

第2期末 (2015年11月20日)	
基準価額	12,964円
純資産総額	190億円
騰落率	3.5%
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：2014年11月21日～2015年11月20日

第2期 (決算日 2015年11月20日)

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506**(コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

 <http://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。



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

### 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第2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。

今後とも是非ご継続頂き、いっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

# <購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド

## 運用経過

(2014年11月21日から2015年11月20日まで)

### 基準価額等の推移



第2期首	12,526円
第2期末	12,964円
既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	3.5%

- (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

### ■基準価額の主な変動要因

当期は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。原油価格の下落やギリシャのユーロ圏離脱懸念、中国経済の成長減速などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場は下落する場面もありましたが、ギリシャのユーロ圏残留が決定したことや、欧州中央銀行(ECB)総裁による金融緩和発言、中国人民銀行(中央銀行)による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢等が株式市場の上昇要因となり、基準価額も上昇しました。

# <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

## 1 万口当たりの費用明細

項目	第 2 期		項目の概要
	2014年11月21日~2015年11月20日		
	金額	比率	
信託報酬	54円	0.421%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は12,844円です。
(投信会社)	(24)	(0.184)	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)	(24)	(0.184)	
(受託銀行)	( 7)	(0.054)	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
売買委託手数料	1	0.010	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	( 1)	(0.006)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.004)	
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	3	0.020	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	( 3)	(0.020)	
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
その他費用	14	0.106	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数 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 ・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
(監査費用)	( 1)	(0.009)	
(その他)	(12)	(0.096)	
合計	71	0.557	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

# <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

## 最近5年間の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化しています。

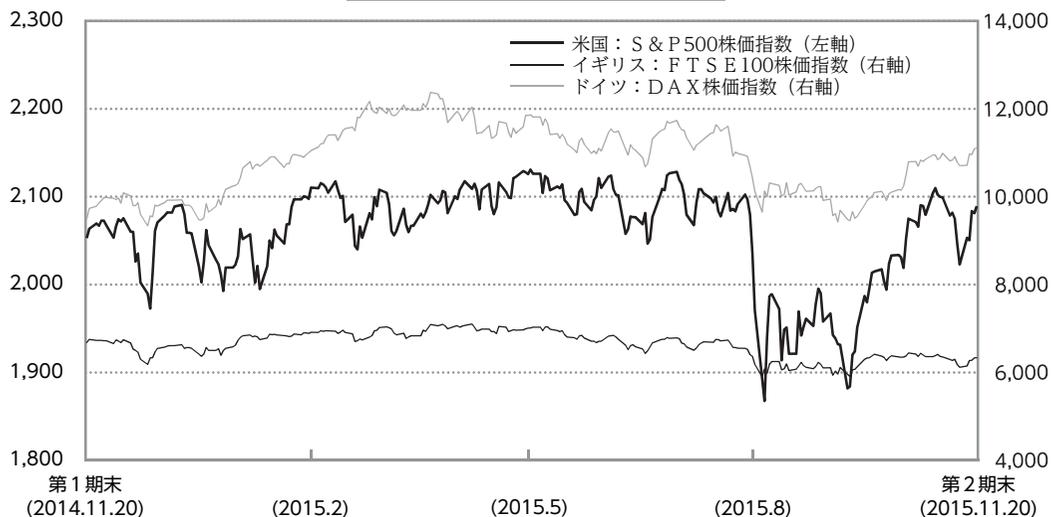
決算日		2013年12月10日	2014年11月20日	2015年11月20日
基準価額 (分配前)	(円)	10,000	12,526	12,964
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	0	0
税引前分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	25.3	3.5
ベンチマーク騰落率	(%)	—	25.9	3.6
純資産総額	(百万円)	27	5,755	19,029

(注1) 当ファンドの設定日は2013年12月10日です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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グのデータを使用しています。

期初は、石油輸出国機構（O P E C）が減産見送りを決定したことから原油安が進行したことを背景に、株式市場も下落しましたが、その後、12月中旬に米連邦公開市場委員会（F O M C）の声明を受けて、米国の利上げペースが緩やかになるとの見方が広がり市場は反発しました。

期央は、ギリシャにおいて債務問題が再燃したことから、ギリシャ政府とユーロ圏首脳間での交渉の進展状況に応じて株式市場も上下する展開となりました。7月上旬になると、ギリシャのユーロ圏離脱懸念が高まったことから市場は急落したものの、その後はギリシャ支援に関する合意が成立したことにより、反発しました。

8月中旬になると、中国経済の成長に対する懸念の高まりを発端として、世界的に株価が急落し、その後も投資家のリスク回避姿勢が強まり、市場は振れ幅の大きな展開となりました。

10月初旬以降は、E C B 総裁による金融緩和を示唆する発言や、中国人民銀行による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場は上昇基調となりました。

# <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

## ポートフォリオ

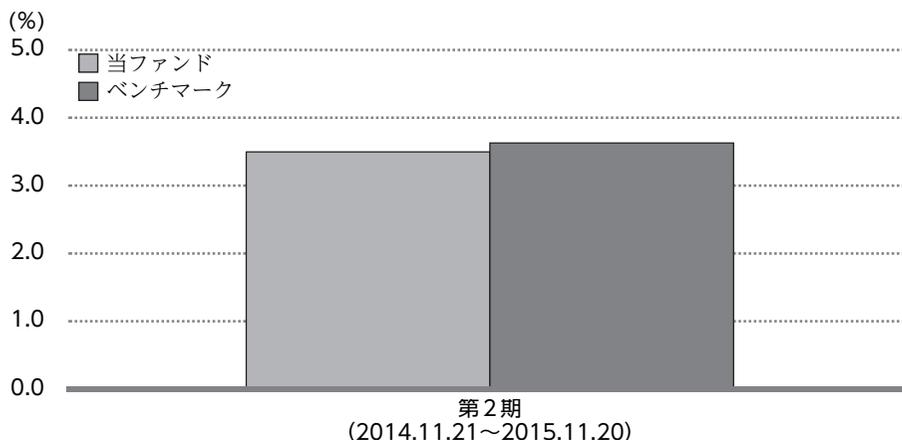
### ■当ファンド

マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保つ運用を行いました（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



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+3.5%となり、ベンチマーク騰落率（+3.6%）にほぼ連動しました。

# <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

## 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
	2014年11月21日 ～2015年11月20日
当期分配金（税引前）	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,964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。

# <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

## ファンドデータ

### 当ファンドの組入資産の内容

#### ■組入ファンド

	第2期末
	2015年11月20日
ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

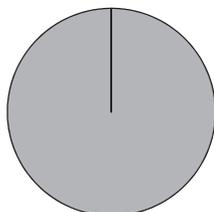
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

#### ■純資産等

項目	第2期末
	2015年11月20日
純資産総額	19,029,945,526円
受益権総口数	14,678,659,497口
1万口当たり基準価額	12,964円

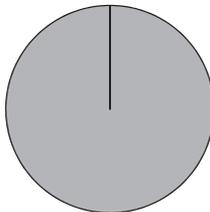
(注) 当期間中における追加設定元本額は14,317,781,361円、同解約元本額は4,234,346,844円です。

#### ■資産別配分



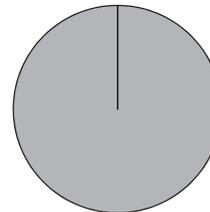
親投資信託受益証券  
100.0%

#### ■国別配分



日本  
100.0%

#### ■通貨別配分



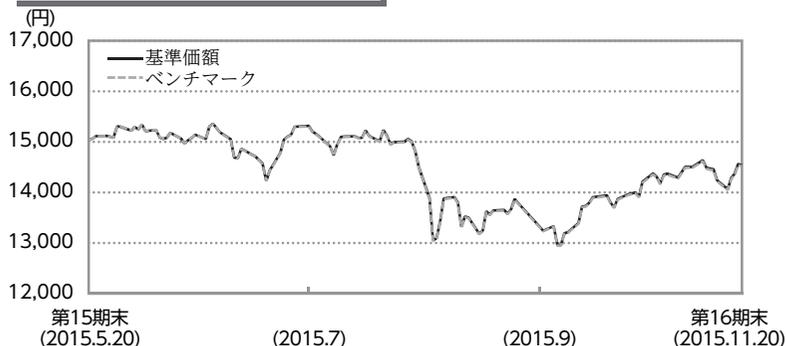
円  
100.0%

(注) 資産別・国別・通貨別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

# <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

## 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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。

### ■上位銘柄

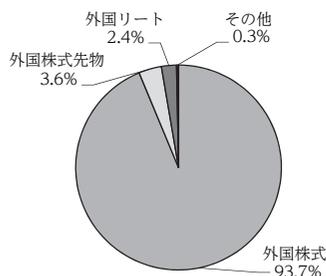
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米・ドル	2.2%
MICROSOFT CORP	米・ドル	1.3
EXXON MOBIL CORP	米・ドル	1.1
GENERAL ELECTRIC CO	米・ドル	1.0
JOHNSON & JOHNSON	米・ドル	0.9
WELLS FARGO & CO	米・ドル	0.9
AMAZON.COM INC	米・ドル	0.8
JPMORGAN CHASE & CO	米・ドル	0.8
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8
ALPHABET INC-CL C	米・ドル	0.7
組入銘柄数		1,315

### ■1万口当たりの費用明細

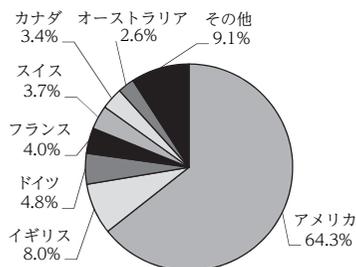
(2015.5.21~2015.11.20)

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	1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 (その他)	8 ( 8)
合計	10

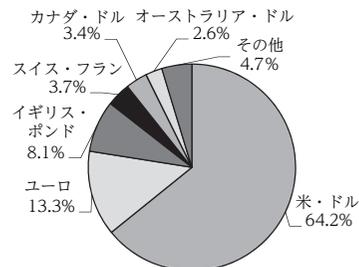
### ■資産別配分



### ■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

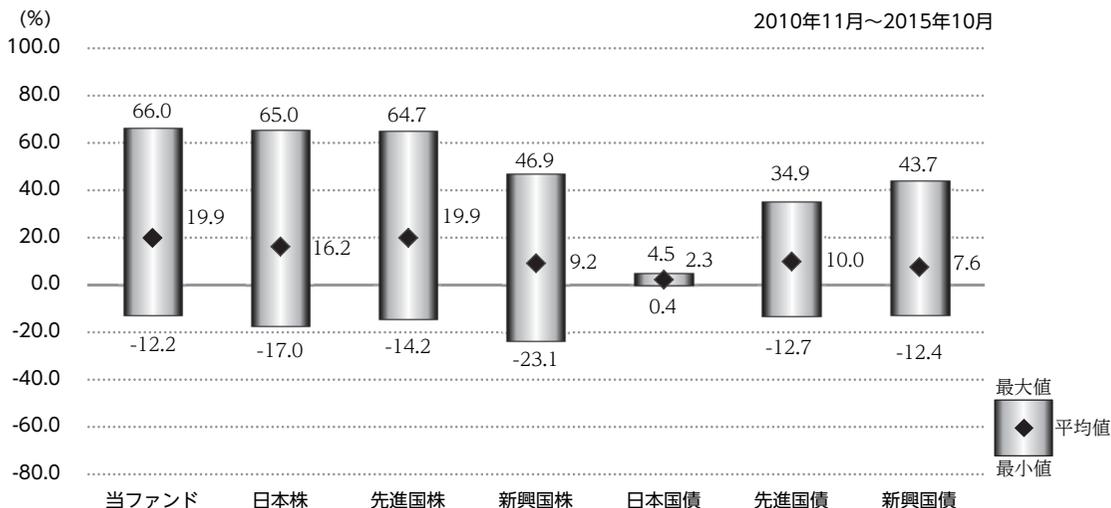
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

# <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

## 参考情報

### ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- (注1) 上記は、当ファンドの騰落率(税引前分配金再投資基準価額騰落率)と代表的な資産クラスの騰落率を比較したものであり、各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- (注2) 2010年11月～2015年10月の5年間における1年リターンの平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。
- (注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年分に満たないため、設定日以前のデータはファンドのベンチマークを用いて騰落率を算出しています。したがって、すべてがファンドの実績ではありません。

### <代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

- すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

・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は、株式会社東京証券取引所が有しています。

・MSCIコクサイ・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。

・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。

・NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、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、一切責任を負いません。

・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

◆設定以来の運用実績

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

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

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

(注4) ベンチマークは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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCI コクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

(注5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「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6) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		騰落率		騰落率			
（期首） 2014年11月20日	円 12,526	% —	12,589	% —	% 92.0	% 6.3	% 2.0
11月末	12,693	1.3	12,752	1.3	91.2	6.5	2.1
12月末	12,854	2.6	12,915	2.6	92.4	5.3	2.2
2015年1月末	12,312	△1.7	12,366	△1.8	94.2	3.1	2.4
2月末	13,009	3.9	13,071	3.8	92.9	4.6	2.2
3月末	12,983	3.6	13,046	3.6	94.2	3.2	2.3
4月末	13,097	4.6	13,168	4.6	93.0	2.8	2.2
5月末	13,674	9.2	13,752	9.2	94.7	2.9	2.3
6月末	13,128	4.8	13,203	4.9	94.0	3.5	2.2
7月末	13,493	7.7	13,570	7.8	92.8	4.9	2.2
8月末	12,419	△0.9	12,489	△0.8	90.9	7.4	2.2
9月末	11,564	△7.7	11,633	△7.6	94.3	2.9	2.5
10月末	12,822	2.4	12,902	2.5	92.6	4.9	2.4
（期末） 2015年11月20日	12,964	3.5	13,046	3.6	93.7	3.6	2.4

(注) 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

(2014年11月21日～2015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	12,794,845	18,296,658	3,817,940	5,443,501

(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	26,984,747千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,438,202千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.59

(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

(2014年11月21日～2015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

(2015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	4,116,642	13,093,548	19,030,162

(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35,008,790千口です。

◆投資信託財産の構成

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	千円 19,030,162	%
コール・ローン等、その他	91,484	0.5
投資信託財産総額	19,121,647	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122.96円、1カナダ・ドル92.42円、1オーストラリア・ドル88.42円、1香港・ドル15.87円、1シンガポール・ドル86.96円、1ニュージーランド・ドル80.65円、1イギリス・ポンド187.85円、1イスラエル・シェケル31.74円、1スイス・フラン121.18円、1デンマーク・クローネ17.66円、1ノルウェー・クローネ14.27円、1スウェーデン・クローナ14.15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(50,614,764千円)の投資信託財産総額(51,134,326千円)に対する比率は99.0%です。
- (注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	19,121,647,612円
コール・ローン等	30,483,366
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	19,030,162,875
未 収 入 金	61,001,371
(B) 負 債	91,702,086
未 払 解 約 金	60,351,008
未 払 信 託 報 酬	30,747,264
そ の 他 未 払 費 用	603,814
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	19,029,945,526
元 本	14,678,659,497
次 期 繰 越 損 益 金	4,351,286,029
(D) 受 益 権 総 口 数	14,678,659,497口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,964円

- (注) 期首元本額 4,595,224,980円  
 期中追加設定元本額 14,317,781,361円  
 期中一部解約元本額 4,234,346,844円

◆損益の状況

当期 (2014年11月21日～2015年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,270円
受 取 利 息	5,270
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	401,681,791
売 買 益	597,388,715
売 買 損	△ 195,706,924
(C) 信 託 報 酬 等	△ 48,552,174
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	353,134,887
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	484,769,157
( 配 分 準 備 積 立 金 )	( 484,769,157)
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金 *	3,513,381,985
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,108,885,405)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 1,404,496,580)
(G) 合 計 (D+E+F)	4,351,286,029
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	4,351,286,029
追 加 信 託 差 損 益 金	3,513,381,985
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,136,601,980)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 1,376,780,005)
分 配 準 備 積 立 金	837,904,044

- (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

---

計算期間末における信託報酬等控除後の配当等収益（225,496,864円）、信託報酬等控除後の有価証券売買等損益（127,638,023円）、追加信託差損益金（3,513,381,985円）、および分配準備積立金（484,769,157円）より、分配対象収益は4,351,286,029円（1万口当たり2,964.36円）ですが、当期の収益分配は見送らせていただきました。

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

## お知らせ

### ■運用体制の変更について

運用部門の担当役員2名（取締役執行役員CO-CIO、執行役員CO-CIO）のうち1名（取締役執行役員CO-CIO）が担当をはずれました。

なお、残る1名については同日付で執行役員CO-CIOから取締役執行役員CIOに昇任しています。  
(2015年3月25日)

### ■約款変更

「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに一般社団法人投資信託協会規則の改正に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。  
(2014年12月1日)

### ■関連会社の実質保有比率

2015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32.2%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。

# <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

## 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	主にニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標とします。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	日本を除く世界主要先進国の株式
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16期

(計算期間：2015年5月21日～2015年11月20日)

#### ●受益者の皆様へ

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主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
組入制限	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

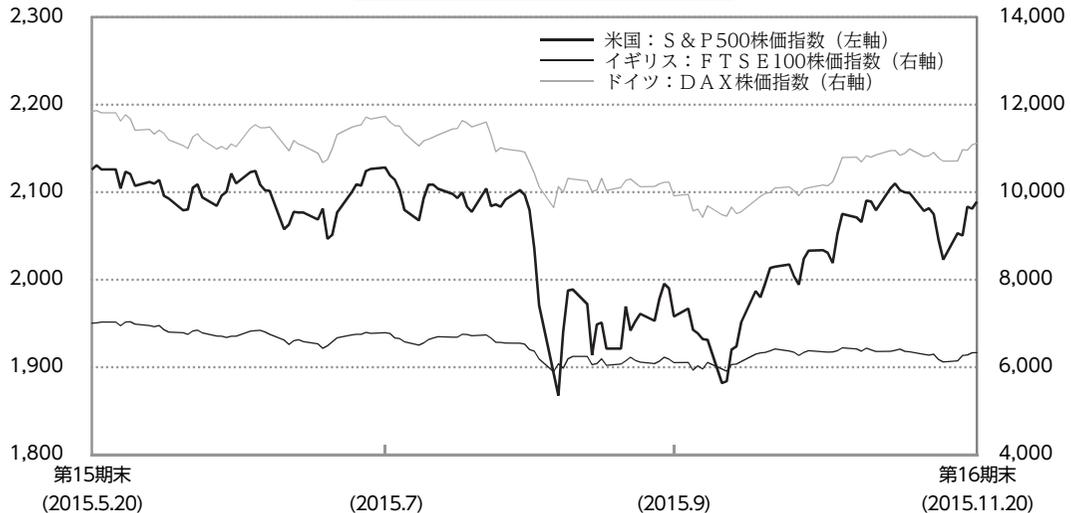
東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

(2015年5月21日から2015年11月20日まで)

## 海外株式市況

## 海外主要株価指数の推移



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

期前半は、ギリシャにおいて債務問題が再燃したことから、ギリシャ政府とユーロ圏首脳間での交渉の進展状況に応じて株式市場も上下する展開となりました。7月上旬になると、ギリシャのユーロ圏離脱懸念が高まったことから市場は急落したものの、その後はギリシャ支援に関する合意が成立したことにより、反発しました。

期後半は、8月中旬にかけて中国経済の成長に対する懸念の高まりを発端として、世界的に株価が急落し、その後も投資家のリスク回避姿勢が強まり、市場は振れ幅の大きな展開となりました。

10月初旬以降は、欧州中央銀行（ECB）総裁による金融緩和を示唆する発言や、中国人民銀行（中央銀行）による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場は上昇基調となりましたが、期を通じて見ると下落して当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



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

## ■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。ギリシャのユーロ圏離脱懸念や中国経済の成長減速などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場は急落しました。その後、ギリシャのユーロ圏残留が決定したことや、ECB総裁による金融緩和発言、中国人民銀行による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場が上昇基調になったことを受けて基準価額も反転したものの、期を通じて見ると下落して当期末を迎えました。

## 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-3.3%となり、ベンチマーク騰落率（-3.5%）にほぼ連動しました。

## 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。

◆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	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
12期(2013年11月20日)	10,799	5.9	10,689	5.7	96.2	1.7	1.7	23,323
13期(2014年5月20日)	11,673	8.1	11,539	8.0	94.9	2.7	2.0	35,874
14期(2014年11月20日)	13,982	19.8	13,847	20.0	92.0	6.3	2.0	43,928
15期(2015年5月20日)	15,035	7.5	14,862	7.3	93.9	3.6	2.2	52,091
16期(2015年11月20日)	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4	50,880

(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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率	株式先物 比	投資信託 証券 組入比率
		騰落率		騰落率			
(期首) 2015年5月20日	円	%		%	%	%	%
	15,035	-	14,862	-	93.9	3.6	2.2
5月末	15,298	1.7	15,126	1.8	94.7	2.9	2.3
6月末	14,693	△ 2.3	14,522	△ 2.3	94.0	3.5	2.2
7月末	15,107	0.5	14,925	0.4	92.8	4.9	2.2
8月末	13,909	△ 7.5	13,737	△ 7.6	90.9	7.4	2.2
9月末	12,956	△ 13.8	12,795	△ 13.9	94.3	2.9	2.5
10月末	14,371	△ 4.4	14,191	△ 4.5	92.6	4.9	2.4
(期末) 2015年11月20日							
	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2015年5月21日～2015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 7,613 ( 771)	千米・ドル 44,401 (△ 846)	百株 6,766	千米・ドル 39,629
	カ ナ ダ	978 ( 13)	千カナダ・ドル 3,349 (△ 0.060)	596	千カナダ・ドル 2,757
	オーストラリア	1,927 ( 218)	千オーストラリア・ドル 2,647 (△ 2)	1,187	千オーストラリア・ドル 1,981
	香 港	1,847 ( 380)	千香港・ドル 5,488	1,066	千香港・ドル 5,646
	シンガポール	1,024 ( 1)	千シンガポール・ドル 439	328	千シンガポール・ドル 268
	ニュージーランド	335	千ニュージーランド・ドル 114	160	千ニュージーランド・ドル 27
	イ ギ リ ス	7,468 (21,756)	千イギリス・ポンド 4,116 (△ 6)	41,174	千イギリス・ポンド 3,189
	イ ス ラ エ ル	124	千イスラエル・シケル 781	18	千イスラエル・シケル 434
	ス イ ス	406 ( 9)	千スイス・フラン 2,820 (△ 19)	351	千スイス・フラン 2,262
	デ ン マ ー ク	110	千デンマーク・クローネ 3,475	81	千デンマーク・クローネ 3,028
	ノ ル ウ ェ ー	109	千ノルウェー・クローネ 1,242	67	千ノルウェー・クローネ 938
	ス ウ ェ ー デ ン	504 ( 89)	千スウェーデン・クローナ 6,701	613	千スウェーデン・クローナ 5,762

## 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	462	102	456	80
		オランダ	423 ( 89)	860 ( 0.000)	364	689
		ベルギー	38	311	30	252
		ルクセンブルグ	24 (△ 11)	35 (△0.000)	10	18
		フランス	725 (△ 24)	2,647 (△0.599)	501	1,951
		ドイツ	528 ( 81)	2,429 (△ 34)	495	1,920
		ポルトガル	1,043	33	26	8
		スペイン	1,484 ( 5,430)	1,071 ( 45)	5,743	746
		イタリア	1,637 ( 26)	663 (△ 2)	1,149	525
		フィンランド	141	205	116	144
		オーストリア	14	42	120	51
その他	4 ( 21)	36	26	156		

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

### (2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外       国	(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
	BOSTON PROPERTIES INC	0.332	40	0.318	39
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	0.764	63	0.732	58
	PROLOGIS INC	1	49	1	44
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	1	15	1	10
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.288	48	0.294	49
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.139	10	0.057	4
	DUKE REALTY CORP	0.583	11	0.224	4

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	
外	(アメリカ)		千口		千口	
	EQUITY RESIDENTIAL	1	79	0.794	58	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.154	33	0.125	27	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.118	15	0.079	10	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	1	45	1	29	
	HCP INC	1	38	0.946	35	
	WELLTOWER INC	1	75	0.763	52	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1	30	1	29	
	KIMCO REALTY CORP	0.500	11	0.515	12	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.227	7	—	—	
	MACERICH CO/THE	0.193	14	0.320	25	
	PLUM CREEK TIMBER CO	0.288	11	0.114	4	
	PUBLIC STORAGE	0.353	72	0.321	65	
	RAYONIER INC	—	—	1	39	
	REGENCY CENTERS CORP	0.161	9	0.062	3	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.745	137	0.683	124	
	SL GREEN REALTY CORP	0.216	23	0.190	21	
	UDR INC	0.458	14	0.296	10	
	VENTAS INC	0.797	47	0.722	43	
	VORNADO REALTY TRUST	0.363	34	0.351	33	
	REALTY INCOME CORP	0.419	18	0.371	17	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	111	0.072	5	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.236	15	0.154	10	
	IRON MOUNTAIN INC	0.772	27	0.129	4	
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	0.539	10	0.225	4	
	AMERICAN TOWER REIT INC	1	127	0.921	83	
	EQUINIX INC	0.136	37	0.109	29	
		(0.020)	(5)			
	VEREIT	1	9	0.585	4	
	国	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2	63	—	—
		COMMUNICATIONS SALES & LE	0.102	2	—	—
		CARE CAPITAL PROPERTIES INC	—	—	1	35
		(1)				
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		—	—	0.510	10	
	(0.510)	(11)				
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT—UTS	0.392	8	—	—		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.375	9	—	—		

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
外	(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
	DEXUS PROPERTY GROUP	2	20	0.706	5
	NOVION PROPERTY GROUP	—	—	31	79
	GPT GROUP	4	19	1	5
	GOODMAN GROUP	3	21	2	13
	STOCKLAND	4	19	2	11
	WESTFIELD CORP	4	41	3	38
	MIRVAC GROUP	7	14	2	4
	VICINITY CENTRES	31	89	2	6
	SCENTRE GROUP	11	45	10	42
	(香港)		千香港・ドル		千香港・ドル
	LINK REIT	5	222	5	221
	(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	4	9 (△0.011)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	3	5	—	—
	CAPITALAND MALL TRUST	4	9	—	—
	SUNTEC REIT	4	7 (△0.140)	—	—
国	(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	1	16	1	16
	HAMMERSON PLC	1	8	0.508	3
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1	21	1	20
	SEGRO PLC	1	7	—	—
	INTU PROPERTIES PLC	1	5	—	—
	(ユーロ/フランス)		千ユーロ		千ユーロ
	UNIBAIL—RODAMCO SE	0.228	54	0.215	48
	KLEPIERRE	0.551	22	0.123	4
	GECINA SA	0.154	18	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	0.093	7	—	—
	ICADE	0.031	2	—	—

(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。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (3) 先物取引の種類別取引状況

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 13,259	百万円 13,262	百万円 —	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## ◆主要な売買銘柄

(2015年5月21日～2015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
APPLE INC	12	174,496	14,536	APPLE INC	12	183,486	14,360
MICROSOFT CORP	15	89,588	5,688	MICROSOFT CORP	16	92,587	5,483
EXXON MOBIL CORP	9	88,344	9,697	EXXON MOBIL CORP	9	89,613	9,533
GENERAL ELECTRIC CO	23	75,540	3,212	JOHNSON & JOHNSON	6	71,036	11,590
FACEBOOK INC—A	6	73,170	11,153	WELLS FARGO & CO	10	69,635	6,439
WELLS FARGO & CO	10	72,885	6,734	GENERAL ELECTRIC CO	22	68,995	3,135
JOHNSON & JOHNSON	6	72,279	11,925	NESTLE SA	7	63,702	9,042
ALPHABET INC—CL C	0.922	67,886	73,629	JPMORGAN CHASE & CO	8	62,043	7,640
NESTLE SA	7	66,798	9,068	PFIZER INC	15	61,665	4,037
JPMORGAN CHASE & CO	8	66,067	8,104	NOVARTIS AG	4	57,445	11,505

(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

(2015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	79	83	1,322	162,611	資本財
ABBOTT LABORATORIES	196	195	896	110,193	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	208	226	1,372	168,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	82	82	884	108,813	ソフトウェア・サービス
ACE LTD	43	42	495	60,948	保険
ACTIVISION BLIZZARD INC	66	68	252	31,099	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	—	5	133	16,407	資本財
ADOBE SYSTEMS INC	61	65	604	74,353	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	21	24	81	10,072	商業・専門サービス
ADVANCE AUTO PARTS	9	9	160	19,685	小売
AES CORP	88	92	88	10,868	公益事業
AETNA INC	45	46	459	56,511	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7	7	129	15,883	各種金融
AFLAC INC	58	56	371	45,671	保険
AGCO CORP	10	11	54	6,645	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44	45	173	21,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27	26	376	46,276	素材
AIRGAS INC	8	9	127	15,729	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	23	23	138	17,028	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	13	15	79	9,829	素材
ALCOA INC	157	174	152	18,799	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	25	29	515	63,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	19	20	146	18,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	2	2	110	13,558	保険
ALLERGAN PLC	48	51	1,562	192,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8	8	239	29,476	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	14	15	94	11,573	公益事業
ALLSTATE CORP	55	53	340	41,881	保険
ALLY FINANCIAL INC	54	58	112	13,861	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	10	105	12,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	36	37	2,886	354,893	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	38	40	2,999	368,808	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	40	40	214	26,316	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	257	259	1,489	183,117	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	51	52	3,449	424,111	小売
AMEREN CORPORATION	33	33	144	17,780	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	23	23	100	12,306	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	63	64	365	44,930	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	121	120	874	107,526	各種金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	182	175	1,086	133,604	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24	24	138	16,971	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		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	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24	23	273	33,659	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	28	27	273	33,576	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	35	36	134	16,493	各種金融
AMETEK INC	33	32	181	22,287	資本財
AMGEN INC	99	100	1,597	196,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	41	41	227	28,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	66	66	398	49,016	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	41	42	252	31,028	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	11	12	110	13,624	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	6	11	26	3,260	エネルギー
ANTHEM INC	35	34	445	54,821	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	35	36	347	42,672	保険
APACHE CORP	49	50	250	30,798	エネルギー
APPLE INC	766	759	9,018	1,108,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	159	161	294	36,249	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	—	30	99	12,188	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16	16	124	15,364	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	84	81	297	36,556	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	12	12	73	9,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	22	98	12,093	保険
ASHLAND INC	8	8	98	12,100	素材
ASSURANT INC	8	8	77	9,470	保険
AT&T INC	678	811	2,728	335,463	電気通信サービス
AUTODESK INC	30	30	190	23,397	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	12	11	149	18,418	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	62	61	534	65,689	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	8	10	65	8,069	小売
AUTOZONE INC	4	4	326	40,137	小売
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	33	34	428	52,730	半導体・半導体製造装置
EVERETT DENNISON CORP	11	12	83	10,257	素材
AVNET INC	17	18	83	10,231	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVON PRODUCTS INC	52	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	20	60	7,425	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	11	13	76	9,357	保険
BAKER HUGHES INC	53	53	274	33,726	エネルギー
BALL CORP	16	17	122	15,090	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,372	1,383	2,446	300,846	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	147	147	646	79,471	各種金融
BARD (C.R.) INC	10	9	181	22,351	ヘルスケア機器・サービス
BAXALTA INC -W/I	—	71	245	30,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	70	71	270	33,245	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	94	102	394	48,469	銀行
BE AEROSPACE INC	13	15	68	8,371	資本財
BECTON DICKINSON & CO	26	27	412	50,781	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	24	22	119	14,748	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	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	150	153	2,097	257,880	各種金融
BEST BUY CO INC	39	41	126	15,586	小売
BIOGEN INC	30	30	896	110,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20	21	217	26,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	17	16	581	71,529	各種金融
BOEING CO	88	86	1,292	158,879	資本財
BORGWARNER INC	30	30	128	15,825	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	173	176	310	38,211	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	217	219	1,470	180,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM CORP	70	72	384	47,289	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP -CL B	16	16	172	21,152	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	19	18	123	15,238	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	19	19	134	16,530	運輸
CA Inc	44	44	124	15,339	ソフトウェア・サービス
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	24	27	84	10,431	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	55	56	115	14,171	エネルギー
CALPINE CORP	42	48	69	8,599	公益事業
CAMERON INTERNATIONAL CORP	25	25	175	21,639	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	26	25	125	15,401	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72	71	571	70,276	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	43	43	380	46,758	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	28	28	158	19,497	小売
CARNIVAL CORP	51	54	281	34,570	消費者サービス
CATERPILLAR INC	75	75	528	64,977	資本財
CBRE GROUP INC	40	40	146	17,984	不動産
CBS CORP-CL B	63	60	312	38,420	メディア
CDK GLOBAL INC	—	18	89	11,039	ソフトウェア・サービス
CELANESE CORP-SERIES A	19	20	148	18,283	素材
CELGENE CORP	104	104	1,192	146,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	—	15	83	10,220	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	53	55	94	11,650	公益事業
CENTURYLINK INC	77	76	217	26,780	電気通信サービス
CERNER CORP	40	40	235	28,926	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6	31	147	18,169	素材
CHARLES SCHWAB CORP	153	155	513	63,193	各種金融
CHARTER COMMUNICATION-A	10	11	212	26,067	メディア
CHENIERE ENERGY INC	30	29	147	18,153	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	66	83	45	5,564	エネルギー
CHEVRON CORP	247	247	2,247	276,341	エネルギー
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	11	13	58	7,184	資本財
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4	4	250	30,828	消費者サービス
CHUBB CORP	31	30	395	48,631	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	18	17	147	18,124	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	34	33	433	53,299	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	11	12	145	17,923	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	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19	21	127	15,701	保険
CINTAS CORP	12	13	120	14,842	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	668	670	1,836	225,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	22	23	99	12,216	銀行
CITIGROUP INC	395	399	2,201	270,637	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	57	150	18,541	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	21	21	156	19,260	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	17	17	220	27,118	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	41	42	410	50,485	各種金融
CMS ENERGY CORP	36	37	134	16,537	公益事業
COACH INC	36	37	109	13,497	耐久消費財・アパレル
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	34	40	31	3,905	エネルギー
COCA-COLA CO	514	545	2,350	289,074	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	30	28	146	18,010	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	79	80	524	64,488	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	118	113	751	92,443	家庭用品・パーソナル用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP -W/I	—	42	82	10,141	エネルギー
COMCAST CORP	284	279	1,752	215,523	メディア
COMCAST CORP	52	53	333	41,008	メディア
COMERICA INC	22	23	110	13,532	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	18	18	131	16,130	ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	56	57	236	29,093	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	15	16	176	21,669	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	160	162	869	106,860	エネルギー
CONSOL ENERGY INC	28	31	24	3,063	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	39	38	245	30,201	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22	22	310	38,215	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	11	12	44	5,515	エネルギー
COOPER COS INC/THE	6	6	94	11,597	ヘルスケア機器・サービス
CORE LABORATORIES N.V.	5	6	68	8,426	エネルギー
CORNING INC	167	165	313	38,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	57	57	943	115,984	食品・生活必需品小売り
CREE INC	14	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CROWN HOLDINGS INC	17	19	97	12,025	素材
CSX CORP	131	131	385	47,370	運輸
CUMMINS INC	22	22	223	27,427	資本財
CVS HEALTH CORP	149	148	1,374	168,973	食品・生活必需品小売り
D&B CORP	4	5	54	6,733	商業・専門サービス
DANAHER CORP	82	80	783	96,381	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	17	15	83	10,251	消費者サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	22	23	170	20,911	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	44	41	314	38,646	資本財
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	38	38	319	39,303	自動車・自動車部品
DELTA AIR LINES INC	27	28	136	16,743	運輸
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	17	18	114	14,114	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	
DEVON ENERGY CORPORATION	50	52	240	29,619	エネルギー
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	8	—	—	—	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	11	13	49	6,113	小売
DIRECTV	57	—	—	—	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	59	58	335	41,206	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15	19	60	7,380	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	39	38	112	13,772	メディア
DISH NETWORK CORP	29	30	193	23,841	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	40	40	250	30,824	小売
DOLLAR TREE INC	27	30	201	24,798	小売
DOMINION RESOURCES INC/VA	76	78	538	66,275	公益事業
DOVER CORP	22	21	140	17,268	資本財
DOW CHEMICAL CO	153	155	827	101,746	素材
DR HORTON INC	41	44	142	17,514	耐久消費財・アパレル
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	26	25	231	28,423	食品・飲料・タバコ
DTE ENERGY COMPANY	23	24	196	24,171	公益事業
DUKE ENERGY CORP	92	91	625	76,922	公益事業
E*TRADE FINANCIAL	—	39	117	14,464	各種金融
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	19	20	142	17,488	素材
EATON CORP PLC	62	61	348	42,838	資本財
EATON VANCE CORP	14	16	61	7,610	各種金融
EBAY INC	146	144	415	51,029	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	35	35	417	51,309	素材
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	7	8	69	8,583	家庭用品・パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	41	43	259	31,941	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14	14	226	27,801	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	118	119	798	98,136	素材
ELECTRONIC ARTS INC	41	41	294	36,262	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	131	131	1,103	135,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMC CORP/MASSACHUSETTS	265	255	640	78,727	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMERSON ELECTRIC CO	90	87	440	54,161	資本財
ENDO INTERNATIONAL PLC	22	27	162	19,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENERGEN CORP	9	11	63	7,839	エネルギー
ENSCO PLC	28	32	55	6,829	エネルギー
ENTERGY CORP	24	24	159	19,583	公益事業
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	25	64	7,919	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	71	72	597	73,465	エネルギー
EQT CORP	20	19	118	14,588	エネルギー
EQUIFAX INC	16	16	177	21,820	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	30	30	256	31,508	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	5	6	111	13,726	保険
EVERSOURCE ENERGY	43	43	220	27,080	公益事業
EXELON CORP	112	113	320	39,372	公益事業
EXPEDIA INC	13	13	177	21,845	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	25	26	132	16,253	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	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	95	95	801	98,553	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	553	550	4,422	543,753	エネルギー
F5 NETWORKS INC	9	9	101	12,480	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	261	281	2,992	367,983	ソフトウェア・サービス
FAMILY DOLLAR STORES	13	—	—	—	小売
FASTENAL CO	37	36	144	17,719	資本財
FEDEX CORP	35	35	586	72,127	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	38	37	247	30,412	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	109	108	221	27,252	銀行
FIREEYE INC	10	15	35	4,359	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	16	19	128	15,828	銀行
FIRSTENERGY CORP	56	57	178	21,893	公益事業
FISERV INC	32	31	302	37,212	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10	10	154	19,009	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	72	76	84	10,418	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	17	19	58	7,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWERVE CORP	16	18	82	10,151	資本財
FLUOR CORP	20	19	95	11,795	資本財
FMC CORP	16	18	79	9,828	素材
FMC TECHNOLOGIES INC	30	31	103	12,755	エネルギー
FNF GROUP	—	34	120	14,844	保険
FOOT LOCKER INC	18	18	113	13,905	小売
FORD MOTOR CO	468	488	711	87,489	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	—	21	117	14,492	資本財
FOSSIL GROUP INC	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FRANKLIN RESOURCES INC	53	53	222	27,352	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	137	142	120	14,762	素材
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	—	15	52	6,509	半導体・半導体製造装置
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	127	157	77	9,580	電気通信サービス
GAMESTOP CORP-CLASS A	13	15	58	7,140	小売
GAP INC	30	33	84	10,415	小売
GARMIN LTD	13	16	59	7,292	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	—	11	99	12,239	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	36	36	535	65,809	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,312	1,327	4,018	494,151	資本財
GENERAL MILLS INC	79	78	447	54,980	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	167	190	687	84,578	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	20	20	181	22,283	小売
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	61	—	—	—	保険
GILEAD SCIENCES INC	197	193	2,062	253,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51	51	988	121,499	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	36	123	15,128	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	35	36	134	16,542	消費者サービス
HALLIBURTON CO	110	111	425	52,363	エネルギー
HANESBRANDS INC	53	54	166	20,485	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	
HARLEY-DAVIDSON INC	28	27	135	16,659	自動車・自動車部品
HARMAN INTERNATIONAL	—	9	96	11,866	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	13	16	140	17,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	57	54	252	31,099	保険
HASBRO INC	13	15	114	14,092	耐久消費財・アパレル
HCA HOLDINGS INC	39	43	286	35,176	ヘルスケア機器・サービス
HELMERICH & PAYNE	13	15	82	10,197	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	11	11	173	21,276	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	20	20	172	21,155	食品・飲料・タバコ
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	60	52	88	10,903	運輸
HESS CORP	35	34	207	25,561	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	239	329	40,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	52	66	155	19,146	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	22	24	125	15,443	エネルギー
HOLOGIC INC	27	32	128	15,812	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	172	171	2,171	267,003	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	96	97	1,027	126,380	資本財
HORMEL FOODS CORP	18	19	134	16,548	食品・飲料・タバコ
HOSPIRA INC	22	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HP INC	244	239	329	40,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUDSON CITY BANCORP INC	60	—	—	—	銀行
HUMANA INC	20	19	314	38,695	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105	108	127	15,705	銀行
IHS INC-CLASS A	8	9	112	13,800	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	48	43	403	49,624	資本財
ILLUMINA INC	18	19	330	40,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	20	21	247	30,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	35	35	209	25,710	資本財
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	10	—	—	—	公益事業
INTEL CORP	632	624	2,143	263,561	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	14	14	385	47,427	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	122	123	1,684	207,159	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	10	10	129	15,909	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	54	54	224	27,634	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	55	56	132	16,273	メディア
INTUIT INC	35	34	336	41,386	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	4	4	244	30,004	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	57	57	191	23,506	各種金融
ISIS PHARMACEUTICALS INC	14	16	104	12,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16	17	74	9,212	資本財
JARDEN CORP	23	25	115	14,252	耐久消費財・アパレル
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	8	8	119	14,713	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	12	13	103	12,766	運輸
JM SMUCKER CO	13	13	165	20,340	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	366	365	3,744	460,420	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 INC	87	86	393	48,387	自動車・自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	—	6	98	12,095	不動産
JOY GLOBAL INC	12	—	—	—	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	488	488	3,307	406,664	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	50	48	146	17,980	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	14	14	137	16,961	運輸
KELLOGG CO	35	35	236	29,112	食品・飲料・タバコ
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	16	15	74	9,119	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	115	109	143	17,686	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	48	48	583	71,804	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	235	242	573	70,560	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	22	21	144	17,743	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	27	27	123	15,143	小売
KRAFT FOODS GROUP INC	77	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	—	78	575	70,754	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	60	122	458	56,369	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	33	32	302	37,156	小売
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11	11	139	17,125	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	13	13	161	19,878	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	21	22	171	21,078	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	53	53	246	30,317	消費者サービス
LEAR CORP	—	10	130	16,025	自動車・自動車部品
LEGG MASON INC	12	14	61	7,593	各種金融
LEGETT & PLATT INC	17	18	84	10,390	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	22	23	118	14,580	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	38	44	80	9,890	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	38	41	208	25,627	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	28	31	132	16,272	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	88	83	338	41,627	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC A	55	59	157	19,339	小売
LIBERTY MEDIA CORP	8	11	47	5,827	メディア
LIBERTY MEDIA CORP - C	30	30	118	14,539	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	34	33	187	23,089	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	31	32	147	18,153	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	14	14	363	44,702	ソフトウェア・サービス
LKQ CORP	37	41	121	14,898	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	35	35	793	97,557	資本財
LOEWS CORP	45	38	144	17,769	保険
LORILLARD INC	40	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LOWE'S COS INC	129	124	915	112,628	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	13	15	72	8,927	耐久消費財・アパレル
LYONDELBASELL INDU-CL A	55	52	493	60,662	素材
M&T BANK CORP	15	21	264	32,480	銀行
MACY'S INC	46	44	171	21,045	小売
MALLINCKRODT PLC	15	15	95	11,731	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	
MANPOWER GROUP	9	10	95	11,730	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	89	90	159	19,571	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	36	71	399	49,134	エネルギー
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	30	29	214	26,385	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	70	70	393	48,440	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7	7	125	15,404	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48	58	51	6,322	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	46	47	141	17,367	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	130	132	1,308	160,935	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	41	45	110	13,564	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	36	39	156	19,277	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14	15	132	16,323	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	127	126	1,430	175,841	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	35	36	347	42,691	各種金融
MCKESSON CORP	30	30	565	69,560	ヘルスケア機器・サービス
MDU RESOURCES GROUP INC	23	25	46	5,749	公益事業
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	27	27	225	27,730	食品・飲料・タバコ
MEADWESTVACO CORP	21	—	—	—	素材
MEDIVATION INC	9	21	87	10,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	184	186	1,412	173,635	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO INC	372	372	2,020	248,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	125	124	631	77,659	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3	3	129	15,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	50	60	135	16,704	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	27	26	108	13,370	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26	28	134	16,492	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	140	145	230	28,320	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	1,024	1,012	5,462	671,642	ソフトウェア・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	8	8	160	19,696	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	20	20	193	23,744	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	219	214	955	117,453	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	63	62	600	73,892	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	19	18	281	34,618	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	25	23	248	30,509	各種金融
MORGAN STANLEY	192	194	664	81,686	各種金融
MOSAIC CO/THE	42	43	139	17,122	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	30	27	197	24,266	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP	21	23	71	8,820	エネルギー
MYLAN NV	49	54	280	34,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NABORS INDUSTRIES LTD	32	40	36	4,480	エネルギー
NASDAQ INC	14	15	94	11,663	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	56	51	194	23,967	エネルギー
NAVIENT CORP	51	54	64	7,877	各種金融
NETAPP INC	41	41	129	15,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	7	53	638	78,508	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	
NETSUITE INC	4	5	47	5,803	ソフトウェア・サービス
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	55	60	95	11,788	銀行
NEWELL RUBBERMAID INC	36	36	159	19,661	耐久消費財・アパレル
NEWMONT MINING CORP	66	70	127	15,680	素材
NEWS CORP - CLASS A	48	55	78	9,629	メディア
NEXTERA ENERGY INC	57	58	591	72,743	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	—	47	224	27,660	商業・専門サービス
NIELSEN NV	45	—	—	—	商業・専門サービス
NIKE INC	89	89	1,131	139,100	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	42	—	—	—	公益事業
NOBLE CORP PLC	30	—	—	—	エネルギー
NOBLE ENERGY INC	48	57	210	25,831	エネルギー
NORDSTROM INC	19	18	104	12,798	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	40	40	394	48,539	運輸
NORTHERN TRUST CORP	29	29	224	27,655	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	25	24	457	56,204	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11	21	122	15,115	消費者サービス
NRG ENERGY INC	43	47	56	6,963	公益事業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	31	35	72	8,887	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	42	43	179	22,106	素材
NVIDIA CORP	72	72	225	27,692	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	101	101	760	93,551	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	13	13	61	7,563	エネルギー
OGE ENERGY CORP	25	27	71	8,757	公益事業
OMNICARE INC	12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	33	33	243	29,969	メディア
ONEOK INC	26	28	81	9,988	エネルギー
ORACLE CORP	463	460	1,795	220,732	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	13	13	358	44,117	小売
OWENS-ILLINOIS INC	20	—	—	—	素材
PACCAR INC	46	46	238	29,357	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	13	88	10,862	素材
PALL CORP	14	—	—	—	資本財
PALO ALTO NETWORKS INC	8	9	157	19,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	19	18	192	23,706	資本財
PARTNERRE LTD	5	6	84	10,422	保険
PATTERSON COS INC	9	12	59	7,266	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	43	44	238	29,268	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	—	143	519	63,843	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	24	24	137	16,920	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	36	43	71	8,798	銀行
PEPCO HOLDINGS INC	32	32	84	10,356	公益事業
PEPSICO INC	195	194	1,962	241,356	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	18	19	297	36,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	823	811	2,619	322,049	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	
PG&E CORP	62	63	337	41,445	公益事業
PHARMACYCLICS INC	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	203	204	1,759	216,401	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	72	71	659	81,137	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	14	15	95	11,703	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19	19	276	34,040	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	68	68	647	79,644	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	8	8	89	10,978	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	17	35	371	45,706	素材
PPL CORPORATION	88	88	301	37,059	公益事業
PRAXAIR INC	38	37	438	53,952	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	18	18	420	51,649	資本財
PRICELINE GROUP INC/THE	6	6	874	107,571	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43	41	212	26,081	保険
PROCTER & GAMBLE CO	352	357	2,722	334,740	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	75	78	246	30,277	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	59	59	519	63,856	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	67	66	264	32,523	公益事業
PULTE GROUP INC	41	44	84	10,350	耐久消費財・アパレル
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	—	4	27	3,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	10	11	98	12,145	耐久消費財・アパレル
QEP RESOURCES INC-W/I	20	—	—	—	エネルギー
QORVO INC	18	20	112	13,845	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	217	214	1,039	127,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA SERVICES INC	26	28	61	7,596	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	18	19	131	16,135	ヘルスケア機器・サービス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	8	12	86	10,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RACKSPACE HOSTING INC	15	16	41	5,078	ソフトウェア・サービス
RALPH LAUREN CORP	7	8	99	12,176	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	21	22	72	8,887	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15	17	99	12,235	各種金融
RAYTHEON CO	40	40	506	62,312	資本財
REALOGY HOLDINGS CORP	18	19	82	10,117	不動産
RED HAT INC	25	24	201	24,727	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	10	10	581	71,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	182	179	181	22,321	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	4	6	71	8,755	保険
REPUBLIC SERVICES INC	38	32	142	17,542	商業・専門サービス
RESMED INC	18	18	110	13,534	ヘルスケア機器・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	41	113	521	64,109	食品・飲料・タバコ
RITE AID CORP	—	133	102	12,585	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17	18	92	11,381	商業・専門サービス
ROCK TENN COMPANY -CL A	18	—	—	—	素材
ROCKWELL AUTOMATION INC	18	18	191	23,550	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	16	17	159	19,636	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13	13	258	31,795	資本財
ROSS STORES INC	28	54	252	30,988	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22	23	222	27,402	消費者サービス
SALESFORCE.COM INC	78	82	661	81,366	ソフトウェア・サービス
SANDISK CORP	29	27	208	25,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP	17	17	188	23,122	電気通信サービス
SCANA CORP	17	18	111	13,714	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	168	167	1,303	160,338	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	9	11	62	7,699	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	43	42	145	17,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	25	28	130	16,096	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	17	19	103	12,760	各種金融
SEMPRA ENERGY	30	31	316	38,862	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21	23	103	12,737	資本財
SERVICENOW INC	17	19	168	20,739	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10	10	286	35,189	素材
SIGMA-ALDRICH	15	—	—	—	素材
SIGNET JEWELERS LTD	9	9	139	17,161	小売
SIRIUS XM HOLDINGS INC	326	344	142	17,566	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25	25	201	24,754	半導体・半導体製造装置
SNAP-ON INC	7	7	134	16,564	資本財
SOUTHERN CO	117	119	542	66,658	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	21	23	108	13,381	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO	48	54	52	6,498	エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	87	88	240	29,615	エネルギー
SPLUNK INC	—	16	105	13,018	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	98	113	45	5,642	電気通信サービス
SPX CORP	4	—	—	—	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	38	36	230	28,328	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	19	20	223	27,439	資本財
STAPLES INC	85	86	103	12,764	小売
STARBUCKS CORP	195	197	1,214	149,358	消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	23	22	165	20,308	消費者サービス
STATE STREET CORP	54	54	392	48,272	各種金融
STERICYCLE INC	11	11	134	16,579	商業・専門サービス
STRYKER CORP	44	44	427	52,534	ヘルスケア機器・サービス
SUNEDISON INC	—	38	11	1,366	半導体・半導体製造装置
SUNTRUST BANKS INC	69	67	295	36,305	銀行
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	18	—	—	—	エネルギー
SYMANTEC CORP	92	91	182	22,466	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	20	22	71	8,814	各種金融
SYNOPSIS INC	19	21	110	13,638	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	78	77	322	39,690	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	34	34	265	32,701	各種金融
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	7	66	8,183	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	
TARGET CORP	79	79	563	69,285	小売
TE CONNECTIVITY LTD	53	53	359	44,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TEGNA INC	—	31	85	10,572	メディア
TERADATA CORP	19	20	58	7,240	ソフトウェア・サービス
TESLA MOTORS INC	11	12	276	34,036	自動車・自動車部品
TESORO CORP	16	16	192	23,729	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	138	137	794	97,719	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	36	36	157	19,335	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52	52	720	88,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	17	17	128	15,810	小売
TIME WARNER CABLE	36	37	685	84,322	メディア
TIME WARNER INC	109	109	773	95,149	メディア
TJX COS INC	90	89	606	74,619	小売
T-MOBILE US INC	30	37	142	17,536	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	21	22	83	10,285	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	16	17	102	12,587	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21	22	123	15,159	ソフトウェア・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	9	9	122	15,122	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18	18	163	20,102	小売
TRANSDIGM GROUP INC	6	7	171	21,058	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	43	41	481	59,173	保険
TRIMBLE NAVIGATION LTD	32	36	80	9,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	15	15	133	16,446	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	64	60	184	22,723	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	172	164	494	60,756	メディア
TWITTER INC	50	66	174	21,398	ソフトウェア・サービス
TYCO INTERNATIONAL PLC	55	56	202	24,874	商業・専門サービス
TYSON FOODS INC-CL A	40	40	182	22,397	食品・飲料・タバコ
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	7	8	131	16,201	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	22	23	211	25,986	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	116	116	1,013	124,576	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	11	13	77	9,473	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	92	93	971	119,399	運輸
UNITED RENTALS INC	12	13	98	12,096	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	113	111	1,093	134,467	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	6	93	11,438	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	125	125	1,387	170,596	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	12	12	142	17,570	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	32	33	122	15,059	保険
URBAN OUTFITTERS INC	13	14	32	4,023	小売
US BANCORP	232	233	1,029	126,602	銀行
VALERO ENERGY CORP	68	67	477	58,659	エネルギー
VANTIV INC - CL A	18	19	103	12,733	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12	13	106	13,127	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	14	14	124	15,248	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	
VERISK ANALYTICS INC	20	20	153	18,874	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	543	538	2,465	303,130	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31	32	417	51,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	44	44	284	34,989	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	47	47	245	30,204	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	257	257	2,067	254,176	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	10	10	63	7,789	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	26	30	127	15,677	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	17	18	189	23,287	素材
WABCO HOLDINGS INC	—	7	79	9,762	資本財
WABTEC CORP	12	13	102	12,552	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	114	114	951	117,043	食品・生活必需品小売り
WAL-MART STORES INC	210	212	1,287	158,371	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	211	212	2,527	310,746	メディア
WASTE MANAGEMENT INC	58	60	323	39,763	商業・専門サービス
WATERS CORP	10	11	147	18,164	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	99	103	109	13,409	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	30	42	215	26,444	公益事業
WELLS FARGO & CO	644	644	3,606	443,515	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	29	30	191	23,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	69	69	133	16,354	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5	6	38	4,725	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	—	35	176	21,718	素材
WEYERHAEUSER CO	69	69	221	27,251	不動産
WHIRLPOOL CORP	10	10	168	20,719	耐久消費財・アパレル
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	—	23	94	11,588	食品・飲料・タバコ
WHITING PETROLEUM CORP	20	28	48	5,996	エネルギー
WHOLE FOODS MARKET INC	47	46	139	17,138	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS INC	92	93	353	43,444	エネルギー
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20	21	99	12,193	保険
WORKDAY INC-CLASS A	12	14	121	14,915	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	14	13	73	9,085	保険
WW GRAINGER INC	8	8	160	19,751	資本財
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	16	16	124	15,279	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	10	11	70	8,629	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	68	68	246	30,252	公益事業
XEROX CORP	144	135	141	17,372	ソフトウェア・サービス
XILINX INC	35	34	170	20,926	半導体・半導体製造装置
XL GROUP PLC	33	39	150	18,499	保険
XYLEM INC	22	24	92	11,362	資本財
YAHOO! INC	117	117	382	47,007	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	57	56	408	50,185	消費者サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	—	13	35	4,336	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - CL A	6	6	18	2,260	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22	23	240	29,610	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	評 価 額
		株 数	株 数	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	
ZOETIS INC		65	62	294	36,169	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	40,619	42,238	249,181	30,639,298	
	銘 柄 数 <比 率>	591	601	—	<60.2%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		26	29	104	9,694	素材
AGRIUM INC		19	18	231	21,438	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		56	55	334	30,954	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		16	19	62	5,755	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		40	48	90	8,337	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'		9	11	42	3,962	公益事業
BANK OF MONTREAL		83	85	653	60,361	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		158	160	973	89,955	銀行
BARRICK GOLD CORP		154	156	156	14,496	素材
BAYTEX ENERGY CORP		20	28	15	1,460	エネルギー
BCE INC		19	21	124	11,501	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD		62	70	72	6,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOMBARDIER INC		181	271	34	3,211	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC		111	114	519	48,039	不動産
CAE INC		33	39	59	5,473	資本財
CAMECO CORP		49	56	92	8,574	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		51	52	526	48,641	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO		107	106	854	78,933	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		142	144	477	44,147	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD		60	67	59	5,509	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		22	20	410	37,947	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		9	10	124	11,547	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		16	18	63	5,850	公益事業
CATAMARAN CORP		27	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CENOVUS ENERGY INC		100	111	222	20,609	エネルギー
CGI GROUP INC		29	30	172	15,910	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP		28	32	103	9,570	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2	2	145	13,483	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE -RTS		2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP		54	66	115	10,704	エネルギー
DOLLARAMA INC		16	17	152	14,092	小売
ELDORADO GOLD CORP		89	100	43	4,012	素材
EMPIRE CO LTD 'A'		6	24	65	6,030	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC		111	113	561	51,865	エネルギー
ENCANA CORP		92	113	121	11,225	エネルギー
ENERPLUS CORP		25	28	19	1,818	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		2	2	199	18,405	保険
FINNING INTERNATIONAL INC		21	24	47	4,390	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC		12	17	34	3,178	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		74	96	50	4,689	素材
FORTIS INC		36	38	147	13,595	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
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
FRANCO-NEVADA CORP	19	21	136	12,577	素材
GEORGE WESTON LTD	6	7	79	7,385	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	29	31	126	11,646	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	108	108	174	16,161	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	40	41	147	13,637	保険
HUSKY ENERGY INC	43	46	87	8,066	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	12	14	54	5,001	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	39	40	170	15,734	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12	14	61	5,704	保険
INTACT FINANCIAL CORP	17	18	161	14,894	保険
INTER PIPELINE LTD	42	45	107	9,954	エネルギー
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	10	11	24	2,268	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	21	24	96	8,907	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	139	159	39	3,667	素材
LOBLAW COS LTD	30	30	210	19,438	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	55	54	325	30,049	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	256	259	575	53,203	保険
MEG ENERGY CORP	19	22	25	2,358	エネルギー
METHANEX CORP	11	12	65	6,098	素材
METRO INC	32	34	131	12,139	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	44	43	186	17,251	銀行
NEW GOLD INC	60	—	—	—	素材
ONEX CORPORATION	11	12	103	9,541	各種金融
OPEN TEXT CORP	15	16	105	9,717	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	7	9	8	791	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	44	46	145	13,457	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	18	21	59	5,473	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	108	112	308	28,486	素材
POWER CORP OF CANADA	50	50	160	14,836	保険
POWER FINANCIAL CORP	32	34	116	10,752	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	16	20	52	4,852	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	24	27	136	12,583	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	49	50	260	24,075	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	188	190	1,449	133,935	銀行
SAPUTO INC	32	34	112	10,398	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	53	56	154	14,239	メディア
SILVER WHEATON CORP	45	56	97	9,019	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	19	21	91	8,495	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	82	80	361	33,387	保険
SUNCOR ENERGY INC	189	190	707	65,342	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	70	78	47	4,417	素材
THOMSON REUTERS CORP	49	48	258	23,847	メディア
TORONTO-DOMINION BANK	240	243	1,331	123,095	銀行
TOURMALINE OIL CORP	21	25	68	6,324	エネルギー
TRANSALTA CORP	34	40	21	1,987	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	
株 数・金 額	株 数			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	
TRASCANADA CORP		93	93	408	37,732	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		98	144	51	4,766	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC		41	42	479	44,343	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERESEN INC		—	41	44	4,136	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		13	15	61	5,692	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		8	9	50	4,676	素材
YAMANA GOLD INC		113	130	33	3,087	素材
小 計		5,019	5,415	18,564	1,715,725	
	銘柄数<比率>	92	90	—	<3.4%>	
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD		92	99	168	14,866	公益事業
ALS LTD		51	—	—	—	商業・専門サービス
ALUMINA LTD		328	386	47	4,202	素材
AMCOR LTD		172	170	235	20,864	素材
AMP LTD		411	417	243	21,570	保険
ARISTOCRAT LEISURE LTD		—	85	82	7,291	消費者サービス
ASCIANO LTD		144	142	127	11,252	運輸
ASX LTD		28	30	126	11,170	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD		309	320	177	15,660	運輸
AUSNET SERVICES		—	345	54	4,802	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		365	370	1,019	90,132	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		53	60	86	7,691	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		67	75	83	7,415	銀行
BHP BILLITON LTD		422	426	870	76,997	素材
BORAL LTD		111	130	73	6,459	素材
BRAMBLES LTD		222	225	244	21,586	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		18	38	125	11,092	エネルギー
CIMIC GROUP LIMITED		14	17	45	4,000	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED		77	89	83	7,357	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		7	9	84	7,443	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		214	226	1,789	158,186	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		65	77	89	7,948	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		48	55	67	5,952	消費者サービス
CSL LIMITED		62	62	611	54,065	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		7	8	32	2,888	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		196	227	49	4,370	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		77	94	37	3,319	小売
HEALTHSCOPE LTD		165	194	55	4,891	ヘルスケア機器・サービス
ILUKA RESOURCES LIMITED		54	63	39	3,480	素材
INCITEC PIVOT LTD		224	250	94	8,389	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		343	341	195	17,247	保険
MACQUARIE GROUP LTD		39	41	345	30,575	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD		365	411	95	8,479	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		314	349	1,040	91,963	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK-R		25	—	—	—	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			
NEWCREST MINING LIMITED		97	106	124	10,996	素材	
ORICA LTD		48	56	94	8,365	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED		153	166	90	8,019	エネルギー	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT		35	42	34	3,027	各種金融	
QANTAS AIRWAYS LTD		76	88	34	3,008	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LTD		186	188	242	21,441	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED		18	20	142	12,580	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD		7	9	46	4,073	メディア	
RIO TINTO LTD		59	58	285	25,257	素材	
SANTOS LTD		126	150	65	5,772	エネルギー	
SANTOS LTD - RTS		—	88	4	368	エネルギー	
SEEK LTD		43	50	71	6,294	商業・専門サービス	
SONIC HEALTHCARE LTD		52	56	115	10,213	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD		697	741	97	8,625	素材	
SUNCORP GROUP LTD		186	185	248	21,952	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD		114	133	62	5,491	消費者サービス	
TATTS GROUP LTD		203	236	98	8,682	消費者サービス	
TELSTRA CORP LTD		607	608	330	29,226	電気通信サービス	
TOLL HOLDINGS LIMITED		96	—	—	—	運輸	
TPG TELECOM LTD		40	47	49	4,367	電気通信サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD		85	99	75	6,647	食品・飲料・タバコ	
WESFARMERS LIMITED		149	151	584	51,693	食品・生活必需品小売り	
WESTPAC BANKING CORP		411	416	1,314	116,201	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD		101	102	312	27,655	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD		168	169	401	35,528	食品・生活必需品小売り	
WORLEYPARSONS LTD		27	32	20	1,800	エネルギー	
小 計		株 数 ・ 金 額	8,898	9,857	13,468	1,190,916	
		銘 柄 数 <比 率>	58	58	—	<2.3%>	
(香港)				千香港・ドル			
AIA GROUP LTD		1,580	1,588	7,514	119,259	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		30	35	224	3,554	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA		168	170	485	7,702	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		505	500	1,228	19,495	銀行	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD		150	180	267	4,250	運輸	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		80	90	615	9,769	公益事業	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		—	359	1,904	30,231	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		179	354	3,675	58,329	資本財	
CLP HOLDINGS LTD		266	251	1,668	26,474	公益事業	
FIRST PACIFIC CO		300	320	163	2,595	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		318	328	797	12,652	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD		291	311	592	9,404	不動産	
HANG SENG BANK LTD		104	104	1,497	23,761	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		137	151	723	11,489	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS		868	950	1,485	23,573	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		146	147	3,059	48,560	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	株数	株数	期末		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
HUTCHISON WHAMPOA LTD	285	—	—	—	資本財	
HYSAN DEVELOPMENT CO	80	90	294	4,670	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD	80	90	195	3,099	不動産	
LI & FUNG LTD	752	832	475	7,546	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	116	128	136	2,169	消費者サービス	
MTR CORP	202	212	783	12,430	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	656	726	598	9,491	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	190	220	244	3,882	資本財	
PCCW LTD	560	640	283	4,499	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	190	185	1,358	21,562	公益事業	
SANDS CHINA LTD	313	321	870	13,814	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD	140	180	130	2,065	消費者サービス	
SINO LAND CO	400	420	491	7,798	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	240	260	157	2,500	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	240	220	2,131	33,832	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	93	73	643	10,205	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	144	168	372	5,905	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	175	185	581	9,233	耐久消費財・アパレル	
WH GROUP LTD	450	825	323	5,132	食品・飲料・タバコ	
WHARF HOLDINGS LTD	217	167	749	11,896	不動産	
WHELOCK & CO LTD	120	120	414	6,579	不動産	
WYNN MACAU LTD	197	213	226	3,590	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	95	105	300	4,765	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,065 38	12,226 38	37,667 —	597,778 <1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
CAPITALAND LTD	327	367	115	10,053	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	50	57	43	3,747	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	269	336	102	8,911	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	230	231	392	34,149	銀行	
GENTING SINGAPORE PLC	765	839	62	5,471	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	400	445	94	8,203	不動産	
GOLDEN AGRY-RESOURCES LTD	856	988	35	3,092	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	14	16	52	4,549	小売	
KEPPEL CORP LTD	191	197	133	11,580	資本財	
NOBLE GROUP LTD	547	664	28	2,454	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	395	396	354	30,820	銀行	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	120	138	45	3,996	資本財	
SEMCORP MARINE LTD	100	116	25	2,209	資本財	
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	83	87	7,636	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	100	114	87	7,613	各種金融	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	226	251	100	8,708	メディア	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	195	228	66	5,809	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,078	1,078	417	36,278	電気通信サービス	
STARHUB LTD	97	113	40	3,517	電気通信サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		174	173	346	30,118	銀行
UOL Group Limited		58	67	41	3,589	不動産
WILMAR INTERNATIONAL LTD		251	274	80	7,005	食品・飲料・タバコ
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		240	280	31	2,702	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	6,754	7,451	2,785	242,219	
	銘 柄 数 <比 率>	23	23	—	<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		127	154	80	6,489	運輸
CONTACT ENERGY LTD		46	104	52	4,231	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD		84	98	69	5,603	素材
MERIDIAN ENERGY LTD		—	184	40	3,267	公益事業
MERIDIAN ENER-PARTLY PAID SH		160	—	—	—	公益事業
MIGHTY RIVER POWER		87	102	28	2,323	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		45	52	39	3,153	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		241	270	87	7,089	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	792	967	398	32,159	
	銘 柄 数 <比 率>	7	7	—	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		121	130	64	12,173	各種金融
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		113	129	43	8,251	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		23	29	48	9,075	保険
AGGREKO PLC		31	35	35	6,695	商業・専門サービス
AMEC FOSTER WHEELER PLC		47	55	26	4,954	エネルギー
ANGLO AMERICAN PLC		181	187	84	15,845	素材
ANTOFAGASTA PLC		47	54	27	5,094	素材
ARM HOLDINGS PLC		183	186	202	37,962	半導体・半導体製造装置
ASHTED GROUP PLC		64	68	71	13,461	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		47	47	167	31,555	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		165	166	737	138,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIVA PLC		518	531	267	50,284	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC		31	35	35	6,625	商業・専門サービス
BAE SYSTEMS PLC		413	417	202	37,946	資本財
BARCLAYS PLC		2,148	2,204	506	95,221	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		—	133	77	14,518	耐久消費財・アパレル
BG GROUP PLC		445	449	467	87,779	エネルギー
BHP BILLITON PLC		275	277	246	46,279	素材
BP PLC		2,382	2,404	925	173,940	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		243	245	948	178,100	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		1,070	1,108	544	102,251	電気通信サービス
BUNZL PLC		44	45	86	16,286	資本財
BURBERRY GROUP PLC		59	59	76	14,413	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC		88	89	112	21,107	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC		23	24	85	16,073	消費者サービス
CENTRICA PLC		664	670	143	26,910	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)		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	
COBHAM PLC	144	160	46	8,772	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	24	28	45	8,554	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	218	218	234	44,105	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17	18	52	9,825	素材
DIAGEO PLC	328	331	630	118,362	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	185	185	75	14,173	保険
DIXONS CARPHONE PLC	121	133	61	11,484	小売
EASYJET PLC	19	23	39	7,485	運輸
EXPERIAN PLC	132	132	161	30,391	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	26	31	21	4,083	素材
G4S PLC	196	213	48	9,057	商業・専門サービス
GKN PLC	211	221	66	12,537	自動車・自動車部品
GLAXOSMITHKLINE PLC	635	641	863	162,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	1,374	1,457	137	25,744	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28	36	54	10,262	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	2,501	2,568	1,348	253,359	銀行
ICAP PLC	67	77	39	7,436	各種金融
IMI PLC	34	38	35	6,616	資本財
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	125	126	440	82,783	食品・飲料・タバコ
INMARSAT PLC	55	63	67	12,749	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	30	31	79	14,969	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	20	21	57	10,890	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	68	78	42	7,950	各種金融
ITV PLC	518	522	139	26,210	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	27	27	74	13,967	素材
KINGFISHER PLC	313	311	111	20,864	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	779	782	209	39,441	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,442	7,523	551	103,593	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29	41	108	20,385	各種金融
LONMIN PLC	14	—	—	—	素材
MARKS & SPENCER GROUP PLC	218	221	115	21,642	小売
MEGGITT PLC	101	106	41	7,736	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	121	140	39	7,378	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	62	101	41	7,868	消費者サービス
MONDI PLC/WI	—	49	74	14,012	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	260	297	45	8,640	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	491	494	464	87,277	公益事業
NEXT PLC	20	19	153	28,839	小売
OLD MUTUAL PLC	653	659	133	25,041	保険
PEARSON PLC	110	108	88	16,566	メディア
PERSIMMON PLC	37	41	76	14,309	耐久消費財・アパレル
PETROFAC LTD	32	36	28	5,418	エネルギー
PRUDENTIAL PLC	335	338	513	96,482	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	10	12	50	9,512	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	84	84	534	100,417	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	千イリス・ポンド	千円		
RELX PLC	154	149	177	33,400	メディア	
REXAM PLC	89	96	54	10,209	素材	
RIO TINTO PLC	166	166	380	71,439	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	246	241	130	24,567	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	35,427	—	—	—	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	—	21,772	2	408	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	338	432	136	25,593	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	516	514	857	161,110	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	313	319	537	100,907	エネルギー	
ROYAL MAIL PLC	82	112	53	10,098	運輸	
RSA INSURANCE GROUP PLC	126	136	60	11,316	保険	
SABMILLER PLC	126	127	513	96,370	食品・飲料・タバコ	
SAGE GROUP PLC	135	146	82	15,422	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	153	188	47	8,946	食品・生活必需品小売り	
SCHRODERS PLC	15	16	49	9,270	各種金融	
SEVERN TRENT PLC	30	32	72	13,620	公益事業	
SHIRE PLC	77	78	368	69,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SKY PLC	140	141	156	29,312	メディア	
SMITH & NEPHEW PLC	119	120	135	25,391	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC	49	53	53	10,108	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	32	37	26	5,025	小売	
SSE PLC	129	131	193	36,336	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC	—	70	67	12,757	保険	
STANDARD CHARTERED PLC	322	334	198	37,256	銀行	
STANDARD LIFE PLC	261	264	106	20,076	保険	
TATE & LYLE PLC	57	65	38	7,295	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC	—	439	81	15,287	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	1,058	1,069	183	34,558	食品・生活必需品小売り	
TRAVIS PERKINS PLC	31	33	66	12,450	資本財	
TUI AG-DI	55	67	75	14,243	消費者サービス	
TULLOW OIL PLC	112	127	25	4,852	エネルギー	
UNILEVER PLC	167	169	476	89,589	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	89	93	91	17,167	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	3,474	3,501	775	145,712	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE	26	29	33	6,356	資本財	
WHITBREAD PLC	24	24	110	20,728	消費者サービス	
WILLIAM HILL PLC	109	124	43	8,124	消費者サービス	
WOLSELEY PLC	34	35	130	24,557	資本財	
WPP PLC	173	173	262	49,237	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	72,140	60,191	21,341	4,009,025	
	銘 柄 数 <比 率>	105	108	—	<7.9%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP	—	4	75	2,410	不動産	
BANK HAPOALIM BM	132	146	297	9,431	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	159	195	285	9,071	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	株数	株数	期末		業種等
			評価額	金額	
	株数・金額	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千円	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	248	276	237	7,543	電気通信サービス
DELEK GROUP LTD	0.57	0.65	58	1,843	エネルギー
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	53	70	138	4,396	素材
ISRAEL CORP LIMITED/THE	0.32	0.42	36	1,153	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16	19	89	2,840	銀行
NICE SYSTEMS LTD	7	8	201	6,410	ソフトウェア・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	112	113	2,700	85,712	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>	730	835	4,121	130,813
		9	10	—	<0.3%>
(スイス)			千スイス・フラン		
ABB LTD	287	289	551	66,874	資本財
ACTELION LTD-REG	13	13	194	23,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG	22	22	159	19,311	商業・専門サービス
ARYZTA AG	10	12	57	7,015	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG	6	6	81	9,868	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.27	0.31	33	4,072	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.10	0.11	67	8,204	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	149	18,084	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	68	68	533	64,601	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG	198	204	480	58,221	各種金融
DUFREY AG-REG	—	5	69	8,399	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.99	1	48	5,826	素材
GEBERIT AG-REG	5	5	171	20,784	資本財
GIVAUDAN-REG	1	1	229	27,750	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	29	30	144	17,481	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7	8	109	13,322	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	30	57	318	38,598	素材
LONZA GROUP AG	6	7	113	13,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	421	424	3,232	391,751	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	300	299	2,698	327,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR	3	4	27	3,360	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2	2	80	9,714	各種金融
ROCHE HOLDING AG	91	92	2,520	305,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1	3	49	6,038	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6	6	99	12,011	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	0.71	0.73	141	17,090	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER	0.27	0.31	103	12,558	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	6	7	93	11,277	ヘルスケア機器・サービス
SULZER AG-REG	2	3	32	3,913	資本財
SWATCH GROUP AG	4	4	149	18,059	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4	4	104	12,660	保険
SWISS PRIME SITE-REG	7	9	73	8,905	不動産
SWISS RE AG	46	46	447	54,196	保険
SWISSCOM AG	3	3	187	22,710	電気通信サービス
SYNGENTA AG	12	12	460	55,858	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	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	
THE SWATCH GROUP AG-REG		5	7	48	5,907	耐久消費財・アパレル
TRANSOCEAN LTD		44	50	74	9,068	エネルギー
UBS GROUP AG		476	481	962	116,609	各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG		19	19	534	64,727	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	2,152	2,217	15,635	1,894,689	
	銘 柄 数 <比 率>	38	39	—	<3.7%>	
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	0.86	0.93	943	16,670	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S	0.63	0.57	568	10,041	運輸	
CARLSBERG AS-B	13	14	870	15,377	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B	14	14	815	14,398	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	87	92	1,758	31,062	銀行	
DSV A/S	23	25	695	12,287	運輸	
ISS A/S	14	21	501	8,858	商業・専門サービス	
NOVO-NORDISK A/S	262	258	9,791	172,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	31	31	1,051	18,563	素材	
PANDORA A/S	15	14	1,238	21,866	耐久消費財・アパレル	
TDC A/S	105	119	428	7,569	電気通信サービス	
TRYGVESTA AS	12	16	214	3,787	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	28	30	1,300	22,965	資本財	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2	3	218	3,863	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	614	642	20,397	360,225	
	銘 柄 数 <比 率>	14	14	—	<0.7%>	
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ		
DNB ASA	130	131	1,500	21,407	銀行	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24	28	389	5,552	保険	
NORSK HYDRO ASA	169	189	615	8,786	素材	
ORKLA ASA	102	111	791	11,300	食品・飲料・タバコ	
SEADRILL LTD	48	51	277	3,959	エネルギー	
STATOIL ASA	148	150	2,022	28,855	エネルギー	
SUBSEA 7 SA	34	37	260	3,722	エネルギー	
TELENOR ASA	101	102	1,585	22,619	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	23	24	986	14,083	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	784	826	8,429	120,286	
	銘 柄 数 <比 率>	9	9	—	<0.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ		
ALFA LAVAL AB	40	42	653	9,253	資本財	
ASSA ABLOY AB	45	133	2,401	33,980	資本財	
ATLAS COPCO AB	53	53	1,112	15,741	資本財	
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	53	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	87	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	87	90	2,061	29,171	資本財	
BOLIDEN AB	34	39	595	8,423	素材	
ELECTROLUX AB	30	32	807	11,419	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	
(スウェーデン)	百株	百株	千円			
ELEKTA AB-B SHS	44	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
GETINGE AB-B SHS	25	28	622	8,807	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB	124	125	4,027	56,986	小売	
HEXAGON AB-B SHS	33	35	1,115	15,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS	51	59	335	4,751	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB	9	11	356	5,046	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	19	23	369	5,223	各種金融	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	29	31	852	12,060	各種金融	
INVESTOR AB	61	61	2,017	28,551	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	27	32	427	6,045	エネルギー	
NORDEA BANK AB	398	401	3,890	55,052	銀行	
SANDVIK AB	143	145	1,230	17,408	資本財	
SECURITAS AB	39	45	592	8,389	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	205	206	1,888	26,725	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	50	52	872	12,345	資本財	
SKF AB	52	54	835	11,826	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB	79	79	1,990	28,160	家庭用品・パーソナル用品	
SVENSKA HANDELSBANKEN	198	198	2,364	33,455	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	121	120	2,339	33,106	銀行	
SWEDISH MATCH AB	25	27	782	11,077	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB	44	48	419	5,930	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	400	403	3,306	46,780	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIASONERA AB	352	361	1,554	21,995	電気通信サービス	
VOLVO AB	205	207	1,832	25,923	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,173	3,153	41,655	589,422	
	銘柄 数 <比率>	32	29	—	<1.2%>	
(ユーロ/アイルランド)				千ユーロ		
BANK OF IRELAND	3,672	3,673	119	15,731	銀行	
CRH PLC	106	110	295	38,897	素材	
KERRY GROUP PLC-A	21	22	164	21,671	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,800	3,806	579	76,300	
	銘柄 数 <比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ/オランダ)						
AEGON NV	243	233	128	16,940	保険	
AIRBUS GROUP SE	77	77	513	67,635	資本財	
AKZO NOBEL NV	32	33	215	28,449	素材	
ALTICE NV - A-W/I	—	37	52	6,877	メディア	
ALTICE NV - B -W/I	—	12	18	2,419	メディア	
ASML HOLDING NV	45	45	396	52,211	半導体・半導体製造装置	
BOSKALIS WESTMINSTER	11	12	51	6,783	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	118	128	81	10,672	資本財	
DELTA LLOYD NV	25	29	21	2,842	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	120	121	155	20,460	自動車・自動車部品	
GEMALTO	9	11	65	8,613	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	株数	株数	期末		業種等	
			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		
HEINEKEN HOLDING NV	12	13	102	13,479	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN NV	30	30	258	34,037	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV	504	508	676	89,076	銀行	
KONINKLIJKE AHOLD NV	119	119	240	31,714	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE DSM NV	22	24	118	15,597	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	122	123	309	40,774	資本財	
NN GROUP NV	19	25	81	10,750	保険	
OCI NV	—	12	28	3,794	素材	
QIAGEN NV	29	29	74	9,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RANDSTAD HOLDINGS NV	15	17	98	13,017	商業・専門サービス	
RELX NV	95	139	225	29,659	メディア	
ROYAL KPN NV	433	424	151	19,969	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	80	91	60	8,001	半導体・半導体製造装置	
TNT EXPRESS NV - W/I	57	72	55	7,357	運輸	
UNILEVER NV	213	214	885	116,726	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK	8	9	39	5,269	エネルギー	
WOLTERS KLUWER NV	41	41	134	17,736	メディア	
小計	株数・金額	2,492	2,641	5,241	690,673	
	銘柄数<比率>	25	28	—	<1.4%>	
(ユーロ/ベルギー)						
AGEAS	27	27	110	14,541	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	105	105	1,232	162,439	食品・飲料・タバコ	
COLRUYT NV	8	9	44	5,892	食品・生活必需品小売り	
DELHAIZE GROUP	13	13	128	16,865	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10	10	84	11,194	各種金融	
KBC GROUP SA	33	33	185	24,461	銀行	
PROXIMUS	19	21	68	9,084	電気通信サービス	
SOLVAY SA	7	8	83	10,952	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV	6	8	42	5,606	メディア	
UCB SA	16	16	135	17,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE	12	13	53	6,995	素材	
小計	株数・金額	261	269	2,169	285,896	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.6%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ALTICE SA	11	—	—	—	メディア	
ARCELORMITTAL	133	141	69	9,215	素材	
RTL GROUP	4	5	47	6,222	メディア	
TENARIS SA	59	63	75	9,972	エネルギー	
小計	株数・金額	208	210	192	25,409	
	銘柄数<比率>	4	3	—	<0.0%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR	22	28	114	15,068	消費者サービス	
ADP	4	5	54	7,220	運輸	
AIR LIQUIDE	45	45	523	68,913	素材	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ALCATEL-LUCENT	377	394	147	19,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALSTOM RGPT	27	29	86	11,355	資本財
ARKEMA	8	9	61	8,165	素材
ATOS SE	10	11	89	11,857	ソフトウェア・サービス
AXA	238	258	638	84,179	保険
BNP PARIBAS	138	139	788	103,854	銀行
BOLLORE	73	132	56	7,483	運輸
BOUYGUES	21	27	97	12,858	資本財
BUREAU VERITAS SA	28	36	71	9,375	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	19	21	177	23,433	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	83	74	217	28,629	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON	7	7	43	5,735	食品・生活必需品小売り
CHRISTIAN DIOR SE	7	7	127	16,734	耐久消費財・アパレル
CIE DE SAINT-GOBAIN	60	62	257	33,943	資本財
CNP ASSURANCES	20	24	32	4,220	保険
CREDIT AGRICOLE SA	137	139	160	21,145	銀行
DANONE	76	76	493	65,031	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	16	17	130	17,218	ソフトウェア・サービス
EDENRED	26	29	55	7,269	商業・専門サービス
EDF	30	34	52	6,907	公益事業
ENGIE	190	192	319	42,160	公益事業
ESSILOR INTERNATIONA	26	27	327	43,114	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	5	5	36	4,815	各種金融
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20	24	72	9,548	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	62	69	84	11,134	運輸
HERMES INTERNATIONAL	3	3	119	15,755	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	3	3	78	10,348	電気通信サービス
IMERYS SA	4	5	35	4,644	素材
INGENICO GROUP	—	7	81	10,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JC DECAUX SA	8	11	41	5,462	メディア
KERING	10	10	171	22,547	耐久消費財・アパレル
LAFARGE SA	25	—	—	—	素材
LAGARDERE S.C.A.	15	17	50	6,628	メディア
LEGRAND SA	35	36	192	25,374	資本財
L'OREAL SA	33	33	557	73,470	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	36	36	598	78,915	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	24	25	238	31,399	自動車・自動車部品
NATIXIS	119	128	74	9,790	銀行
NUMERICABLE GROUP- W/I	12	14	58	7,708	メディア
ORANGE S.A.	244	263	443	58,431	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	27	28	303	39,973	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	49	58	94	12,488	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	25	25	151	19,899	メディア
REMY COINTREAU	3	3	24	3,164	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	25	25	240	31,663	自動車・自動車部品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
REXEL SA	35	41	54	7,174	資本財	
SAFRAN SA	36	38	258	34,044	資本財	
SANOFI	156	155	1,278	168,520	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	68	73	427	56,285	資本財	
SCOR REGROUPE	19	21	78	10,358	保険	
SOCIETE BIC SA	3	4	63	8,309	商業・専門サービス	
SOCIETE GENERALE	94	95	427	56,371	銀行	
SODEXO	12	12	113	14,956	消費者サービス	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	38	41	74	9,839	公益事業	
TECHNIP SA	12	14	74	9,821	エネルギー	
THALES SA	12	14	99	13,046	資本財	
TOTAL SA	280	284	1,323	174,425	エネルギー	
VALEO SA	10	10	155	20,434	自動車・自動車部品	
VALLOUREC	13	—	—	—	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	53	60	134	17,669	公益事業	
VINCI SA	61	63	391	51,572	資本財	
VIVENDI SA	161	154	312	41,176	メディア	
WENDEL	3	4	45	5,980	各種金融	
ZODIAC SA	23	28	72	9,526	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,594	3,794	14,258	1,878,694	
	銘 柄 数 <比 率>	66	65	—	<3.7%>	
(ユーロ/ドイツ)						
ADIDAS AG	27	28	246	32,422	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE	59	59	963	126,949	保険	
AXEL SPRINGER SE	5	6	34	4,609	メディア	
BASF SE	119	120	932	122,925	素材	
BAYER AG	108	108	1,367	180,134	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	43	43	429	56,600	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6	7	57	7,539	自動車・自動車部品	
BEIERSDORF AG	13	13	119	15,727	家庭用品・パーソナル用品	
BRENTAG AG	20	20	106	14,012	資本財	
CELESIO AG	6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
COMMERZBANK AG	128	142	150	19,781	銀行	
CONTINENTAL AG	14	14	319	42,034	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	125	126	995	131,152	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE BANK AG	179	181	445	58,710	各種金融	
DEUTSCHE BOERSE AG	25	25	211	27,834	各種金融	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	27	33	45	6,049	運輸	
DEUTSCHE POST AG	128	129	346	45,695	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG	417	420	719	94,854	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	36	45	111	14,728	不動産	
E.ON SE	261	268	245	32,328	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	19	65	8,654	素材	
FRAPORT AG	5	6	40	5,275	運輸	
FRESENIUS SE & CO KGAA	50	50	339	44,729	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	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
FUCHS PETROLUB AG -PFD	8	9	42	5,648	素材	
GEA GROUP AG	23	24	93	12,380	資本財	
HANNOVER RUECK SE	7	8	87	11,545	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG	18	19	141	18,600	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	16	14	125	16,586	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL KGAA-VORZUG	22	23	252	33,292	家庭用品・パーソナル用品	
HUGO BOSS AG	6	9	78	10,278	耐久消費財・アパレル	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	150	151	178	23,462	半導体・半導体製造装置	
K+S AG	21	25	62	8,268	素材	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3	3	40	5,389	メディア	
LANXESS	11	12	60	8,008	素材	
LINDE AG	24	24	406	53,546	素材	
MAN SE	4	5	47	6,292	資本財	
MERCK KGAA	17	17	165	21,809	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METRO AG	19	24	73	9,677	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	22	21	400	52,706	保険	
OSRAM LICHT AG	10	12	48	6,438	資本財	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	20	20	85	11,267	自動車・自動車部品	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	29	29	147	19,453	メディア	
RWE AG	65	65	75	9,960	公益事業	
SAP SE	120	129	964	127,045	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS AG	103	104	996	131,330	資本財	
SYMRISE AG	15	16	105	13,916	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	76	88	47	6,228	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	60	50	98	13,026	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15	16	80	10,664	ソフトウェア・サービス	
VOLKSWAGEN AG	4	5	65	8,673	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG	20	21	223	29,464	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE	45	62	184	24,284	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,780	2,893	13,676	1,801,998	
	銘 柄 数 <比 率>	51	51	—	<3.5%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	4,314	5,306	26	3,496	銀行	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	301	314	103	13,646	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	48	54	54	7,232	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	30	35	45	6,047	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,695	5,711	230	30,423	
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ/スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	55	67	99	13,059	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22	25	80	10,599	資本財	
AENA SA	7	9	98	12,950	運輸	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	59	58	225	29,724	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	809	827	646	85,177	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	株数	株数	期末		業種等	
			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 DE SABADELL SA	426	663	118	15,586	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	222	227	78	10,336	銀行	
BANCO SANTANDER SA	1,833	1,881	979	129,025	銀行	
BANKIA SA	570	613	71	9,469	銀行	
BANKINTER SA	84	95	63	8,429	銀行	
CAIXABANK	300	348	123	16,295	銀行	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	74	85	51	6,786	食品・生活必需品小売り	
ENAGAS SA	26	29	81	10,760	公益事業	
ENDESA SA	39	43	86	11,452	公益事業	
FERROVIAL S.A.	54	57	129	17,109	資本財	
GAS NATURAL SDG SA	43	47	94	12,417	公益事業	
GRIFOLS SA	18	20	87	11,530	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	672	712	466	61,444	公益事業	
INDITEX SA	142	143	469	61,809	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	102	112	93	12,378	運輸	
MAPFRE SA	105	142	36	4,763	保険	
RED ELECTRICA DE ESPANA	14	14	120	15,837	公益事業	
REPSOL SA	138	141	172	22,769	エネルギー	
TELEFONICA SA	553	588	694	91,460	電気通信サービス	
TELEFONICA SA-RTS	—	588	20	2,689	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	20	25	27	3,623	資本財	
小計	株数・金額	6,398	7,569	5,217	687,486	
	銘柄数<比率>	25	26	—	<1.4%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	156	153	271	35,743	保険	
ATLANTIA SPA	56	56	139	18,342	運輸	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	26	355	51	6,838	銀行	
BANCO POPOLARE SC	44	48	65	8,611	銀行	
ENEL GREEN POWER SPA	215	251	49	6,480	公益事業	
ENEL SPA	862	929	381	50,231	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	332	334	499	65,859	エネルギー	
EXOR SPA	12	14	57	7,517	各種金融	
FINMECCANICA SPA	50	57	76	10,103	資本財	
INTESA SANPAOLO	1,744	1,757	554	73,049	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	22	22	139	18,381	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	75	75	71	9,356	各種金融	
PIRELLI & C.	29	—	—	—	自動車・自動車部品	
PRYSMIAN SPA	25	27	54	7,162	資本財	
SAIPEM SPA	32	37	30	3,983	エネルギー	
SNAM SPA	284	277	132	17,448	公益事業	
TELECOM ITALIA SPA	1,982	1,939	225	29,699	電気通信サービス	
TERNA SPA	194	208	96	12,747	公益事業	
UNICREDIT SPA	573	628	347	45,783	銀行	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	107	122	79	10,433	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	株数	株数	期末		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/イタリア) UNIPOLSAI SPA	百株 109	百株 152	千ユーロ 35	千円 4,718	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,939 21	7,454 20	3,358 —	442,492 <0.9%>
(ユーロ/フィンランド)					
ELISA OYJ	18	21	75	9,970	電気通信サービス
FORTUM OYJ	57	60	84	11,090	公益事業
KONE OYJ	41	45	180	23,789	資本財
METSO OYJ	13	15	36	4,827	資本財
NESTE OYJ	15	18	45	6,033	エネルギー
NOKIA OYJ	490	485	331	43,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ	13	15	53	7,017	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B	12	14	48	6,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ	59	58	270	35,620	保険
STORA ENSO OYJ	69	78	72	9,600	素材
UPM-KYMMENE OYJ	69	72	129	17,063	素材
WARTSILA OYJ	18	20	81	10,762	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	881 12	905 12	1,410 —	185,823 <0.4%>
(ユーロ/オーストリア)					
ANDRITZ AG	9	11	54	7,195	資本財
ERSTE GROUP BANK AG	34	37	107	14,162	銀行
IMMOFINANZ AG	113	—	—	—	不動産
OMV AG	18	20	54	7,148	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	13	15	24	3,171	銀行
VOESTALPINE AG	14	16	48	6,375	素材
WIENER STAEDTISCHE VERSICHERUNG	4	—	—	—	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	206 7	100 5	288 —	38,052 <0.1%>
(ユーロ/その他)					
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	29	29	232	30,644	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29 1	29 1	232 —	30,644 <0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,286 230	35,387 229	46,857 —	6,173,896 <12.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	185,032 1,246	181,413 1,255	— —	47,696,457 <93.7%>

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

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

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

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

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	2	2	257	31,663	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	4	4	380	46,725	
PROLOGIS INC	6	6	288	35,526	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	12	12	121	14,942	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	1	310	38,238	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	1	89	11,060	
DUKE REALTY CORP	4	4	92	11,327	
EQUITY RESIDENTIAL	4	4	379	46,605	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.860	0.889	200	24,701	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.895	0.934	136	16,840	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	7	7	197	24,277	
HCP INC	6	6	215	26,450	
WELLTOWER INC	4	4	279	34,374	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	10	10	164	20,286	
KIMCO REALTY CORP	5	5	145	17,884	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	2	69	8,586	
MACERICH CO/THE	1	1	140	17,277	
PLUM CREEK TIMBER CO	2	2	118	14,604	
PUBLIC STORAGE	1	1	452	55,691	
RAYONIER INC	1	—	—	—	
REGENCY CENTERS CORP	1	1	86	10,654	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4	4	784	96,404	
SL GREEN REALTY CORP	1	1	157	19,374	
UDR INC	3	3	126	15,516	
VENTAS INC	4	4	224	27,619	
VORNADO REALTY TRUST	2	2	219	26,954	
REALTY INCOME CORP	2	3	149	18,430	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	1	121	14,983	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	1	130	16,083	
IRON MOUNTAIN INC	2	2	77	9,549	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	4	4	84	10,425	
AMERICAN TOWER REIT INC	5	5	555	68,308	
EQUINIX INC	0.738	0.785	224	27,616	
VEREIT	11	12	99	12,220	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	2	64	7,911	
COMMUNICATIONS SALES & LE	1	1	30	3,784	
小 計	口 数 ・ 金 額	128	136	7,180	882,902
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<1.7%>
(カナダ)			千カナダ・ドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMT-UTS	1	2	42	3,926	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	2	56	5,212	
小 計	口 数 ・ 金 額	3	4	98	9,139
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>

# 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		評 価 額	
		口 数	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS PROPERTY GROUP		12	14	113	10,029
NOVION PROPERTY GROUP		31	—	—	—
GPT GROUP		24	27	127	11,301
GOODMAN GROUP		24	26	160	14,230
STOCKLAND		33	35	140	12,410
WESTFIELD CORP		27	27	276	24,476
MIRVAC GROUP		52	57	107	9,516
VICINITY CENTRES		21	50	142	12,577
SCENTRE GROUP		74	75	306	27,076
小 計		303	314	1,375	121,617
		銘柄数 <比率>	9	8	— <0.2%>
(香港)				千香港・ドル	
LINK REIT		30	30	1,483	23,540
小 計		30	30	1,483	23,540
		銘柄数 <比率>	1	1	— <0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		25	29	66	5,764
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		25	29	38	3,336
CAPITALAND MALL TRUST		29	34	65	5,655
SUNTEC REIT		29	34	52	4,576
小 計		110	127	222	19,332
		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		12	12	109	20,511
HAMMERSON PLC		9	10	64	12,194
LAND SECURITIES GROUP PLC		10	10	133	25,005
SEGRO PLC		8	10	46	8,741
INTU PROPERTIES PLC		11	13	42	8,063
小 計		53	58	396	74,516
		銘柄数 <比率>	5	5	— <0.1%>
(ユーロ/フランス)				千ユーロ	
UNIBAIL-RODAMCO SE		1	1	326	43,044
KLEPIERRE		2	2	109	14,393
GECINA SA		0.352	0.506	57	7,637
FONCIERE DES REGIONS		0.350	0.443	37	4,884
ICADE		0.449	0.480	31	4,162
小 計		4	5	562	74,122
		銘柄数 <比率>	5	5	— <0.1%>
ユーロ計		4	5	562	74,122
		銘柄数 <比率>	5	5	— <0.1%>
合 計		634	676	—	1,205,171
		銘柄数 <比率>	60	60	— <2.4%>

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

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

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

(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	S&P 500 EMINI FUTURE	百万円 1,214	百万円 —
	DJ EURO STOXX 50	604	—

(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

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 47,696,457	% 93.3
投 資 信 託 証 券	1,205,171	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,232,697	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額	51,134,326	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122.96円、1カナダ・ドル92.42円、1オーストラリア・ドル88.42円、1香港・ドル15.87円、1シンガポール・ドル86.96円、1ニュージーランド・ドル80.65円、1イギリス・ポンド187.85円、1イスラエル・シケル31.74円、1スイス・フラン121.18円、1デンマーク・クローネ17.66円、1ノルウェー・クローネ14.27円、1スウェーデン・クローナ14.15円、1ユーロ131.76円です。

(注2) 外貨建純資産(50,614,764千円)の投資信託財産総額(51,134,326千円)に対する比率は99.0%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

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	51,133,382,221円
コール・ローン等	1,088,402,269
株 式(評価額)	47,696,457,467
投資信託証券(評価額)	1,205,171,823
未 収 入 金	42,331,582
未 収 配 当 金	89,473,109
差 入 委 託 証 拠 金	1,011,545,971
(B) 負 債	253,194,043
未 払 金	1,236,509
未 払 解 約 金	251,957,534
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	50,880,188,178
元 本	35,008,790,381
次 期 繰 越 損 益 金	15,871,397,797
(D) 受 益 権 総 口 数	35,008,790,381口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,534円

(注1) 期首元本額	34,647,225,091円
期中追加設定元本額	10,252,542,992円
期中一部解約元本額	9,890,977,702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)	278,615,081円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	1,896,276,758円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,651,202,428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)	11,034,706,520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)	6,967,231,514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	13,093,548,146円
DCニッセイ外国株式インデックス	2,911,000円
ニッセイターゲットデートファンドI(適格機関投資家限定)	239,362円
ニッセイターゲットデートファンドII(適格機関投資家限定)	196,060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)	83,863,512円

## ◆損益の状況

当期 (2015年5月21日～2015年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	507,761,618円
受 取 配 当 金	506,754,323
受 取 利 息	237,505
そ の 他 収 益 金	769,790
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,428,708,172
売 買 益	2,415,441,812
売 買 損	△ 4,844,149,984
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 15,434,836
取 引 益	250,320,234
取 引 損	△ 265,755,070
(D) 信 託 報 酬 等	△ 28,435,727
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 1,964,817,117
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	17,444,758,199
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,455,983,458
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 4,064,526,743
(I) 合 計 (E+F+G+H)	15,871,397,797
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	15,871,397,797

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