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
3I GROUP PLC		195	246	227	33,762	各種金融
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		178	-	-	-	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		42	49	93	13,784	保険
ANGLO AMERICAN PLC		303	342	490	72,690	素材
ANTOFAGASTA PLC		76	97	92	13,744	素材
ASHTAD GROUP PLC		108	128	245	36,421	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		77	91	282	41,861	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		274	325	1,620	240,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		199	241	77	11,439	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		878	1,043	522	77,387	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC		50	60	45	6,775	商業・専門サービス
BAE SYSTEMS PLC		689	820	439	65,071	資本財
BARCLAYS PLC		3,678	4,381	810	120,103	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		198	258	162	24,047	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		26	32	123	18,322	耐久消費財・アパレル
BHP BILLITON PLC		457	542	739	109,639	素材
BP PLC		4,105	5,065	2,498	370,131	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		405	591	2,948	436,943	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		1,843	2,191	537	79,681	電気通信サービス
BUNZL PLC		73	87	188	27,891	資本財
BURBERRY GROUP PLC		95	112	197	29,234	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC		132	160	76	11,360	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC		41	48	237	35,229	消費者サービス
CENTRICA PLC		1,199	1,416	231	34,259	公益事業
COBHAM PLC		338	577	73	10,929	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI		35	45	112	16,658	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		355	406	649	96,239	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC		-	333	68	10,156	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		26	34	145	21,606	素材
DCC PLC		18	23	164	24,443	資本財
DIAGEO PLC		546	648	1,668	247,278	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		269	353	125	18,601	保険
DIXONS CARPHONE PLC		191	228	34	5,183	小売
EASYJET PLC		32	40	51	7,696	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イリス・ポンド	千円	
EXPERIAN PLC	206	242	378	56,084	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	54	65	342	50,793	資本財
FRESNILLO PLC	43	52	68	10,156	素材
G4S PLC	309	393	101	15,023	商業・専門サービス
GKN PLC	339	441	133	19,806	自動車・自動車部品
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,060	1,267	1,657	245,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	2,653	3,144	1,111	164,652	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	51	65	102	15,209	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	28	34	36	5,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	4,293	5,159	3,774	559,306	銀行
IMI PLC	53	65	80	11,983	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	208	246	752	111,555	食品・飲料・タバコ
INMARSAT PLC	92	113	56	8,337	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38	46	198	29,360	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	33	41	222	32,942	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	130	158	78	11,635	各種金融
ITV PLC	793	946	142	21,101	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	38	49	161	23,951	素材
KINGFISHER PLC	484	567	174	25,831	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,289	1,526	410	60,823	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,949	18,463	1,216	180,289	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	68	80	310	45,976	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	319	416	125	18,605	小売
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	73	89	49	7,349	ヘルスケア機器・サービス
MEGGITT PLC	153	195	93	13,854	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	140	169	63	9,473	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	-	55	150	22,238	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	75	94	164	24,343	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	437	568	118	17,628	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	823	889	785	116,379	公益事業
NEXT PLC	27	37	162	24,080	小売
OLD MUTUAL PLC	1,066	1,263	240	35,694	保険
PEARSON PLC	162	212	148	21,983	メディア
PERSIMMON PLC	63	79	212	31,502	耐久消費財・アパレル
PETROFAC LTD	51	-	-	-	エネルギー
PROVIDENT FINANCIAL PLC	29	35	32	4,831	各種金融
PRUDENTIAL PLC	559	664	1,256	186,133	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	169	25,138	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	136	171	1,097	162,690	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RELX PLC	237	278	485	71,891	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	267	316	1,122	166,324	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL	-	19,210	1	284	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	399	426	379	56,239	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	27,690	-	-	-	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	768	915	251	37,223	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	947	1,150	2,688	398,358	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	813	965	2,292	339,614	エネルギー
ROYAL MAIL PLC	188	238	94	13,962	運輸
RSA INSURANCE GROUP PLC	206	262	160	23,707	保険
SAGE GROUP PLC	224	279	211	31,391	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	320	407	92	13,734	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	26	30	107	15,891	各種金融
SEVERN TRENT PLC	48	62	131	19,422	公益事業
SHIRE PLC	196	233	859	127,305	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SKY PLC	225	269	253	37,499	メディア
SMITH & NEPHEW PLC	190	225	298	44,243	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	79	101	151	22,490	資本財
SSE PLC	222	262	353	52,330	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC	103	136	157	23,385	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	712	847	615	91,157	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	426	687	290	43,039	各種金融
TATE & LYLE PLC	92	111	75	11,239	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	659	840	165	24,481	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	1,778	2,107	389	57,678	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC	49	61	89	13,303	資本財
TUI AG-DI	97	112	148	22,012	消費者サービス
UNILEVER PLC	278	329	1,368	202,808	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	150	180	144	21,371	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	5,812	6,898	1,577	233,780	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE	42	54	108	16,100	資本財
WHITBREAD PLC	38	46	166	24,668	消費者サービス
WILLIAM HILL PLC	167	-	-	-	消費者サービス
WORLDPAY GROUP PLC-W/I	368	516	210	31,204	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	280	331	419	62,182	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	91,622 105	98,071 104	48,233 -	7,146,774 <6.8%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
AZRIELI GROUP		7	9	189	6,055	不動産
BANK HAPOALIM BM		207	273	642	20,499	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		280	364	682	21,796	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		424	517	275	8,789	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		4	5	272	8,694	資本財
FRUTAROM		7	9	252	8,052	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		101	121	166	5,319	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		27	32	203	6,495	銀行
NICE LTD		11	14	435	13,893	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,073 9	1,348 9	3,119 -	99,597 <0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		408	512	1,275	144,542	資本財
ACTELION LTD-REG		21	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		35	41	307	34,866	商業・専門サービス
ARYZTA AG		17	-	-	-	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG		9	12	197	22,392	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.44	0.54	91	10,389	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.19	0.27	149	16,994	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.02	134	15,273	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		113	134	1,164	131,987	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG		431	623	990	112,211	各種金融
DUFREY AG-REG		9	8	127	14,455	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	2	136	15,431	素材
GEBERIT AG-REG		8	9	406	46,099	資本財
GIVAUDAN-REG		2	2	540	61,189	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		48	57	340	38,607	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		11	15	257	29,147	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		99	116	645	73,130	素材
LONZA GROUP AG		12	19	499	56,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA		675	800	6,759	765,948	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		484	572	4,768	540,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR		7	9	80	9,114	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG		3	4	297	33,678	各種金融
ROCHE HOLDING AG		152	180	4,161	471,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		3	4	105	11,987	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		8	10	230	26,141	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		1	1	340	38,616	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER		0.46	0.55	408	46,241	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン 千円	
SONOVA HOLDING AG-REG	10	13	222	25,229	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	–	2	170	19,372	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	6	8	292	33,105	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	6	8	277	31,457	保険
SWISS PRIME SITE-REG	14	18	157	17,878	不動産
SWISS RE AG	69	82	768	87,028	保険
SWISSCOM AG	5	6	352	39,980	電気通信サービス
SYNGENTA AG	20	–	–	–	素材
THE SWATCH GROUP AG-REG	9	12	87	9,916	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG	793	941	1,599	181,223	各種金融
VIFOR PHARMA AG	0.78	12	157	17,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	32	38	1,163	131,872	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,538 38	4,289 36	29,668 –	3,361,783 <3.2%>
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ	
A P MOLLER - MAERSK A/S	1	1	1,828	32,374	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S	0.70	0.90	900	15,939	運輸
CARLSBERG AS-B	23	27	2,024	35,850	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	19	25	1,474	26,105	素材
COLOPLAST-B	25	30	1,538	27,242	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	149	193	4,522	80,091	銀行
DSV A/S	43	51	2,483	43,986	運輸
GENMAB A/S	12	14	1,827	32,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	–	16	597	10,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	33	43	1,041	18,453	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S	415	479	15,383	272,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S	50	57	2,007	35,544	素材
ORSTED A/S	29	43	1,501	26,588	公益事業
PANDORA A/S	24	27	1,575	27,906	耐久消費財・アパレル
TDC A/S	165	211	797	14,123	電気通信サービス
TRYGVESTA AS	21	25	400	7,084	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	48	55	2,306	40,842	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING	23	27	495	8,768	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,086 17	1,334 18	42,704 –	756,302 <0.7%>
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ	
DNB ASA	212	251	3,835	52,118	銀行
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40	48	730	9,923	保険
MARINE HARVEST	75	106	1,599	21,734	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	261	342	2,046	27,806	素材
ORKLA ASA	160	210	1,713	23,292	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
SCHIBSTED ASA		15	18	439	5,973	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS		18	22	512	6,968	メディア
STATOIL ASA		245	294	4,827	65,605	エネルギー
TELENOR ASA		166	195	3,516	47,783	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		34	45	1,708	23,220	素材
小計	株数・金額	1,231	1,537	20,929	284,426	
	銘柄数<比率>	10	10	-	<0.3%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		58	76	1,588	21,132	資本財
ASSA ABLOY AB		218	259	4,412	58,679	資本財
ATLAS COPCO AB		84	100	3,290	43,758	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		146	173	6,341	84,343	資本財
BOLIDEN AB		53	69	1,941	25,824	素材
ELECTROLUX AB		48	62	1,779	23,672	耐久消費財・アパレル
ESSITY AKTIEBOLAG-B		-	157	3,887	51,700	家庭用品・パーソナル用品
GETINGE AB-B SHS		40	55	854	11,368	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		206	244	4,820	64,113	小売
HEXAGON AB-B SHS		57	67	2,840	37,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS		84	103	803	10,680	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB		16	19	584	7,777	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		33	38	794	10,570	各種金融
INVESTOR AB		98	117	4,707	62,607	各種金融
KINNEVIK AB - B		46	59	1,610	21,422	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS		7	9	607	8,077	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB		38	47	975	12,973	エネルギー
NORDEA BANK AB		662	785	7,696	102,357	銀行
SANDVIK AB		232	291	4,291	57,076	資本財
SECURITAS AB		63	80	1,135	15,096	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		333	395	3,935	52,336	銀行
SKANSKA AB-B SHS		67	87	1,590	21,159	資本財
SKF AB		81	97	1,805	24,016	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB		132	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
SVENSKA HANDELSBANKEN		334	397	4,551	60,534	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		198	235	4,604	61,238	銀行
SWEDISH MATCH AB		38	47	1,526	20,302	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB		77	97	1,044	13,892	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		668	794	4,093	54,448	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		589	697	2,614	34,776	電気通信サービス
VOLVO AB		337	401	6,361	84,601	資本財
小計	株数・金額	5,058	6,074	87,091	1,158,319	
	銘柄数<比率>	30	30	-	<1.1%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
			千ユーロ	千円		
(ユーロ／ベルギー)						
AGEAS	37	48	195	25,701	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	165	196	1,911	251,881	食品・飲料・タバコ	
COLRUYT NV	12	13	62	8,223	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15	20	182	24,020	各種金融	
KBC GROEP NV	54	64	433	57,156	銀行	
PROXIMUS	32	40	115	15,280	電気通信サービス	
SOLVAY SA	16	19	229	30,304	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV	11	14	82	10,828	メディア	
UCB SA	27	32	199	26,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE	18	48	187	24,770	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	392 10	498 10	3,601 -	474,481 <0.4%>	
(ユーロ／ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL	132	170	403	53,099	素材	
RTL GROUP	7	9	62	8,202	メディア	
TENARIS SA	92	121	147	19,441	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	233 3	301 3	612 -	80,743 <0.1%>	
(ユーロ／フランス)						
ACCOR	33	47	197	25,969	消費者サービス	
ADP	7	8	134	17,676	運輸	
AIR LIQUIDE	84	110	1,161	153,075	素材	
ALSTOM RGPT	30	39	133	17,653	資本財	
ARKEMA	13	17	183	24,186	素材	
ATOS SE	19	24	307	40,513	ソフトウェア・サービス	
AXA	419	498	1,252	165,039	保険	
BNP PARIBAS	229	288	1,822	240,175	銀行	
BOLLORE	190	235	98	13,002	運輸	
BOUYGUES	42	55	234	30,907	資本財	
BUREAU VERITAS SA	54	70	155	20,437	商業・専門サービス	
CAPGEMINI SA	35	41	413	54,543	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA	123	145	241	31,790	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON	11	13	62	8,277	食品・生活必需品小売り	
CHRISTIAN DIOR SE	11	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
CIE DE SAINT-GOBAIN	108	128	615	81,124	資本財	
CNP ASSURANCES	33	41	77	10,266	保険	
CREDIT AGRICOLE SA	243	293	412	54,344	銀行	
DANONE	128	152	1,050	138,456	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT AVIATION SA	0.46	0.61	79	10,464	資本財	
DASSAULT SYSTEMES SA	28	33	301	39,745	ソフトウェア・サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
(ユーロ/フランス)					
EDENRED	41	56	133	17,612	商業・専門サービス
EDF	55	140	143	18,898	公益事業
EIFFAGE	12	19	176	23,313	資本財
ENGIE	345	439	628	82,785	公益事業
ESSILOR INTERNATIONA	45	53	570	75,228	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	8	10	79	10,458	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	2	2	148	19,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	35	43	89	11,745	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	101	128	140	18,544	運輸
HERMES INTERNATIONAL	5	8	364	48,042	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	5	7	143	18,952	電気通信サービス
IMERYS SA	7	8	66	8,778	素材
INGENICO GROUP	11	14	123	16,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	-	9	98	12,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	15	19	62	8,300	メディア
KERING	16	19	754	99,442	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.	24	30	81	10,705	メディア
LEGRAND SA	58	68	427	56,332	資本財
L'OREAL SA	54	64	1,200	158,173	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	60	71	1,774	233,812	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	39	44	519	68,493	自動車・自動車部品
NATIXIS	186	242	158	20,871	各種金融
ORANGE S.A.	438	521	735	96,862	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	46	54	702	92,546	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	105	132	246	32,489	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	42	53	288	37,972	メディア
REMY COINTREAU	4	5	60	8,000	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	41	45	386	50,973	自動車・自動車部品
REXEL SA	60	76	114	15,062	資本財
SAFRAN SA	68	80	703	92,638	資本財
SANOFI	252	291	2,202	290,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	121	144	1,025	135,097	資本財
SCOR REGROUPE	31	44	153	20,179	保険
SEB SA	4	5	88	11,668	耐久消費財・アパレル
SFR GROUP SA	18	-	-	-	電気通信サービス
SOCIETE BIC SA	5	6	62	8,252	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE	166	197	853	112,450	銀行
SODEXO	19	23	249	32,885	消費者サービス
SUEZ	70	97	147	19,383	公益事業
THALES SA	23	27	242	31,978	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SA		493	606	2,809	370,173	エネルギー
VALEO SA		52	61	359	47,367	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT		104	125	262	34,548	公益事業
VINCI SA		110	130	1,103	145,399	資本財
VIVENDI SA		226	268	606	79,866	メディア
WENDEL		6	7	102	13,558	各種金融
ZODIAC SA		40	51	128	16,898	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,541	6,812	30,458	4,013,232	
		67	66	-	<3.8%>	
(ユーロ/ドイツ)						
ADIDAS AG		40	48	899	118,464	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		98	117	2,308	304,143	保険
AXEL SPRINGER SE		9	12	79	10,433	メディア
BASF SE		199	235	2,166	285,408	素材
BAYER AG		179	212	2,286	301,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		71	85	721	95,020	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		10	13	96	12,776	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG		21	25	247	32,552	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG		33	39	208	27,420	資本財
CECONOMY AG		34	-	-	-	食品・生活必需品小売り
COMMERZBANK AG		228	273	330	43,589	銀行
CONTINENTAL AG		23	28	605	79,782	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		13	28	232	30,598	素材
DAIMLER AG		208	247	1,706	224,834	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BANK AG		299	496	805	106,114	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		28	49	463	61,012	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		47	61	172	22,758	運輸
DEUTSCHE POST AG		213	253	988	130,252	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		716	849	1,275	168,110	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		76	91	342	45,088	不動産
E.ON SE		435	566	554	73,076	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG		31	40	127	16,736	素材
FRAPORT AG		9	11	90	11,972	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA		89	106	678	89,439	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD		13	16	74	9,862	素材
GEA GROUP AG		36	46	186	24,520	資本財
HANNOVER RUECK SE		11	14	162	21,453	保険
HEIDELBERGCEMENT AG		32	38	354	46,662	素材
HENKEL AG & CO KGAA		22	26	272	35,922	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG		38	45	518	68,312	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
(ユーロ/ドイツ)						
HOCHTIEF AG	3	4	68	9,028	資本財	
HUGO BOSS AG	13	15	108	14,277	耐久消費財・アパレル	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	245	291	708	93,409	半導体・半導体製造装置	
INNOGY SE	27	35	140	18,504	公益事業	
K+S AG	37	47	90	11,982	素材	
KION GROUP AG	-	18	121	15,955	資本財	
LANXESS	17	23	151	19,999	素材	
LINDE AG	40	47	896	118,086	素材	
MAN SE	6	8	80	10,652	資本財	
MERCK KGAA	28	33	300	39,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METRO AG	-	42	68	9,001	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	34	39	755	99,493	保険	
OSRAM LICHT AG	17	21	143	18,956	資本財	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	30	38	242	31,898	自動車・自動車部品	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	51	61	154	20,354	メディア	
RWE AG	99	133	259	34,150	公益事業	
SAP SE	213	252	2,433	320,694	ソフトウェア・サービス	
SCHAEFFLER AG	33	39	55	7,313	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG	165	196	2,257	297,467	資本財	
SYMRISE AG	25	31	227	29,949	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	152	185	76	10,072	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	78	94	208	27,429	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	24	31	178	23,475	ソフトウェア・サービス	
VOLKSWAGEN AG	6	7	128	16,882	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG	40	47	760	100,177	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE	101	121	478	63,039	不動産	
ZALANDO SE	17	28	117	15,526	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,791 55	5,987 56	30,168 -	3,974,972 <3.8%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	488	613	178	23,569	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	97	129	202	26,691	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	48	60	95	12,539	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	635 3	803 3	476 -	62,799 <0.1%>	
(ユーロ/スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	146	189	349	46,049	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	37	61	200	26,437	資本財	
AENA SME SA	15	18	295	38,926	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	95	112	680	89,713	ソフトウェア・サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ/スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	1,421	1,712	1,231	162,275	銀行	
BANCO DE SABADELL SA	1,153	1,367	224	29,570	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	660	-	-	-	銀行	
BANCO SANTANDER SA	3,161	4,124	2,260	297,864	銀行	
BANKIA SA	893	239	93	12,316	銀行	
BANKINTER SA	132	168	131	17,311	銀行	
CAIXABANK	774	920	362	47,796	銀行	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	121	147	60	7,958	食品・生活必需品小売り	
ENAGAS SA	45	56	134	17,683	エネルギー	
ENDESA SA	62	80	150	19,821	公益事業	
FERROVIAL S.A.	105	124	226	29,811	資本財	
GAS NATURAL SDG SA	69	89	160	21,122	公益事業	
GRIFOLS SA	60	76	193	25,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	1,201	1,474	953	125,690	公益事業	
INDITEX SA	235	280	819	108,036	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	169	163	109	14,415	運輸	
MAPFRE SA	200	247	68	8,975	保険	
RED ELECTRICA DE ESPANA	89	111	201	26,606	公益事業	
REPSOL SA	242	313	467	61,621	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	-	55	57	7,613	資本財	
TELEFONICA SA	990	1,172	1,000	131,864	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	35	-	-	-	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,120 25	13,310 24	10,435 -	1,374,940 <1.3%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	253	320	488	64,306	保険	
ATLANTIA SPA	95	122	332	43,837	運輸	
ENEL SPA	1,665	2,099	1,094	144,233	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	551	653	896	118,168	エネルギー	
INTESA SANPAOLO	2,925	3,461	959	126,429	銀行	
LEONARDO SPA	80	104	105	13,883	資本財	
LUXOTTICA GROUP SPA	37	44	212	28,001	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	112	144	143	18,852	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	104	127	77	10,272	保険	
PRYSMIAN SPA	38	53	150	19,844	資本財	
RECORDATI SPA	-	26	102	13,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAIPEM SPA	1,189	144	49	6,540	エネルギー	
SNAM SPA	535	591	249	32,880	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA	3,371	3,994	271	35,736	電気通信サービス	
TERNA SPA	316	371	192	25,382	公益事業	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

(注4) 業種は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	3	3	495	55,593	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	7	10	1,142	128,183	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	2	296	33,232	
PROLOGIS INC	11	13	903	101,315	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	21	27	315	35,389	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	3	655	73,574	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	2	217	24,383	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	3	159	17,930	
DUKE REALTY CORP	7	9	264	29,644	
EQUITY RESIDENTIAL	7	9	646	72,486	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	423	47,561	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	246	27,664	
GGP INC	12	15	376	42,191	
HCP INC	10	12	323	36,242	
WELLTOWER INC	7	9	640	71,852	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	16	19	378	42,502	
KIMCO REALTY CORP	9	10	210	23,636	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	3	165	18,533	
MACERICH CO/THE	2	3	198	22,317	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	2	300	33,658	
PUBLIC STORAGE	3	4	852	95,687	
REGENCY CENTERS CORP	3	3	266	29,951	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6	8	1,303	146,225	
SL GREEN REALTY CORP	2	2	263	29,615	
UDR INC	5	6	272	30,620	
VENTAS INC	7	9	588	66,029	
VORNADO REALTY TRUST	3	4	337	37,881	
REALTY INCOME CORP	5	7	397	44,602	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	3	283	31,804	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	4	489	54,924	
IRON MOUNTAIN INC	5	6	264	29,657	
AGNC INVESTMENT CORP	6	8	175	19,725	
AMERICAN TOWER REIT INC	9	10	1,599	179,443	
EQUINIX INC	1	2	948	106,458	
VEREIT	19	24	200	22,459	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6	7	143	16,047	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10	13	162	18,213	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2	3	519	58,273	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	241 38	297 38	17,430 -	1,955,518 <1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		1	1	50	4,441
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		2	3	77	6,772
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3	3	101	8,931
小計	口数・金額	7	9	229	20,145
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		21	28	279	23,710
GPT GROUP		39	51	272	23,078
GOODMAN GROUP		42	49	429	36,396
STOCKLAND		57	68	315	26,786
WESTFIELD CORP		45	53	441	37,413
MIRVAC GROUP		82	106	259	21,970
VICINITY CENTRES		73	95	259	21,998
SCENTRE GROUP		121	144	594	50,432
小計	口数・金額	484	599	2,851	241,786
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		48	57	4,004	57,507
小計	口数・金額	48	57	4,004	57,507
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		48	63	167	13,879
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		40	50	93	7,775
CAPITALAND MALL TRUST		49	60	125	10,380
SUNTEC REIT		48	62	123	10,187
小計	口数・金額	187	237	510	42,222
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		19	25	156	23,178
HAMMERSON PLC		15	20	107	15,881
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	19	177	26,261
SEGRO PLC		16	25	143	21,279
INTU PROPERTIES PLC		18	21	43	6,450
小計	口数・金額	88	111	628	93,051
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2017年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	108,449,652,570円
コーポレート債	2,678,255,491
株式(評価額)	99,573,624,213
投資信託証券(評価額)	2,551,322,711
未収入金	2,387,144,454
未収配当金	159,110,306
差入委託証拠金	1,100,195,395
(B)負債	2,836,031,782
未払金	2,410,021,624
未払解約金	426,007,429
その他未払費用	2,729
(C)純資産総額(A-B)	105,613,620,788
元本	63,730,699,122
次期繰越損益金	41,882,921,666
(D)受益権総口数	63,730,699,122口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,572円

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

損益の状況

当期 (2017年5月23日~2017年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	923,050,950円
受取配当金	921,295,345
受取利息	984,372
その他の収益	1,297,089
支払利息	△ 525,856
(B)有価証券売買損益	6,462,007,643
売却益	9,517,900,264
買入損	△ 3,055,892,621
(C)先物取引等損益	181,194,840
取引益	225,004,937
取引損	△ 43,810,097
(D)信託報酬等	△ 24,471,299
(E)当期損益金(A+B+C+D)	7,541,782,134
(F)前期繰越損益金	28,365,649,942
(G)追加信託差損益金	10,716,739,609
(H)解約差損益金	△ 4,741,250,019
(I)合計(E+F+G+H)	41,882,921,666
次期繰越損益金(I)	41,882,921,666

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