

第3期末 (2016年11月21日)	
基準価額	10,303円
純資産総額	44億円
騰落率	△10.4%
分配金	0円

＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイ外国債券 インデックスファンド

追加型投信／海外／債券／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間：2015年11月21日～2016年11月21日

第3期 (決算日 2016年11月21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>ニッセイ外国債券インデックスファンド」は、このたび第3期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ外国債券インデックススマザーファンド」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国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。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。

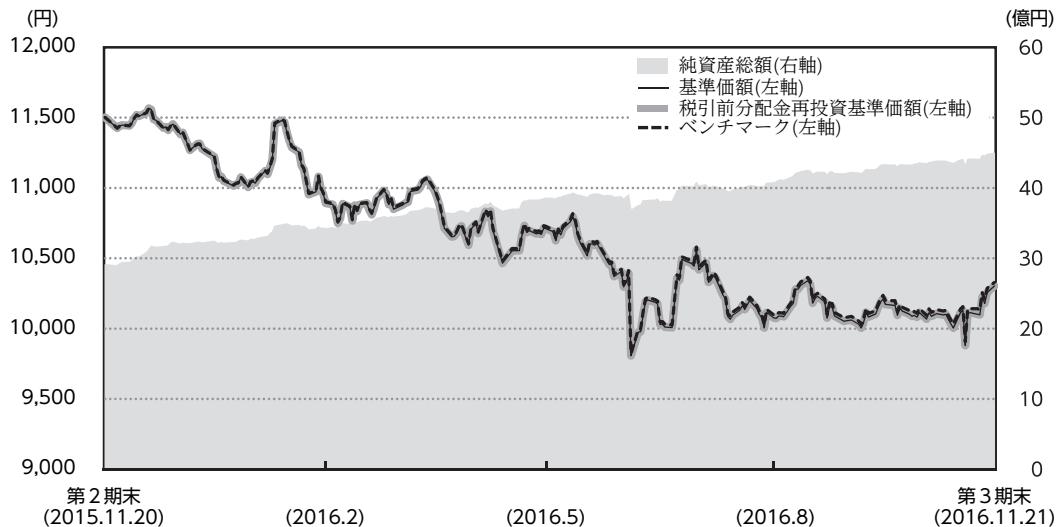
商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先
 **0120-762-506** (コールセンター)
 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。
 <http://www.nam.co.jp/>
 お客様の口座内容に関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

 **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11月21日～2016年11月21日

基準価額等の推移



第3期首	11,502円	既払分配金	0円
第3期末	10,303円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△10.4%

(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標化しています。

(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) ベンチマークはシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指標化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指標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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLCは、当ファンドの運用成績等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、世界的な景気後退懸念や米連邦準備制度理事会（F R B）による利上げ回数予想の下方修正などを背景とした円高を受けて、下落基調で推移しました。6月下旬のイギリス国民投票の結果が欧州連合（E U）離脱となると、一段と円高が進行し、基準価額は続落する展開となりました。その後は、日銀の金融政策への期待と失望を軸に上下での推移となりましたが、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことから、米ドル高円安が進行したため、基準価額も上昇基調で当期末を迎えるました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド

1万口当たりの費用明細

2015年11月21日～2016年11月21日

項目	第3期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	23円	0.216%	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10,623円です。
(投信会社)	(10)	(0.092)	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)	(10)	(0.092)	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)	(0.032)	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
その他費用	7	0.070	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.008)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(7)	(0.061)	<ul style="list-style-type: none"> ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	30	0.286	

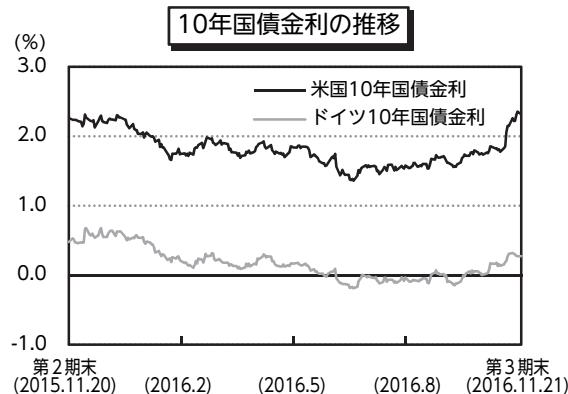
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

投資環境

海外債券市況

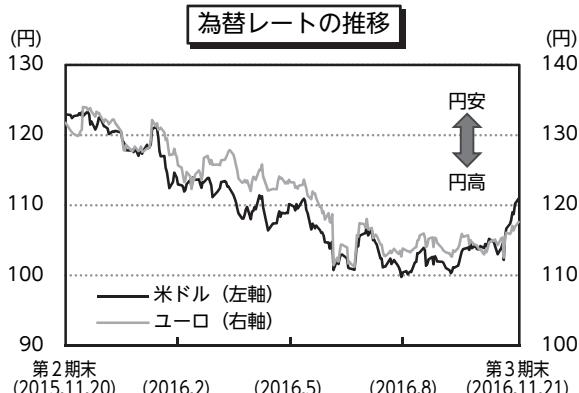


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

米国10年国債金利は、F R Bによる利上げと株安の中、2015年末までは2.2%台を中心に推移しました。年明け後は、世界的な景気後退懸念から低下基調となり、米利上げ回数予想の下方修正や、6月下旬に行われたイギリス国民投票の結果を受けて、1.3%近辺まで低下しました。その後は、欧州中央銀行（E C B）による追加緩和の見送りや、米国における年内利上げ観測の高まりなどを背景に上昇しました。当期末にかけては、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け、財政拡大に伴うインフレ期待の高まりなどを背景に、2.3%台まで急上昇する展開となりました。

ドイツ10年国債金利は、世界的な景気後退懸念やE C Bによる金融緩和拡大を背景に低下基調が続いた後、6月のイギリス国民投票の結果を受けて、-0.2%近辺まで低下しました。その後は、E C Bの追加緩和が見送られたことなどから反転上昇し、結局、0.2%台で当期末を迎えました。

為替市況



(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

米ドル／円レートは、F R Bによる利上げと株安の中、2015年末までは120円台で推移しました。年明け後は、世界的な景気後退懸念から下落基調となり、米利上げ回数予想の下方修正などを背景に下落しました。6月下旬になると、イギリス国民投票の結果を受けて、一時99円近辺まで下落しましたが、その後は、日銀の金融政策への期待と失望を軸に上下する展開となりました。当期末にかけては、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け、米金利が上昇したことなどを背景に大幅上昇し、結局、110円台後半で当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、世界的な景気後退懸念やE C Bによる金融緩和拡大などを背景に低下基調で推移し、6月下旬になると、イギリスの国民投票結果を受けて、110円を割り込む水準まで下落しました。その後は、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け、米ドルが上昇したことについて上昇し、結局、117円台後半で当期末を迎えました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド

ポートフォリオ

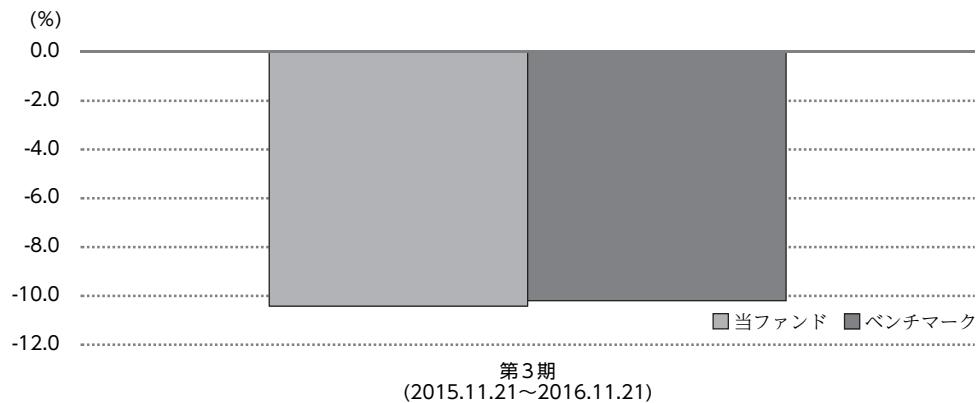
当ファンド

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国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-10.4%となり、ベンチマーク騰落率（-10.2%）におおむね連動しました。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送さ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
	2015年11月21日 ～2016年11月21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	1,694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国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

マザーファンド

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	ベンチマーク	期中 騰落率	債券 組入比率	純資産 総額
		税引前 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 14
1期(2014年11月20日)	11,670	0	16.7	11,670	11,734	17.3	98.2	1,554
2期(2015年11月20日)	11,502	0	△ 1.4	11,502	11,629	△ 0.9	98.6	2,910
3期(2016年11月21日)	10,303	0	△ 10.4	10,303	10,443	△ 10.2	98.7	4,494

(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) ベンチマークはシティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、設定時を10,000として指数化しています。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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLCは、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」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	騰落率	債券 組入比率
			騰落率			
(期首) 2015年11月20日	円 11,502	% —		11,629	% —	% 98.6
11月末	11,442	△ 0.5		11,568	△ 0.5	98.7
12月末	11,279	△ 1.9		11,405	△ 1.9	99.0
2016年1月末	11,455	△ 0.4		11,588	△ 0.4	98.9
2月末	10,863	△ 5.6		10,990	△ 5.5	98.7
3月末	11,052	△ 3.9		11,189	△ 3.8	88.9
4月末	10,700	△ 7.0		10,833	△ 6.8	98.4
5月末	10,796	△ 6.1		10,938	△ 5.9	98.6
6月末	10,193	△ 11.4		10,325	△ 11.2	99.8
7月末	10,357	△ 10.0		10,494	△ 9.8	99.0
8月末	10,281	△ 10.6		10,417	△ 10.4	98.5
9月末	10,083	△ 12.3		10,220	△ 12.1	98.6
10月末	10,098	△ 12.2		10,237	△ 12.0	98.7
(期末) 2016年11月21日	10,303	△ 10.4		10,443	△ 10.2	98.7

(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>ニッセイ外国債券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

(2015年11月21日～2016年11月21日)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	千口 2,365,589	千円 3,065,720	千口 856,384	千円 1,106,562

(注) 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

(2015年11月21日～2016年11月21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

(2016年11月現在)

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	千口 2,095,123	千口 3,604,328	千円 4,494,597

(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債券インデックスマザーファンド全体の口数は8,069,476千口です。

◆投資信託財産の構成

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	千円 4,494,597	% 99.3
コ ー ル・ロ ー ン 等、そ の 他	31,897	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	4,526,494	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル110.95円、1カナダ・ドル82.29円、1オーストラリア・ドル81.34円、1シンガポール・ドル77.82円、1イギリス・ポンド137.16円、1スイス・フラン109.93円、1デンマーク・クローネ15.81円、1ノルウェー・クローネ12.91円、1スウェーデン・クローネ12.01円、1メキシコ・ペソ5.38円、1マレーシア・リンギット25.11円、1南アフリカ・ランド7.69円、1ポーランド・ズロチ26.48円、1ユーロ117.64円です。

(注2) ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(10,029,718千円)の投資信託財産総額(10,133,100千円)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。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年11月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	4,526,494,424円
コール・ローン等	4,487,424
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,494,597,024
未収入金	27,409,976
(B)負債	31,978,388
未払解約金	27,328,355
未払信託報酬	4,477,051
その他未払費用	172,982
(C)純資産総額(A-B)	4,494,516,036
元本	4,362,435,915
次期繰越損益金	132,080,121
(D)受益権総口数	4,362,435,915口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,303円

(注) 期首元本額 2,530,130,285円
 期中追加設定元本額 2,859,583,289円
 期中一部解約元本額 1,027,277,659円

◆損益の状況

当期 (2015年11月21日~2016年11月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 717円
受取利息	133
支払利息	△ 850
(B)有価証券売買損益	△ 309,590,825
売買益	59,039,073
売買損	△ 368,629,898
(C)信託報酬等	△ 8,482,497
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 318,074,039
(E)前期繰越損益金	48,614,672
(分配準備積立金)	(107,424,801)
(繰越欠損金)	(△ 58,810,129)
(F)追加信託差損益金*	401,539,488
(配当等相当額)	(540,925,281)
(売買損益相当額)	(△ 139,385,793)
(G)合計(D+E+F)	132,080,121
次期繰越損益金(G)	132,080,121
追加信託差損益金	401,539,488
(配当等相当額)	(546,055,053)
(売買損益相当額)	(△ 144,515,565)
分配準備積立金	193,292,045
繰越欠損金	△ 462,751,412

(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	85,867,244円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	546,055,053円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	107,424,801円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	739,347,098円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,694.80円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

運用体制の変更について

代表取締役社長に赤林富二が就任いたしました。

(2016年4月1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。

(2015年11月21日)

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／債券／インデックス型
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	主にニッセイ外国債券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国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標とします。
主要運用対象	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド
運 用 方 法	<p><購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド</p> <p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 <p>ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド</p> <p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

ニッセイ外国債券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：2016年5月21日～2016年11月21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国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、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国債
組入制限	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

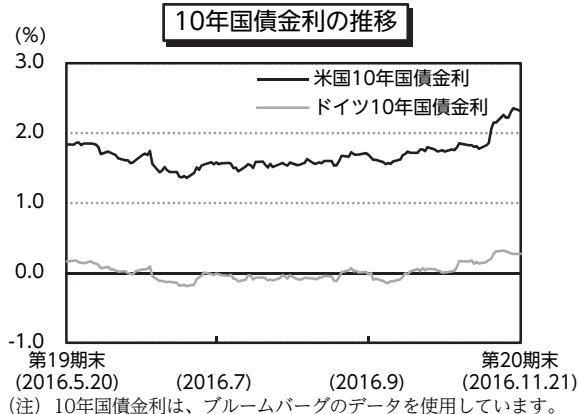
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2016年5月21日～2016年11月21日

投資環境

海外債券市況



米国10年国債金利は、6月下旬に行われたイギリス国民投票の結果が欧州連合（E U）離脱となったことから、投資家のリスク回避姿勢が強まり、7月上旬には1.3%近辺まで低下しました。その後は、世界的な政策期待やイギリスの早期政権樹立などから投資家のリスク回避姿勢が弱まり、横ばい圏での推移となりました。9月以降は、欧州中央銀行（E C B）による追加緩和の見送りや、米国の年内利上げ観測の高まりなどを背景に上昇しました。当期末にかけては、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け、財政拡大に伴うインフレ期待の高まりなどを背景に2.3%台まで急上昇して当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、イギリス国民投票の結果から投資家のリスク回避姿勢が強まり、7月には-0.2%近辺まで低下しました。その後、9月にはE C Bの追加緩和が見送られたことなどから0.3%台まで上昇しましたが、結局、0.2%台で当期末を迎きました。

為替市況



米ドル／円レートは、6月下旬に行われたイギリス国民投票の結果がE U離脱となったことから、投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、一時99円近辺まで下落しました。その後は、日銀の金融政策への期待と失望を軸に上下する展開となりましたが、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け米金利が上昇したことなどを背景に大幅上昇し、結局、110円台後半で当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、6月下旬に行われたイギリス国民投票の結果がE U離脱となったことを受けて、110円を割り込む水準まで下落しました。その後は、日銀の金融政策への期待と失望を軸に上下する展開となりましたが、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け、米ドルが上昇したことについて上昇し、結局、117円台後半で当期末を迎えました。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、米利上げ観測の後退による米ドル安円高の進行を背景に下落して始まりました。6月下旬になると、イギリス国民投票の結果がEU離脱となつたことを受けてさらに円高が進んだことから、基準価額は続落しました。その後は、日銀の金融政策への期待と失望を軸に上下する展開となり、11月の米大統領選挙においてトランプ候補が当選したことを受け米ドル高円安が進行した結果、基準価額も上昇基調で当期末を迎きました。

ポートフォリオ

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-3.7%となり、ベンチマーク騰落率（-3.7%）に連動しました。

今後の運用方針

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
			ベンチマーク	期中騰落率		
16期(2014年11月20日)	円 14,032	% 14.5	14,131	% 14.6	% 98.2	百万円 7,582
17期(2015年5月20日)	13,837	△ 1.4	13,943	△ 1.3	98.6	9,551
18期(2015年11月20日)	13,890	0.4	14,004	0.4	98.6	10,962
19期(2016年5月20日)	12,948	△ 6.8	13,060	△ 6.7	98.7	7,967
20期(2016年11月21日)	12,470	△ 3.7	12,576	△ 3.7	98.7	10,062

(注) ベンチマークはシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、設定時を10,000として、指数化しています。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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLCは、当ファンドの運用成果等に關し、一切の責任を負いません。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
			ベンチマーク		
(期首) 2016年5月20日	円 12,948	% -	13,060	% -	% 98.7
5月末	13,053	0.8	13,172	0.9	98.6
6月末	12,326	△4.8	12,434	△4.8	99.8
7月末	12,527	△3.3	12,638	△3.2	99.0
8月末	12,437	△3.9	12,545	△3.9	98.5
9月末	12,200	△5.8	12,307	△5.8	98.6
10月末	12,220	△5.6	12,327	△5.6	98.7
(期末) 2016年11月21日	12,470	△3.7	12,576	△3.7	98.7

(注) 謄落率は期首比です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆1万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2016年11月21日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.022%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(3)	(0.022)	<ul style="list-style-type: none"> ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	3	0.022	

(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（12,380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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2016年5月21日～2016年11月21日)

公社債

			買付額	売付額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 14,368	千米ドル 3,960
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 903	千カナダ・ドル 235
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 850	千オーストラリア・ドル 92
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 162	千シンガポール・ドル 21
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 1,566	千イギリス・ポンド 322
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 1,403	千デンマーク・クローネ 117
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 455	千ノルウェー・クローネ 258
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 1,083	千スウェーデン・クローナ 260
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 3,778	千メキシコ・ペソ —
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 498	千マレーシア・リンギット —
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 1,898	千南アフリカ・ランド 241
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 844	千ポーランド・ズロチ 259
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 168	千ユーロ 31
		オランダ	千ユーロ 562	千ユーロ 79
		ベルギー	千ユーロ 619	千ユーロ 120
		フランス	千ユーロ 2,670	千ユーロ 489
		ドイツ	千ユーロ 2,028	千ユーロ 503
		スペイン	千ユーロ 1,449	千ユーロ 239
		イタリア	千ユーロ 2,384	千ユーロ 377
		フィンランド	千ユーロ 156	千ユーロ 31
		オーストリア	千ユーロ 400	千ユーロ 64

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆主要な売買銘柄

(2016年5月21日～2016年11月21日)

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
US TREASURY	千円 57,466	US TREASURY	千円 67,334
US TREASURY	44,028	US TREASURY	62,707
US TREASURY	44,011	US TREASURY	59,887
US TREASURY	41,566	US TREASURY	58,748
US TREASURY	38,210	US TREASURY	56,742
US TREASURY	37,808	US TREASURY	54,416
US TREASURY	36,386	UK TREASURY	23,409
US TREASURY	35,696	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	23,036
US TREASURY	33,134	FRANCE (GOVT OF)	20,955
US TREASURY	32,871	BUONI POLIENNALI DEL TES	16,213

(注1) 金額は受渡代金（経過利子分は含まれていません）で、外国公社債は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

◆組入有価証券明細表

(2016年11月21日現在)

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
アメリカ		千米ドル 38,970	千米ドル 39,629			5年以上 17.6	2年以上 18.0	2年未満 8.1
カナダ	千カナダ・ドル 2,310	千カナダ・ドル 2,550	209,890	2.1	—	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 2,280	千オーストラリア・ドル 2,459	200,055	2.0	—	1.2	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 480	千シンガポール・ドル 499	38,863	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 4,200	千イギリス・ポンド 5,212	714,986	7.1	—	5.0	1.7	0.4
スイス	千スイス・フラン 180	千スイス・フラン 199	21,985	0.2	—	—	0.2	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 3,520	千デンマーク・クローネ 4,503	71,201	0.7	—	0.4	0.2	0.1

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,880	千ノルウェー・クローネ 2,008	千円 25,924	% 0.3	% —	% 0.1	% 0.1	% —
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 3,180	千スウェーデン・クローナ 3,740	44,927	0.4	—	0.3	0.2	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 14,680	千メキシコ・ペソ 15,112	81,305	0.8	—	0.4	0.2	0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,820	千マレーシア・リンギット 1,770	44,449	0.4	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 6,940	千南アフリカ・ランド 6,333	48,704	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 2,040	千ポーランド・ズロチ 2,143	56,757	0.6	—	0.2	0.3	0.1
ユ ロ イ 	千ユーロ 550	千ユーロ 641	75,443	0.7	—	0.4	0.3	0.1
	オランダ 1,690	2,004	235,804	2.3	—	1.4	0.6	0.3
	ベルギー 1,700	2,116	248,949	2.5	—	1.8	0.5	0.1
	フランス 6,940	8,312	977,928	9.7	—	6.0	3.2	0.6
	ドイツ 5,220	6,203	729,809	7.3	—	4.2	2.1	1.0
	スペイン 4,010	4,684	551,054	5.5	—	3.2	1.5	0.7
	イタリア 7,070	8,027	944,381	9.4	—	5.7	2.8	0.9
	フィンランド 450	507	59,646	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア 1,080	1,308	153,966	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	合 計	—	9,932,968	98.7	—	51.1	33.9	13.7

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
	%		千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ						
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/ 2/15	40	52	5,800
	US TREASURY	6.5000	2026/11/15	30	41	4,560
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	60	81	9,034
	US TREASURY	5.5000	2028/ 8/15	40	52	5,807
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	50	64	7,140
	US TREASURY	5.2500	2029/ 2/15	30	38	4,298
	US TREASURY	5.3750	2031/ 2/15	70	94	10,450
	US TREASURY	1.8750	2017/10/31	70	70	7,842
	US TREASURY	1.0000	2017/12/15	600	600	66,668
	US TREASURY	0.7500	2017/12/31	630	629	69,802
	US TREASURY	3.5000	2018/ 2/15	640	660	73,227
	US TREASURY	1.0000	2018/ 3/15	520	520	57,729
	US TREASURY	0.7500	2018/ 3/31	690	688	76,339
	US TREASURY	2.6250	2018/ 4/30	590	603	66,994
	US TREASURY	1.1250	2018/ 6/15	650	651	72,246
	US TREASURY	1.3750	2018/ 6/30	530	533	59,145
	US TREASURY	4.0000	2018/ 8/15	590	620	68,863
	US TREASURY	1.0000	2018/ 9/15	640	639	70,927
	US TREASURY	1.3750	2018/ 9/30	590	593	65,820
	US TREASURY	3.7500	2018/11/15	550	578	64,180
	US TREASURY	1.2500	2018/11/30	390	391	43,405
	US TREASURY	1.5000	2018/12/31	380	382	42,491
	US TREASURY	2.7500	2019/ 2/15	620	641	71,182
	US TREASURY	1.0000	2019/ 3/15	480	478	53,037
	US TREASURY	1.6250	2019/ 3/31	400	403	44,822
	US TREASURY	3.1250	2019/ 5/15	540	564	62,643
	US TREASURY	0.8750	2019/ 6/15	420	415	46,145
	US TREASURY	1.6250	2019/ 6/30	410	413	45,899
	US TREASURY	0.8750	2019/ 7/31	700	692	76,830
	US TREASURY	1.6250	2019/ 8/31	540	544	60,432
	US TREASURY	1.0000	2019/ 9/30	550	545	60,473
	US TREASURY	1.2500	2019/10/31	640	638	70,835
	US TREASURY	1.6250	2019/12/31	510	513	56,993
	US TREASURY	1.3750	2020/ 1/31	750	749	83,101

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額
	%		千米ドル	千米ドル	千円
アメリカ					
国債証券	US TREASURY	1.3750	2020/3/31	500	498
	US TREASURY	3.5000	2020/5/15	630	672
	US TREASURY	1.6250	2020/6/30	480	481
	US TREASURY	2.6250	2020/8/15	760	788
	US TREASURY	2.0000	2020/9/30	580	588
	US TREASURY	2.6250	2020/11/15	790	819
	US TREASURY	2.3750	2020/12/31	580	596
	US TREASURY	1.3750	2021/1/31	390	384
	US TREASURY	3.6250	2021/2/15	310	334
	US TREASURY	2.2500	2021/3/31	600	612
	US TREASURY	3.1250	2021/5/15	650	688
	US TREASURY	2.1250	2021/6/30	560	568
	US TREASURY	2.1250	2021/8/15	760	771
	US TREASURY	2.1250	2021/9/30	570	578
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	560	564
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	290	293
	US TREASURY	2.0000	2022/2/15	410	412
	US TREASURY	1.7500	2022/3/31	270	267
	US TREASURY	1.7500	2022/5/15	380	376
	US TREASURY	2.1250	2022/6/30	280	282
	US TREASURY	1.6250	2022/8/15	370	363
	US TREASURY	1.7500	2022/9/30	270	266
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	420	410
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	300	301
	US TREASURY	2.0000	2023/2/15	500	498
	US TREASURY	1.5000	2023/3/31	320	308
	US TREASURY	1.7500	2023/5/15	490	479
	US TREASURY	1.3750	2023/6/30	300	286
	US TREASURY	2.5000	2023/8/15	510	522
	US TREASURY	1.3750	2023/9/30	280	266
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	350	363
	US TREASURY	2.7500	2024/2/15	280	291
	US TREASURY	2.5000	2024/5/15	360	367
	US TREASURY	2.3750	2024/8/15	410	414
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	380	379
	US TREASURY	2.0000	2025/2/15	420	411

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
	%		千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ						
国債証券	US TREASURY	2.1250	2025/5/15	360	355	39,423
	US TREASURY	2.0000	2025/8/15	390	380	42,203
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	400	397	44,097
	US TREASURY	1.6250	2026/2/15	370	347	38,608
	US TREASURY	1.6250	2026/5/15	370	347	38,511
	US TREASURY	1.5000	2026/8/15	370	342	37,999
	US TREASURY	4.5000	2036/2/15	80	102	11,344
	US TREASURY	5.0000	2037/5/15	30	40	4,521
	US TREASURY	4.3750	2038/2/15	50	62	6,975
	US TREASURY	4.5000	2038/5/15	40	51	5,669
	US TREASURY	3.5000	2039/2/15	70	77	8,597
	US TREASURY	4.2500	2039/5/15	60	73	8,181
	US TREASURY	4.5000	2039/8/15	90	114	12,690
	US TREASURY	4.3750	2039/11/15	70	87	9,699
	US TREASURY	4.6250	2040/2/15	140	180	20,080
	US TREASURY	3.8750	2040/8/15	110	127	14,174
	US TREASURY	4.2500	2040/11/15	100	122	13,616
	US TREASURY	4.7500	2041/2/15	120	158	17,543
	US TREASURY	3.1250	2041/11/15	80	82	9,112
	US TREASURY	3.1250	2042/2/15	90	92	10,254
	US TREASURY	3.0000	2042/5/15	110	110	12,249
	US TREASURY	2.7500	2042/8/15	150	143	15,899
	US TREASURY	2.7500	2042/11/15	170	162	17,991
	US TREASURY	3.1250	2043/2/15	170	174	19,317
	US TREASURY	2.8750	2043/5/15	250	243	27,051
	US TREASURY	3.6250	2043/8/15	200	224	24,887
	US TREASURY	3.7500	2043/11/15	230	263	29,260
	US TREASURY	3.6250	2044/2/15	260	291	32,338
	US TREASURY	3.3750	2044/5/15	230	246	27,335
	US TREASURY	3.1250	2044/8/15	270	275	30,622
	US TREASURY	3.0000	2044/11/15	240	239	26,549
	US TREASURY	2.5000	2045/2/15	260	233	25,909
	US TREASURY	3.0000	2045/5/15	240	238	26,494
	US TREASURY	2.8750	2045/8/15	250	242	26,907
	US TREASURY	3.0000	2045/11/15	230	228	25,367
	US TREASURY	2.5000	2046/2/15	250	223	24,829

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY	2.5000	2046/5/15	240	214	23,834	
	US TREASURY	2.2500	2046/8/15	240	203	22,542	
	US TREASURY	6.2500	2030/5/15	60	85	9,515	
	US TREASURY	4.3750	2040/5/15	100	124	13,860	
	US TREASURY	4.3750	2041/5/15	80	100	11,101	
	US TREASURY	3.7500	2041/8/15	100	113	12,642	
小計		—	—	—	—	4,396,931	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.7500	2064/12/1	20	23	1,929
		CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2017/11/1	60	59	4,920
		CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2018/3/1	130	130	10,778
		CANADIAN GOVERNMENT	4.2500	2018/6/1	170	179	14,748
		CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2018/9/1	190	191	15,795
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2018/11/1	100	99	8,201
		CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2019/3/1	50	51	4,213
		CANADIAN GOVERNMENT	3.7500	2019/6/1	110	118	9,743
		CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2019/9/1	90	92	7,611
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2020/3/1	80	81	6,731
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2020/6/1	70	76	6,296
		CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2020/9/1	90	89	7,374
		CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/3/1	80	79	6,532
		CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2021/6/1	60	66	5,441
		CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/9/1	90	89	7,327
		CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/6/1	90	98	8,065
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/6/1	80	81	6,701
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/6/1	70	75	6,229
		CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/6/1	80	84	6,991
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/6/1	80	79	6,543
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/6/1	30	28	2,307
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/6/1	20	32	2,647
		CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/6/1	70	100	8,271
		CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/6/1	70	106	8,738
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/6/1	80	117	9,666
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/6/1	110	147	12,110
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/1	80	102	8,400
		CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/1	60	67	5,570
小計		—	—	—	—	209,890	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
		%		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2018/10/21	200	205	16,728
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.2500	2019/3/15	200	215	17,525
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2019/10/21	30	30	2,502
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2020/4/15	190	206	16,768
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/11/21	120	118	9,674
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/5/15	160	185	15,072
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/7/15	130	154	12,557
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/4/21	140	166	13,526
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/4/21	150	152	12,410
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/4/21	170	178	14,495
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/4/21	180	203	16,561
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/4/21	150	177	14,433
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	100	99	8,110
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/5/21	50	47	3,835
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/4/21	80	82	6,740
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/4/21	70	82	6,690
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/6/21	40	36	3,004
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/4/21	50	52	4,295
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/6/21	20	19	1,573
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/3/21	50	43	3,550
小計		—	—	—	—	200,055	
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5000	2018/4/1	30	29	2,316
		SINGAPORE GOVERNMENT	4.0000	2018/9/1	30	31	2,453
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5000	2019/6/1	60	61	4,803
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2020/9/1	50	53	4,133
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/6/1	40	40	3,188
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/9/1	30	31	2,486
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/7/1	30	31	2,431
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/9/1	30	31	2,465
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/6/1	20	20	1,565
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/6/1	20	19	1,526
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/3/1	30	32	2,561
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/7/1	10	10	800
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/9/1	20	20	1,587
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/9/1	50	54	4,204

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額
シンガポール	国債証券	%	2042/4/1	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	千円
				20	20	1,558
小計		—	—	—	—	38,863
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3.7500	2019/9/7	90	98
			3.7500	2020/9/7	110	123
			3.7500	2021/9/7	90	102
			4.5000	2019/3/7	100	109
			4.5000	2034/9/7	130	180
			4.5000	2042/12/7	110	164
			4.2500	2036/3/7	130	177
			4.2500	2046/12/7	100	149
			4.2500	2027/12/7	80	101
			4.2500	2032/6/7	120	159
			4.2500	2039/9/7	100	139
			4.2500	2040/12/7	100	141
			4.2500	2055/12/7	100	165
			4.7500	2020/3/7	110	125
			4.7500	2030/12/7	100	137
			4.0000	2022/3/7	70	81
			4.0000	2060/1/22	90	147
			4.7500	2038/12/7	90	133
			5.0000	2025/3/7	100	129
			5.0000	2018/3/7	110	116
			8.0000	2021/6/7	80	106
			6.0000	2028/12/7	60	88
			1.5000	2021/1/22	190	196
			1.5000	2026/7/22	70	70
			1.5000	2047/7/22	40	35
			1.7500	2019/7/22	180	186
			1.2500	2018/7/22	180	183
			1.7500	2022/9/7	150	157
			2.2500	2023/9/7	120	129
			2.7500	2024/9/7	120	133
			2.0000	2020/7/22	160	168
			2.0000	2025/9/7	140	147
						20,252

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
イギリス	国債証券	3.5000	2068/7/22	110	169	23,289	
		3.2500	2044/1/22	140	173	23,833	
		3.7500	2052/7/22	100	146	20,097	
		3.5000	2045/1/22	140	182	24,984	
		4.2500	2049/12/7	90	139	19,120	
		0.5000	2022/7/22	40	39	5,367	
		2.5000	2065/7/22	60	72	9,918	
小計		—	—	—	—	714,986	
スイス	国債証券	SWITZERLAND	2020/7/6	180	199	21,985	
小計		—	—	—	—	21,985	
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0000	2017/11/15	240	250	3,968
		KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2018/11/15	280	284	4,498
		KINGDOM OF DENMARK	4.0000	2019/11/15	530	601	9,503
		KINGDOM OF DENMARK	3.0000	2021/11/15	710	824	13,030
		KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	360	395	6,258
		KINGDOM OF DENMARK	7.0000	2024/11/10	130	200	3,172
		KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	440	493	7,800
		KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	830	1,452	22,969
小計		—	—	—	—	71,201	
ノルウェー	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	4.5000	2019/5/22	360	393	5,077
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.7500	2021/5/25	440	490	6,328
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/5/24	370	384	4,964
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/3/14	240	265	3,433
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/3/13	310	315	4,070
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/2/19	160	158	2,048
	小計		—	—	—	—	25,924
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	4.2500	2019/3/12	470	524	6,293
		SWEDISH GOVERNMENT	5.0000	2020/12/1	620	756	9,083
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/6/1	550	661	7,943
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	430	472	5,676
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/5/12	420	498	5,982
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	390	408	4,905

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額
スウェーデン	%		千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円
国債証券 SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/3/30	300	419	5,042
小計	—	—	—	—	44,927
メキシコ			千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2017/12/14	1,250	1,271
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4.7500	2018/6/14	2,050	2,005
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2018/12/13	600	623
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2019/12/11	1,190	1,139
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2020/6/11	660	688
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2021/6/10	1,600	1,580
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/6/9	500	491
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/7	510	537
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/5	1,290	1,516
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/3/5	690	623
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/6/3	410	416
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/5/31	690	755
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/5/29	800	819
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	440	451
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	340	427
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	780	861
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	880	901
小計	—	—	—	—	81,305
マレーシア			千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.3140	2017/10/31	110	110
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5800	2018/9/28	260	257
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3780	2019/11/29	200	201
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/7/31	190	188
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1600	2021/7/15	130	130
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/8/15	140	133
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/3/15	140	132
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/7/15	60	58
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/9/15	50	48
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/4/15	60	59
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/3/15	100	93
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/6/15	50	45
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/4/15	70	67
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/6/30	120	113

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
マレーシア	国債証券		%		千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/ 4/15	30	27	683
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/ 4/15	20	17	444
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/ 5/31	20	18	465
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/ 9/30	30	29	734
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/ 3/15	40	38	963
	小計		—	—	—	—	44,449
南アフリカ	国債証券				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2018/12/21	300	300	2,310
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.2500	2020/ 1/15	280	273	2,099
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/ 3/31	450	423	3,259
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/ 2/28	290	277	2,136
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	1,090	1,199	9,222
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/ 1/31	530	475	3,657
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/ 2/28	720	587	4,519
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/ 3/31	480	432	3,329
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/ 2/28	250	234	1,807
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/ 3/31	430	306	2,355
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/ 1/31	490	439	3,381
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/ 1/31	100	93	720
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/ 2/28	510	359	2,765
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/ 1/31	400	364	2,799
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/ 2/28	620	564	4,341
小計		—	—	—	—	—	48,704
ポーランド	国債証券				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2018/ 7/25	250	253	6,701
		POLAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2018/10/25	150	144	3,828
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5000	2019/10/25	220	240	6,364
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.2500	2020/10/25	280	307	8,132
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	430	485	12,846
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/ 9/23	110	124	3,307
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	200	207	5,484
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/ 7/25	130	126	3,340
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/ 7/25	230	207	5,497
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/ 4/25	40	47	1,254
	小計		—	—	—	—	56,757
	ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド	国債証券	IRISH TREASURY	0.8000	2022/ 3/15	30	31	3,658

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
アイルランド	国債証券	IRISH TREASURY	1.0000	2026/5/15	50	50
		IRISH TREASURY	2.0000	2045/2/18	30	31
		IRISH TREASURY	2.4000	2030/5/15	40	45
		IRISH TREASURY	3.4000	2024/3/18	60	72
		IRISH TREASURY	3.9000	2023/3/20	30	36
		TREASURY 4 1/2% 2018	4.5000	2018/10/18	50	54
		TREASURY 4 1/2% 2020	4.5000	2020/4/18	60	69
		TREASURY 5% 2020	5.0000	2020/10/18	50	60
		TREASURY 5.4% 2025	5.4000	2025/3/13	70	95
		TREASURY 5.9% 2019	5.9000	2019/10/18	80	94
小計		—	—	—	—	75,443
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.2500	2018/1/15	70	71
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2018/4/15	90	90
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2018/7/15	100	107
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.2500	2019/1/15	100	104
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2019/7/15	70	78
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2020/1/15	90	92
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5000	2020/7/15	90	103
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/7/15	110	128
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/1/15	50	50
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/7/15	90	102
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/1/15	90	111
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/7/15	90	100
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/7/15	90	102
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/7/15	90	89
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/7/15	80	80
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/1/15	70	108
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/1/15	80	102
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/1/15	80	128
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/1/15	90	148
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/1/15	70	102
小計		—	—	—	—	235,804
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2018/3/28	60	63
		BELGIUM KINGDOM	1.2500	2018/6/22	60	61
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2019/3/28	80	88
		BELGIUM KINGDOM	3.0000	2019/9/28	70	76

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2020/9/28	100	115	13,640
		BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/9/28	110	133	15,752
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/3/28	80	97	11,514
		BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/9/28	110	137	16,220
		BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/6/22	90	103	12,125
		BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	30	30	3,539
		BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/6/22	90	105	12,430
		BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/6/22	90	92	10,855
		BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/3/28	50	68	8,017
		BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/6/22	80	82	9,691
		BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/3/28	110	167	19,674
		BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/6/22	60	59	6,995
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/3/28	40	56	6,684
		BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/6/22	30	38	4,579
		BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/3/28	120	197	23,205
		BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/6/22	30	33	3,917
		BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/3/28	100	160	18,888
		BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/6/22	60	91	10,814
		BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/6/22	30	30	3,539
		BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/6/22	20	22	2,616
小計		—	—	—	—	248,949	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2018/2/25	110	110	13,047
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2018/4/25	180	191	22,581
		FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2018/5/25	170	174	20,490
		FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2018/11/25	330	340	40,044
		FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2019/2/25	110	111	13,097
		FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2019/4/25	310	346	40,716
		FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2019/10/25	360	404	47,621
		FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2019/11/25	80	82	9,678
		FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2020/4/25	290	328	38,663
		FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/5/25	70	70	8,339
		FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2020/10/25	170	188	22,211
		FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	180	183	21,613
		FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/4/25	260	305	35,987
		FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/5/25	90	90	10,665
		FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	220	256	30,217

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/ 4/25	240	280	32,942
		FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	170	192	22,647
		FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/ 5/25	290	320	37,688
		FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	260	333	39,191
		FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/ 5/25	200	229	26,958
		FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	170	188	22,144
		FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/ 5/25	200	200	23,528
		FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	170	251	29,611
		FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	140	144	17,040
		FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/ 4/25	200	252	29,704
		FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/ 5/25	160	157	18,496
		FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	40	38	4,478
		FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	210	252	29,742
		FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/ 4/25	180	278	32,777
		FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/ 5/25	180	214	25,272
		FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/ 5/25	130	137	16,217
		FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	190	320	37,687
		FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/ 4/25	160	254	29,937
		FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/ 5/25	60	59	6,988
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	160	241	28,447
		FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/ 4/25	170	279	32,911
		FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/ 5/25	140	196	23,074
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/ 4/25	100	167	19,738
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/ 4/25	60	103	12,181
		FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/ 5/25	30	30	3,541
小計		—	—	—	—	977,928	
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	0.2500	2018/ 4/13	170	172	20,264
		BUNDESOBLIGATION	1.0000	2018/10/12	100	103	12,141
		BUNDESOBLIGATION	1.0000	2019/ 2/22	240	249	29,306
		BUNDESOBLIGATION	0.5000	2019/ 4/12	110	113	13,303
		BUNDESOBLIGATION	0.2500	2019/10/11	80	82	9,651
		BUNDESOBLIGATION	0.0000	2020/ 4/17	110	112	13,198
		BUNDESOBLIGATION	0.2500	2020/10/16	110	113	13,325
		BUNDESOBLIGATION	0.0000	2021/ 4/ 9	120	122	14,387
		BUNDESOBLIGATION	0.0000	2021/10/ 8	60	61	7,185
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2018/ 1/ 4	160	168	19,837

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2018/7/4	110	118	13,986
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5000	2019/7/4	130	144	16,972
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2020/1/4	140	157	18,471
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0000	2020/7/4	230	259	30,581
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/1/4	100	112	13,227
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/7/4	210	246	28,943
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/1/4	100	112	13,184
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/9/4	280	309	36,362
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/2/15	110	121	14,328
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/5/15	100	110	13,054
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/8/15	100	114	13,490
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/2/15	190	215	25,354
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/5/15	100	111	13,146
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/8/15	110	118	13,971
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/2/15	140	145	17,100
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/8/15	130	140	16,483
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/2/15	150	154	18,212
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/8/15	120	116	13,751
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/1/4	50	87	10,282
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/7/4	120	203	23,949
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/1/4	140	227	26,741
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/7/4	80	138	16,282
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/7/4	90	167	19,700
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/7/4	100	156	18,358
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/7/4	100	140	16,508
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/8/15	110	156	18,369
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2017/12/15	80	80	9,485
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2018/3/16	160	161	19,002
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2018/9/14	60	60	7,146
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/7/4	60	99	11,681
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/1/4	80	126	14,898
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/7/4	70	104	12,351
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/1/4	110	185	21,821
小計		—	—	—	—	729,809	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2017/10/31	80	80	9,475
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5000	2018/1/31	120	126	14,905

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2018/ 4/30	120	120	14,197
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1000	2018/ 7/30	120	128	15,112
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.7500	2018/10/31	130	139	16,433
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2019/ 1/31	90	90	10,633
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2019/ 4/30	120	127	15,033
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6000	2019/ 7/30	130	145	17,121
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3000	2019/10/31	130	145	17,137
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2020/ 1/31	120	124	14,662
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2020/ 4/30	150	169	19,927
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.1500	2020/ 7/30	100	103	12,157
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8500	2020/10/31	100	117	13,860
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/ 4/30	150	183	21,603
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7500	2021/ 7/30	100	101	11,917
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/ 1/31	130	164	19,399
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/ 1/31	130	166	19,531
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	120	147	17,330
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/ 1/31	100	125	14,798
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/ 4/30	120	142	16,762
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	140	155	18,321
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/ 4/30	120	122	14,386
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/ 7/30	120	151	17,850
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	140	148	17,417
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/ 4/30	130	134	15,862
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/ 7/30	80	111	13,075
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	70	68	8,031
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	80	108	12,806
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/ 1/31	130	189	22,318
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/ 7/30	110	110	12,986
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/ 7/30	110	165	19,417
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/ 1/31	110	143	16,853
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/ 7/30	90	128	15,148
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/ 7/30	80	111	13,140
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	80	119	14,005
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	40	41	4,868
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/ 7/30	20	21	2,560
小計		—	—	—	—	551,054	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7500	2018/1/15	200	201	23,759
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2018/2/1	130	137	16,122
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2500	2018/5/15	210	210	24,778
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2018/8/1	160	171	20,221
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3000	2018/10/15	70	70	8,259
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2018/12/1	110	117	13,809
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/2/1	290	315	37,076
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1000	2019/4/15	100	99	11,707
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2019/5/1	100	105	12,385
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/9/1	230	254	29,960
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0500	2019/12/1	90	91	10,790
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2020/3/1	280	314	36,982
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7000	2020/5/1	90	90	10,659
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2020/9/1	140	157	18,575
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2020/11/1	70	70	8,251
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/3/1	120	135	15,923
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/5/1	140	158	18,604
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2021/6/1	90	88	10,425
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/8/1	330	374	44,044
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	130	137	16,208
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/4/15	250	253	29,810
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/9/1	140	174	20,470
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/9/15	80	81	9,550
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/1	130	161	19,005
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/3/15	80	78	9,198
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/5/1	140	167	19,649
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/8/1	130	158	18,588
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	40	37	4,454
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/1	70	104	12,304
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/3/1	140	167	19,705
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/9/1	120	137	16,178
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/1	120	126	14,876
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/3/1	140	174	20,521
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/6/1	120	116	13,732
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/1	120	120	14,167
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/3/1	120	145	17,070

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/6/1	90	87	10,261
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/1	50	46	5,478
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/1	150	213	25,105
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/9/1	130	163	19,261
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/1	170	225	26,571
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/3/1	140	158	18,650
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/5/1	170	243	28,668
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/3/1	120	109	12,858
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/2/1	100	141	16,693
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/8/1	130	172	20,349
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/9/1	60	56	6,642
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/2/1	170	201	23,728
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/8/1	100	133	15,700
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/9/1	130	173	20,385
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/9/1	90	117	13,770
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/9/1	70	72	8,513
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/3/1	80	74	8,731
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/3/1	30	26	3,066
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/1	70	102	12,110
小計		—	—	—	—	944,381	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2018/9/15	40	41	4,854
		FINNISH GOVERNMENT	4.3750	2019/7/4	20	22	2,658
		FINNISH GOVERNMENT	3.3750	2020/4/15	60	67	7,980
		FINNISH GOVERNMENT	0.3750	2020/9/15	30	30	3,629
		FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/4/15	30	35	4,122
		FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/9/15	20	22	2,591
		FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/4/15	30	32	3,866
		FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/9/15	20	19	2,339
		FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/4/15	20	22	2,673
		FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/7/4	40	52	6,197
		FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/9/15	20	20	2,457
		FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/4/15	40	40	4,719
		FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/7/4	30	37	4,385
		FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/4/15	20	19	2,333
		FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/7/4	30	41	4,835
小計		—	—	—	—	59,646	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利 率	償還年月日	額面金額	評価額	邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.1500	2018/10/19	110	113	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.3500	2019/3/15	80	89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.2500	2019/10/18	80	81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9000	2020/7/15	80	92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/9/15	100	118	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/4/20	60	72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	70	84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	60	67	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	50	55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	60	64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/3/15	60	84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	40	40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/7/15	40	63	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/5/23	30	37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/3/15	80	126	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/6/20	40	58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/2/20	20	21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/1/26	20	36	
小計		—	—	—	—	153,966	
ユーロ小計		—	—	—	—	3,976,983	
合計		—	—	—	—	9,932,967	

◆投資信託財産の構成

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	9,932,968	% 98.0
コ ー ル・ロ ー ン 等、そ の 他	200,132	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,133,100	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル110.95円、1カナダ・ドル82.29円、1オーストラリア・ドル81.34円、1シンガポール・ドル77.82円、1イギリス・ポンド137.16円、1スイス・フラン109.93円、1デンマーク・クローネ15.81円、1ノルウェー・クローネ12.91円、1スウェーデン・クローネ12.01円、1メキシコ・ペソ5.38円、1マレーシア・リンギット25.11円、1南アフリカ・ランド7.69円、1ポーランド・ズロチ26.48円、1ユーロ117.64円です。

(注2) 外貨建純資産(10,029,718千円)の投資信託財産総額(10,133,100千円)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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年11月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	10,172,984,502円
コール・ローン等	126,625,937
公社債(評価額)	9,932,968,182
未収入金	42,158,006
未収利息	62,552,473
前払費用	8,679,904
(B)負債	110,251,000
未払金	78,359,364
未払解約金	31,891,495
その他未払費用	141
(C)純資産総額(A-B)	10,062,733,502
元本	8,069,476,848
次期繰越損益金	1,993,256,654
(D)受益権総口数	8,069,476,848口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,470円

(注1) 期首元本額 6,153,967,640円
 期中追加設定元本額 2,620,156,878円
 期中一部解約元本額 704,647,670円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペピ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) 661,053,879円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 1,644,808,999円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 620,179,317円
 ニッセイ外国債券インデックスファンド(道格機関投資家限定) 790,817円
 ニッセイ厚生年金型バランス運用(現物型) DB(道格機関投資家限定) 1,279,158,128円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド 3,604,328,007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) 254,082,436円
 DCニッセイ外国債券インデックス 4,977,247円
 DCニッセイターゲットデータファンド 2,055 98,018円

◆損益の状況

当期 (2016年5月21日~2016年11月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	108,115,826円
受取利息	108,141,993
支払利息	△ 26,167
(B)有価証券売買損益	△ 367,356,294
売買益	151,270,962
売買損	△ 518,627,256
(C)信託報酬等	△ 1,892,272
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 261,132,740
(E)前期繰越損益金	1,813,950,338
(F)追加信託差損益金	605,936,810
(G)解約差損益金	△ 165,497,754
(H)合計(D+E+F+G)	1,993,256,654
次期繰越損益金(H)	1,993,256,654

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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