

<債券重視型>

第16期末 (2019年2月21日)

基準価額	17,614円
純資産総額	101億円
騰落率	0.2%
分配金	0円

<標準型>

第16期末 (2019年2月21日)

基準価額	20,548円
純資産総額	240億円
騰落率	△0.4%
分配金	0円

<株式重視型>

第16期末 (2019年2月21日)

基準価額	23,458円
純資産総額	123億円
騰落率	△1.1%
分配金	0円

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 0120-762-506 (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

DCニッセイ ワールドセレクトファンド 債券重視型／標準型／株式重視型

追加型投信／内外／資産複合

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2018年2月22日～2019年2月21日

第16期(決算日 2019年2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「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) / (標準型) / (株式重視型)」は、このたび第16期の決算を行いました。

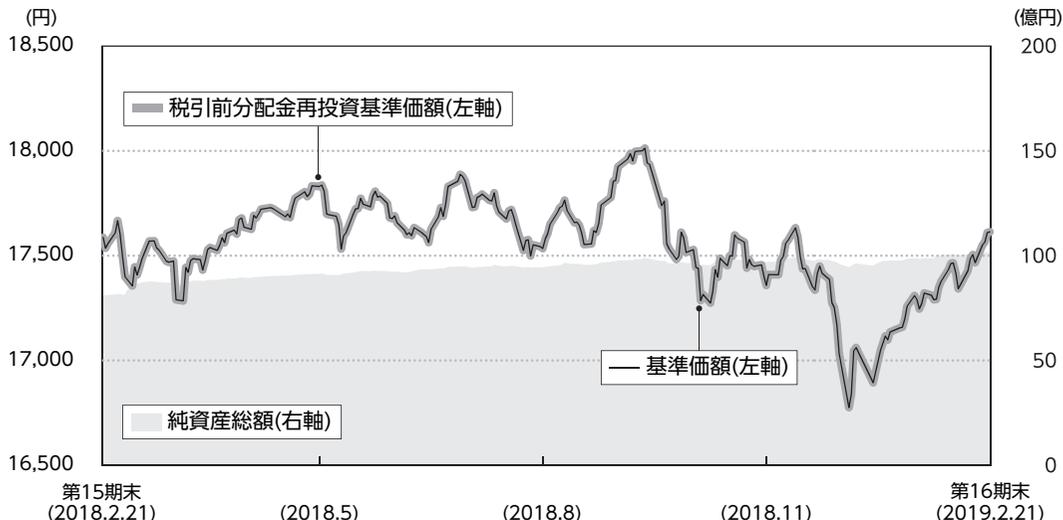
各ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2018年2月22日～2019年2月21日

基準価額等の推移



第16期首	17,587円	既払分配金	0円
第16期末	17,614円	騰落率(分配金再投資ベース)	0.2%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。以下同じです。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期を通じて見ると上昇しました。為替市場において米ドルが対円で上昇したことや内外の長期金利が低下（債券価格は上昇）したことが上昇要因となる一方、国内株式市場が下落したことが主な下落要因となりました。12月には、世界景気への懸念が強まったことを受けて内外の株価が大きく下落したことから基準価額も下落しましたが、1月以降は内外の株価が反発したことから上昇し、結局、前期末比で見ると上昇して当期末を迎えました。

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	20.0%	20.2%	△6.4%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	45.0	44.7	1.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10.0	10.2	4.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	20.0	19.9	1.6
短期金融資産	5.0	4.9	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

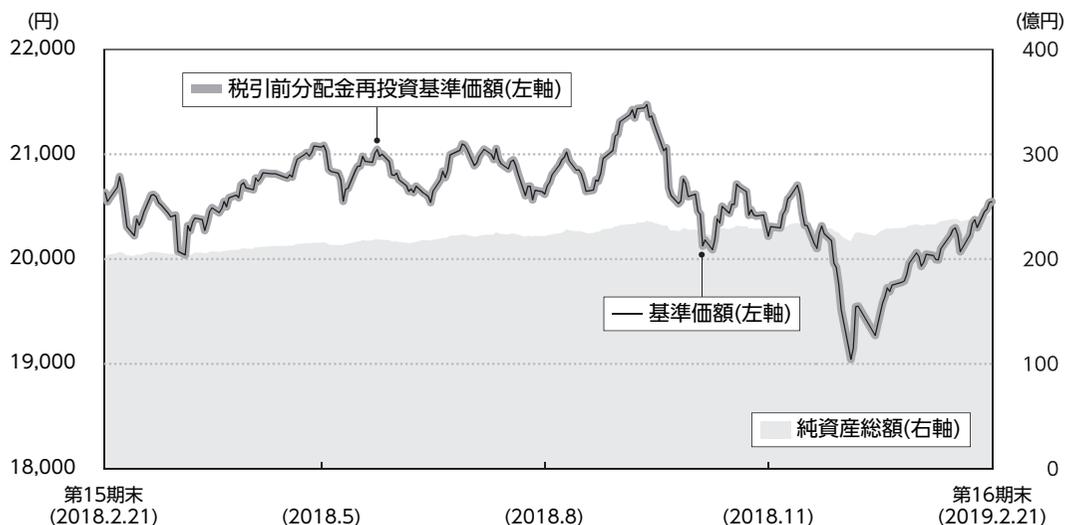
項目	第16期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	34円	0.194%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は17,562円です。</p>
(投信会社)	(15)	(0.086)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(13)	(0.076)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(6)	(0.032)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	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
(保管費用)	(2)	(0.014)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.007)	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)	(0)	(0.002)	<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	39	0.219	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

基準価額等の推移



第16期首	20,634円	既払分配金	0円
第16期末	20,548円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△0.4%

(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数化しています。

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。以下同じです。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期を通じて見ると下落しました。為替市場において米ドルが対円で上昇したことや内外の長期金利が低下(債券価格は上昇)したことが上昇要因となる一方、国内株式市場が下落したことが主な下落要因となりました。12月には、世界景気への懸念が強まったことを受けて内外の株価が大きく下落したことから基準価額も下落し、1月以降は内外の株価が反発したことから上昇したものの、結局、前期末比で見ると下落しました。

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	30.0%	30.3%	△6.4%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	30.0	29.7	1.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	20.0	20.3	4.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.0	14.9	1.6
短期金融資産	5.0	4.8	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第16期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	44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20,579円です。
(投信会社)	(20)	(0.097)	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)	(18)	(0.086)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(7)	(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
売買委託手数料	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	5	0.024	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.017)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.004)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(1)	(0.003)	・ 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	50	0.244	

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

基準価額等の推移



第16期首	23,709円	既払分配金	0円
第16期末	23,458円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△1.1%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。以下同じです。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期を通じて見ると下落しました。為替市場において米ドルが対円で上昇したことや内外の長期金利が低下（債券価格は上昇）したことが上昇要因となる一方、国内株式市場が下落したことが主な下落要因となりました。12月には、世界景気への懸念が強まったことを受けて内外の株価が大きく下落したことから基準価額も下落し、1月以降は内外の株価が反発したことから上昇したものの、結局、前期末比で見ると下落しました。

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	40.0%	40.2%	△6.4%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	15.0	14.8	1.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	30.0	30.4	4.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	10.0	9.9	1.6
短期金融資産	5.0	4.8	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第16期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	56円	0.238%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は23,614円です。</p>
(投信会社)	(26)	(0.108)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(23)	(0.097)	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)	(8)	(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
売買委託手数料	1	0.002	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	
(株式)	(1)	(0.005)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	7	0.029	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(5)	(0.020)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.006)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(1)	(0.004)	<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	65	0.274	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

■国内株式市況

当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、米国における政権運営や保護主義政策に対する先行き不透明感の強まりなどから、国内株式市場は下落基調で推移しました。

4月に入り、米中貿易摩擦への警戒感がやわらいだことや、シリアや北朝鮮に対する地政学リスク懸念の後退もあり、国内株式市場は上昇しましたが、5月下旬になると、米国の保護主義政策やイタリアの政局混迷などから下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国不安等を背景に国内株式市場は上下する展開となりましたが、9月になると同貿易摩擦への警戒感が一服し、為替市場における円安進行などもあったことから、国内株式市場は上昇しました。

しかし10月以降は、米株急落を受けた世界同時株安や消費増税に対する懸念等、景気の先行き不透明感などを背景に国内株式市場は下落に転じ、12月になると、世界景気の減速懸念が強まったことからさらに下落しました。年明け以降は、米中関係好転への期待などから国内株式市場は上昇しましたが、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■国内債券市況

当期の10年国債金利は低下しました。

期初以降、米金利の先高観などから上昇する場面もありましたが、米保護主義政策や米中貿易摩擦の強まりに対する懸念などもあり、国内金利は上下する展開となりました。

7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利は上昇し、以降、円安・株高の進行等を受けて上昇傾向となりました。

しかし10月には、日米の株価が大きく下落したことなどから金利は低下し、その後も世界景気の減速懸念を背景に低下しました。年明け後は、世界的な株価の反発から金利が上昇する場面もありましたが、米金利の先高観が弱まったことなどから国内金利も低下基調となり、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■海外株式市況

当期の海外株式市場は、おおむね上昇しました。

期初以降、米中貿易摩擦懸念により株価は一時下落する場面もありましたが、その後は、堅調な米マクロ経済指標や企業業績などに支えられ上昇基調が続きました。10月に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念、中東情勢不安、半導体大手の軟調な決算等を受けて株価は大きく下落し、12月には米中関係の悪化や、世界景気の減速懸念、米金利の逆イールド化（長短金利の逆転）、米政府機関の閉鎖懸念等を背景にさらに下落しました。1月以降は、堅調な米企業決算や米中通商協議の進展期待等から株価は上昇基調となり、結局、前期末比で見ると上昇して当期末を迎えました。

■海外債券市況

米国10年国債金利は、期初以降、米連邦準備制度理事会（F R B）の利上げ継続見通しによる先高感がありましたが、米経済指標や原油価格、地政学リスクなどの動向を背景に変動する展開となりました。また、米中貿易摩擦への懸念が台頭すると金利が低下する場面などもありました。9月には、米雇用統計の賃金上振れや新興国不安の一服などから金利は上昇基調となりましたが、11月には株価の大幅下落などから低下しました。その後も、F R Bにおける利上げ観測の後退や、株価・原油価格の大幅下落による投資家のリスク回避姿勢などから金利は低下を続けました。年明け以降、F R B議長が緩和的な姿勢に転じたとの見方などから株価が反発すると投資家のリスク回避姿勢が和らぎ、金利は反発上昇しましたが、F R Bの利上げ休止見通しなどから徐々に低下基調となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、期初以降、欧州景気の減速懸念や米中貿易摩擦への懸念などを背景に低下基調となりました。8月以降は、新興国不安の一服などから金利は上昇基調となりましたが、10月には世界的な株価下落やイタリアの財政問題などから低下し、その後も、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから低下を続けました。1月には、株価が反発したことなどから金利は上昇する場面もありましたが、欧州における景気減速懸念の再燃や米金利の低下などから低下基調となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル／円レートは上昇しました。期初以降、世界的に株価が下落したことなどから米ドルは下落しましたが、4月には、政治・地政学リスクへの懸念緩和などから上昇に転じ、その後は米金利の上昇などを背景に、米ドルは上下しつつも徐々に上昇基調となりました。12月半ば以降は、世界景気の減速懸念が一段と高まり米連邦公開市場委員会（F O M C）の利上げ見通しが下方修正となったことなどから、米ドルは下落しました。1月には、F R B議長が緩和的な姿勢に転じたとの見方などから株価が反発したことを受けて投資家のリスク回避姿勢が和らぎ、米ドルは上昇しました。その後も、米中貿易交渉の進展期待などから米ドルは上昇基調となり、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、イタリアの財政問題や米中貿易摩擦への懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やブレグジット（イギリスの欧州連合（E U）離脱）交渉の進展期待が高まる場面では上昇し、ユーロは上下する動きとなりました。10月には世界的な株価下落に加え、イタリアの財政問題やブレグジット交渉の難航などからユーロは下落し、12月半ば以降も、株価が一段と下落すると投資家のリスク回避姿勢が強まりさらに下落しました。1月以降は、株価の反発などからユーロは上昇しましたが、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■各ファンド

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの運動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流出入などに対応するため、TOPIX（東証株価指数）先物も一部利用しました。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しおおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

（注）デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

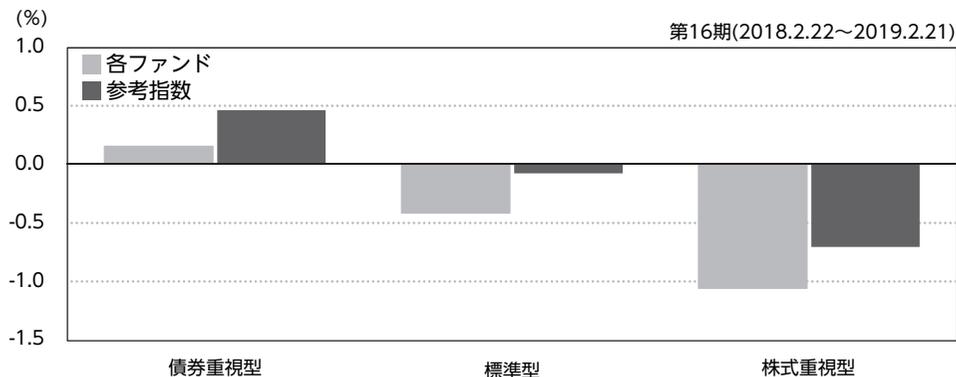
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

※ベンチマークの詳細につきましては、後掲の各マザーファンドの概要をご参照ください。以下同じです。

参考指数との差異



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

信託報酬等を控除した関係などから、各ファンドとも参考指数騰落率を下回る結果となりました。

■ 債券重視型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+0.2%となり、参考指数騰落率(+0.5%)を下回りました。

■ 標準型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.4%となり、参考指数騰落率(-0.1%)を下回りました。

■ 株式重視型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-1.1%となり、参考指数騰落率(-0.7%)を下回りました。

分配金

当期の分配金は、各ファンドとも基準価額水準、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	第16期 2018年2月22日～2019年2月21日		
	債券重視型	標準型	株式重視型
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	7,615円	10,618円	14,190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

■各ファンド

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。相場動向やその見通しによって資産配分比率を変更するファンドではありません。従って、今後も投資比率（基準ポートフォリオ）に基づいて各マザーファンド受益証券の組み入れを行い、同投資比率を継続的に維持していく予定です。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

ファンドデータ

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の組入資産の内容

■組入ファンド

	第16期末 2019年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	20.2%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	44.7
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	10.2
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	19.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

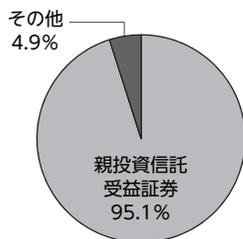
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

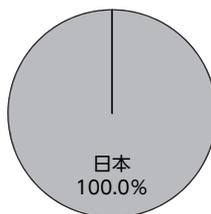
項目	第16期末 2019年2月21日
純資産総額	10,111,525,053円
受益権総口数	5,740,488,070口
1万口当たり基準価額	17,614円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,655,374,012円、同解約元本額は499,770,847円です。

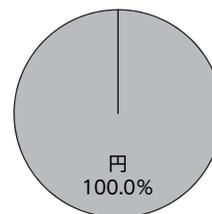
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2019年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の組入資産の内容

■組入ファンド

	第16期末 2019年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	30.3%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	29.7
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	20.3
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

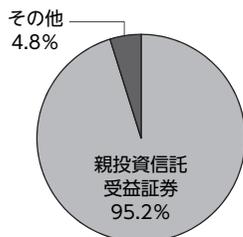
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

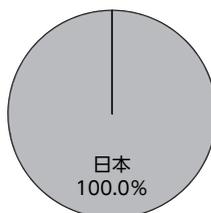
項目	第16期末 2019年2月21日
純資産総額	24,036,451,161円
受益権総口数	11,697,466,377口
1万口当たり基準価額	20,548円

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,639,726,677円、同解約元本額は799,319,778円です。

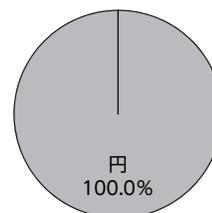
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2019年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の組入資産の内容

■組入ファンド

	第16期末 2019年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	40.2%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	14.8
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	30.4
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	9.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

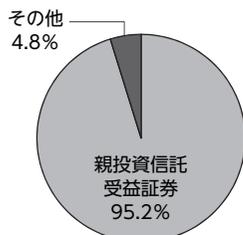
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

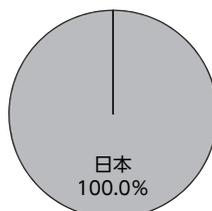
項目	第16期末 2019年2月21日
純資産総額	12,332,756,808円
受益権総口数	5,257,441,108口
1万口当たり基準価額	23,458円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,229,209,838円、同解約元本額は560,358,494円です。

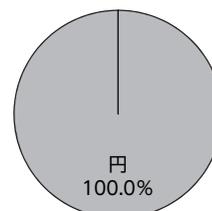
■資産別配分



■国別配分



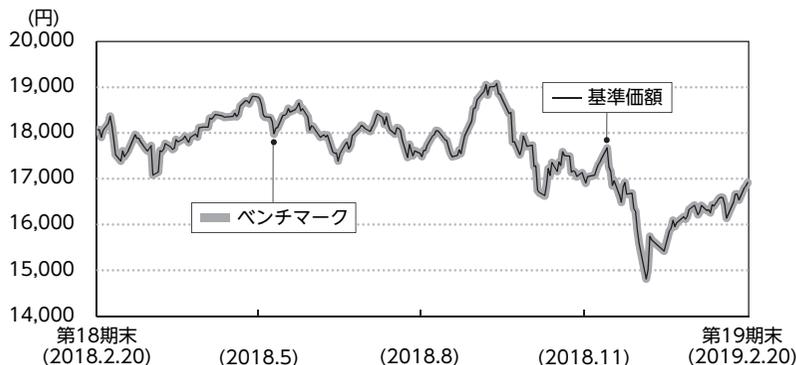
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2019年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（東証株価指数）の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。

■ 上位銘柄

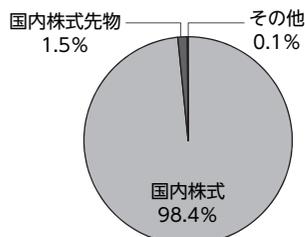
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.2%
ソフトバンクグループ	円	1.8
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
ソニー	円	1.5
日本電信電話	円	1.3
キーエンス	円	1.3
武田薬品工業	円	1.2
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.2
本田技研工業	円	1.1
みずほフィナンシャルグループ	円	1.0
組入銘柄数		1,840

■ 1万口当たりの費用明細

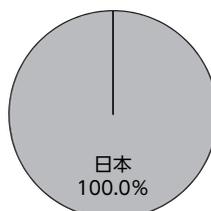
2018.2.21～2019.2.20

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

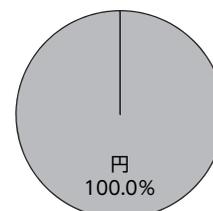
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



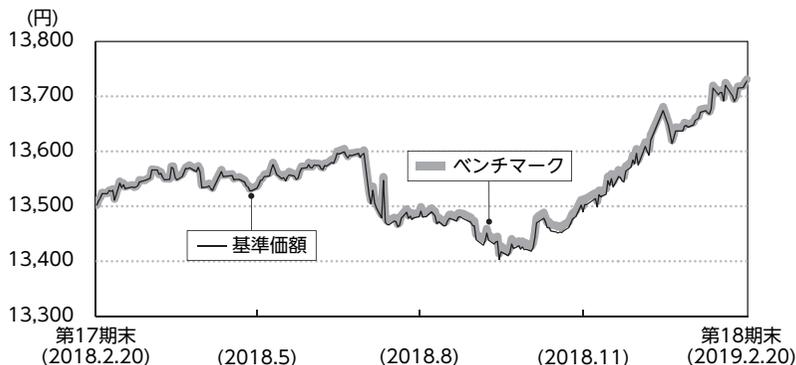
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2019年2月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村証券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村証券株式会社の知的財産です。野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。

■ 上位銘柄

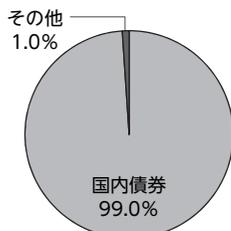
銘柄名	通貨	比率
第328回 利付国債 (10年)	円	7.4%
第338回 利付国債 (10年)	円	6.5
第392回 利付国債 (2年)	円	6.1
第110回 利付国債 (20年)	円	6.1
第129回 利付国債 (5年)	円	6.0
第94回 利付国債 (20年)	円	5.9
第125回 利付国債 (20年)	円	5.1
第18回 利付国債 (30年)	円	4.6
第143回 利付国債 (20年)	円	4.6
第346回 利付国債 (10年)	円	4.5
組入銘柄数		31

■ 1万口当たりの費用明細

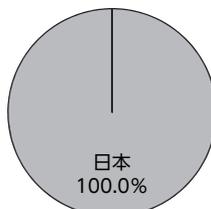
2018.2.21~2019.2.20

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

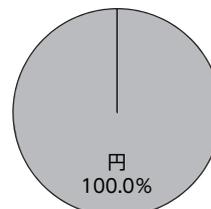
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2019年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



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

■ 上位銘柄

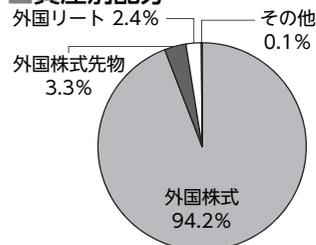
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	2.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.1%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	1.1%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0%
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	0.9%
FACEBOOK INC-A	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	0.8%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,301

■ 1万口当たりの費用明細

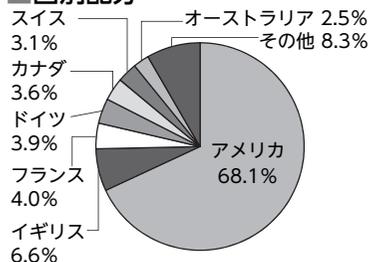
2018.5.22~2018.11.20

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

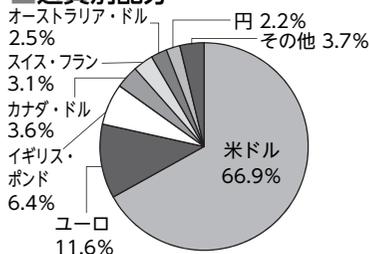
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



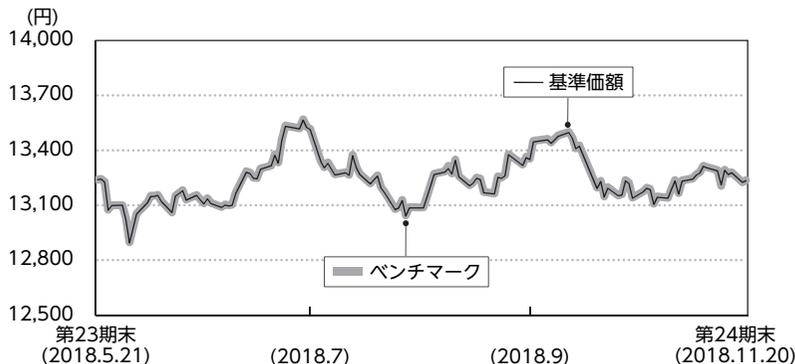
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2018年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

■ 上位銘柄

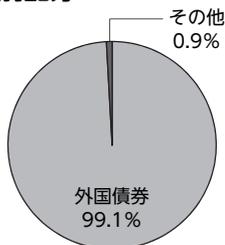
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.625% 2020/11/15	米ドル	1.0%
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.625% 2020/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.0% 2023/2/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.375% 2020/1/31	米ドル	0.9
US TREASURY 3.5% 2020/5/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.0% 2021/11/15	米ドル	0.8
US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

■ 1万口当たりの費用明細

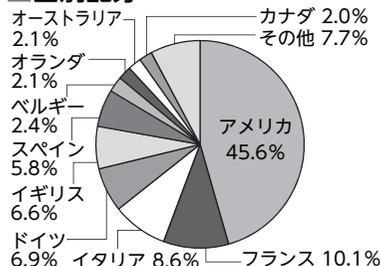
2018.5.22~2018.11.20

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

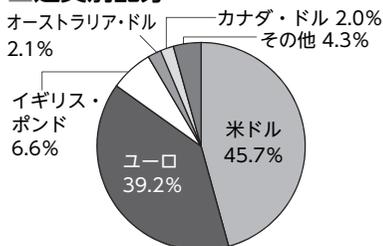
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日 (2018年11月20日現在) のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書 (全体版) の組入有価証券明細表をご参照ください。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	税引前	期中	(参考)	参考指数	期中	株式	株式	債券	投資信託	純資産
	(分配)	分配金	騰落率	基準価額+		騰落率	組入比率	先物比率	組入比率	証券組入比率	
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
12期(2015年2月23日)	16,341	0	11.4	16,341	16,955	11.7	29.7	0.6	63.7	0.2	3,980
13期(2016年2月22日)	15,825	0	△ 3.2	15,825	16,476	△ 2.8	30.2	0.8	63.1	0.2	3,885
14期(2017年2月21日)	16,728	0	5.7	16,728	17,490	6.2	29.0	0.8	64.3	0.2	4,330
15期(2018年2月21日)	17,587	0	5.1	17,587	18,431	5.4	29.6	0.6	63.9	0.2	8,063
16期(2019年2月21日)	17,614	0	0.2	17,614	18,517	0.5	29.6	0.5	64.0	0.3	10,111

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配)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3) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。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。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。以下同じです。

(注4) 先物比率は買建比率-売建比率です。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」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

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	参考指数	騰落率	株式	株式	債券	投資信託
	円	%		%	組入比率	先物比率	組入比率	証券組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2018年2月21日	17,587	-	18,431	-	29.6	0.6	63.9	0.2
2月末	17,604	0.1	18,449	0.1	29.5	0.8	63.7	0.2
3月末	17,486	△0.6	18,338	△0.5	29.1	0.9	64.4	0.2
4月末	17,722	0.8	18,588	0.8	29.6	0.8	64.0	0.2
5月末	17,595	0.0	18,459	0.1	28.8	1.0	64.5	0.2
6月末	17,634	0.3	18,505	0.4	28.5	0.8	65.2	0.2
7月末	17,761	1.0	18,640	1.1	30.1	0.6	63.8	0.2
8月末	17,715	0.7	18,598	0.9	28.9	0.9	64.4	0.2
9月末	17,997	2.3	18,892	2.5	30.3	0.6	63.5	0.2
10月末	17,433	△0.9	18,309	△0.7	27.1	0.9	66.1	0.2
11月末	17,574	△0.1	18,469	0.2	29.0	0.9	64.3	0.2
12月末	17,062	△3.0	17,931	△2.7	27.1	0.7	64.6	0.2
2019年1月末	17,349	△1.4	18,233	△1.1	30.6	0.6	62.9	0.3
(期末)2019年2月21日	17,614	0.2	18,517	0.5	29.6	0.5	64.0	0.3

(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。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2018年2月22日～2019年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	603,825	1,039,739	299,285	517,471
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	1,274,780	1,726,507	661,698	896,338
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	266,636	441,263	166,351	283,694
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	543,987	715,587	242,894	322,005

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,387,630千円	47,187,209千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,409,971千円	132,357,440千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.28	0.35

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2018年2月22日～2019年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

親投資信託残高

2019年2月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	□数	□数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	902,241	1,206,781	2,041,271
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	2,680,521	3,293,604	4,523,765
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	495,246	595,531	1,032,532
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,210,082	1,511,175	2,016,511

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の□数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが34,479,781千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが24,325,661千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが94,844,967千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが14,029,005千口です。

投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	2,041,271	20.2
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	4,523,765	44.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,032,532	10.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,016,511	19.9
コール・ローン等、その他	511,246	5.0
投資信託財産総額	10,125,327	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2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル110.70円、1カナダ・ドル84.05円、1オーストラリア・ドル79.64円、1香港ドル14.10円、1シンガポール・ドル81.92円、1ニュージーランド・ドル76.01円、1イギリス・ポンド144.37円、1イスラエル・シケル30.67円、1スイス・フラン110.62円、1デンマーク・クローネ16.82円、1ノルウェー・クローネ12.88円、1スウェーデン・クローナ11.88円、1メキシコ・ペソ5.76円、1マレーシア・リンギット27.21円、1南アフリカ・ランド7.90円、1ポーランド・ズロチ28.99円、1ユーロ125.49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（162,480,446千円）の投資信託財産総額（164,868,156千円）に対する比率は98.6%です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（18,670,440千円）の投資信託財産総額（18,809,101千円）に対する比率は99.3%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

(2019年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	10,125,327,478円
コール・ローン等	507,370,193
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,041,271,712
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,523,765,580
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,032,532,193
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,016,511,945
未収入金	3,875,855
(B)負債	13,802,425
未払解約金	3,968,697
未払信託報酬	9,498,838
その他未払費用	334,890
(C)純資産総額(A-B)	10,111,525,053
元本	5,740,488,070
次期繰越損益金	4,371,036,983
(D)受益権総口数	5,740,488,070口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,614円

(注) 期首元本額	4,584,884,905円
期中追加設定元本額	1,655,374,012円
期中一部解約元本額	499,770,847円

損益の状況

当期(2018年2月22日~2019年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 347,034円
受取利息	22,025
支払利息	△ 369,059
(B)有価証券売買損益	45,944,136
売買益	165,786,001
売買損	△ 119,841,865
(C)信託報酬等	△ 18,916,522
(D)当期損益金(A+B+C)	26,680,580
(E)前期繰越損益金	754,286,021
(分配準備積立金)	(754,445,356)
(繰越欠損金)	(△ 159,335)
(F)追加信託差損益金*	3,590,070,382
(配当等相当額)	(3,336,245,446)
(売買損益相当額)	(253,824,936)
(G)合計(D+E+F)	4,371,036,983
次期繰越損益金(G)	4,371,036,983
追加信託差損益金	3,590,070,382
(配当等相当額)	(3,336,245,446)
(売買損益相当額)	(253,824,936)
分配準備積立金	781,313,635
繰越欠損金	△ 347,034

- (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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	26,868,279円
(c) 信託約款に定める収益調整金	3,590,070,382円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	754,445,356円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	4,371,384,017円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	7,615.00円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	税引前 分配金	期中 騰落率	(参考)	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配)			基準価額+ 累計分配金							
12期(2015年2月23日)	18,574	0	15.4	18,574	19,268	15.8	49.0	1.1	43.9	0.4	13,482
13期(2016年2月22日)	17,401	0	△ 6.3	17,401	18,133	△ 5.9	49.5	1.5	43.1	0.5	12,635
14期(2017年2月21日)	19,186	0	10.3	19,186	20,088	10.8	48.2	1.4	44.4	0.5	14,588
15期(2018年2月21日)	20,634	0	7.5	20,634	21,658	7.8	49.2	1.0	44.0	0.4	20,339
16期(2019年2月21日)	20,548	0	△ 0.4	20,548	21,641	△ 0.1	49.1	0.9	44.1	0.5	24,036

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配)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3) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。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。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。以下同じです。

(注4) 先物比率は買建比率-売建比率です。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」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

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	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円							
(期首)2018年2月21日	20,634	-	21,658	-	49.2	1.0	44.0	0.4
2月末	20,674	0.2	21,700	0.2	49.0	1.4	43.8	0.4
3月末	20,392	△1.2	21,420	△1.1	48.3	1.4	44.6	0.4
4月末	20,822	0.9	21,874	1.0	49.1	1.3	44.0	0.5
5月末	20,667	0.2	21,716	0.3	48.2	1.6	44.6	0.5
6月末	20,695	0.3	21,755	0.5	48.0	1.4	45.3	0.4
7月末	20,952	1.5	22,026	1.7	49.9	0.9	43.7	0.4
8月末	20,940	1.5	22,020	1.7	48.4	1.5	44.5	0.4
9月末	21,436	3.9	22,535	4.1	50.1	0.9	43.5	0.4
10月末	20,382	△1.2	21,443	△1.0	46.2	1.5	46.4	0.4
11月末	20,598	△0.2	21,685	0.1	48.3	1.4	44.4	0.5
12月末	19,551	△5.2	20,588	△4.9	46.2	1.1	45.5	0.5
2019年1月末	20,098	△2.6	21,164	△2.3	50.1	0.9	43.0	0.5
(期末)2019年2月21日	20,548	△0.4	21,641	△0.1	49.1	0.9	44.1	0.5

(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。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2018年2月22日～2019年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	1,590,630	2,738,261	704,931	1,224,096
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	1,894,190	2,566,937	1,182,743	1,602,793
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	972,820	1,613,189	640,880	1,092,394
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	921,654	1,215,334	516,975	685,937

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,387,630千円	47,187,209千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,409,971千円	132,357,440千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.28	0.35

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2018年2月22日～2019年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

親投資信託残高

2019年2月21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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	3,416,510	4,302,209	7,277,187
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	4,480,747	5,192,194	7,131,479
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,487,198	2,819,138	4,887,822
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,277,494	2,682,173	3,579,092

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが34,479,781千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが24,325,661千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが94,844,967千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが14,029,005千口です。

投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	7,277,187	30.2
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	7,131,479	29.6
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	4,887,822	20.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3,579,092	14.9
コール・ローン等、その他	1,198,800	5.0
投資信託財産総額	24,074,381	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2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル110.70円、1カナダ・ドル84.05円、1オーストラリア・ドル79.64円、1香港ドル14.10円、1シンガポール・ドル81.92円、1ニュージーランド・ドル76.01円、1イギリス・ポンド144.37円、1イスラエル・シケル30.67円、1スイス・フラン110.62円、1デンマーク・クローネ16.82円、1ノルウェー・クローネ12.88円、1スウェーデン・クローナ11.88円、1メキシコ・ペソ5.76円、1マレーシア・リンギット27.21円、1南アフリカ・ランド7.90円、1ポーランド・ズロチ28.99円、1ユーロ125.49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（162,480,446千円）の投資信託財産総額（164,868,156千円）に対する比率は98.6%です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（18,670,440千円）の投資信託財産総額（18,809,101千円）に対する比率は99.3%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

(2019年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	24,074,381,720円
コール・ローン等	1,186,588,952
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	7,277,187,140
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,131,479,232
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,887,822,419
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,579,092,042
未収入金	12,211,935
(B)負債	37,930,559
未払解約金	12,565,885
未払信託報酬	24,880,933
その他未払費用	483,741
(C)純資産総額(A-B)	24,036,451,161
元本	11,697,466,377
次期繰越損益金	12,338,984,784
(D)受益権総口数	11,697,466,377口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,548円

(注) 期首元本額	9,857,059,478円
期中追加設定元本額	2,639,726,677円
期中一部解約元本額	799,319,778円

損益の状況

当期(2018年2月22日~2019年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 810,440円
受取利息	40,905
支払利息	△ 851,345
(B)有価証券売買損益	△ 10,973,121
売買益	422,463,400
売買損	△ 433,436,521
(C)信託報酬等	△ 48,809,124
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 60,592,685
(E)前期繰越損益金	3,942,366,972
(分配準備積立金)	(3,942,884,455)
(繰越欠損金)	(△ 517,483)
(F)追加信託差損益金*	8,457,210,497
(配当等相当額)	(8,477,612,974)
(売買損益相当額)	(△ 20,402,477)
(G)合計(D+E+F)	12,338,984,784
次期繰越損益金(G)	12,338,984,784
追加信託差損益金	8,457,210,497
(配当等相当額)	(8,477,612,974)
(売買損益相当額)	(△ 20,402,477)
分配準備積立金	3,942,884,455
繰越欠損金	△ 61,110,168

- (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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	8,477,612,974円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	3,942,884,455円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	12,420,497,429円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	10,618.11円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	税引前	期中	(参考)	参考指数	期中	株式	株式	債券	投資信託	純資産
	(分配)	分配金	騰落率	基準価額+		騰落率	組入比率	先物比率	組入比率	証券組入比率	
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
12期(2015年2月23日)	20,739	0	19.5	20,739	21,501	20.0	68.1	1.6	24.2	0.7	7,804
13期(2016年2月22日)	18,772	0	△ 9.5	18,772	19,564	△ 9.0	68.4	2.1	23.6	0.7	7,049
14期(2017年2月21日)	21,564	0	14.9	21,564	22,596	15.5	67.3	2.0	24.6	0.7	8,327
15期(2018年2月21日)	23,709	0	9.9	23,709	24,912	10.2	68.6	1.4	24.3	0.7	10,879
16期(2019年2月21日)	23,458	0	△ 1.1	23,458	24,736	△ 0.7	68.4	1.3	24.4	0.8	12,332

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配)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3) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。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。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。以下同じです。

(注4) 先物比率は買建比率-売建比率です。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」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

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	参考指数	騰落率	株式	株式	債券	投資信託
	円	%		%	組入比率	先物比率	組入比率	証券組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2018年2月21日	23,709	-	24,912	-	68.6	1.4	24.3	0.7
2月末	23,778	0.3	24,985	0.3	68.2	2.0	24.2	0.6
3月末	23,291	△1.8	24,489	△1.7	67.5	2.0	24.8	0.7
4月末	23,958	1.1	25,194	1.1	68.3	1.8	24.3	0.7
5月末	23,774	0.3	25,005	0.4	67.5	2.1	24.7	0.7
6月末	23,785	0.3	25,031	0.5	67.4	1.9	25.2	0.7
7月末	24,203	2.1	25,471	2.2	69.2	1.3	24.1	0.7
8月末	24,238	2.2	25,514	2.4	67.7	2.0	24.7	0.7
9月末	24,998	5.4	26,305	5.6	69.3	1.3	24.0	0.6
10月末	23,332	△1.6	24,572	△1.4	65.8	2.2	26.2	0.7
11月末	23,641	△0.3	24,911	△0.0	67.5	1.9	24.7	0.7
12月末	21,930	△7.5	23,120	△7.2	65.8	1.6	25.8	0.7
2019年1月末	22,785	△3.9	24,026	△3.6	69.2	1.3	23.6	0.8
(期末)2019年2月21日	23,458	△1.1	24,736	△0.7	68.4	1.3	24.4	0.8

(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。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2018年2月22日～2019年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	990,979	1,726,561	486,348	847,703
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	569,472	771,670	435,742	590,452
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	702,956	1,176,033	528,821	901,601
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	369,082	486,755	263,650	349,757

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,387,630千円	47,187,209千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,409,971千円	132,357,440千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.28	0.35

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2018年2月22日～2019年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

親投資信託残高

2019年2月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	□数	□数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	2,426,134	2,930,765	4,957,389
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	1,192,400	1,326,131	1,821,441
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,986,286	2,160,421	3,745,738
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	807,934	913,366	1,218,796

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の□数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが34,479,781千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが24,325,661千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが94,844,967千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが14,029,005千口です。

投資信託財産の構成

2019年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4,957,389	40.1
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	1,821,441	14.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,745,738	30.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,218,796	9.9
コール・ローン等、その他	616,785	5.0
投資信託財産総額	12,360,151	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2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル110.70円、1カナダ・ドル84.05円、1オーストラリア・ドル79.64円、1香港ドル14.10円、1シンガポール・ドル81.92円、1ニュージーランド・ドル76.01円、1イギリス・ポンド144.37円、1イスラエル・シケル30.67円、1スイス・フラン110.62円、1デンマーク・クローネ16.82円、1ノルウェー・クローネ12.88円、1スウェーデン・クローナ11.88円、1メキシコ・ペソ5.76円、1マレーシア・リンギット27.21円、1南アフリカ・ランド7.90円、1ポーランド・ズロチ28.99円、1ユーロ125.49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（162,480,446千円）の投資信託財産総額（164,868,156千円）に対する比率は98.6%です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（18,670,440千円）の投資信託財産総額（18,809,101千円）に対する比率は99.3%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

(2019年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	12,360,151,070円
コール・ローン等	604,500,385
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,957,389,844
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,821,441,576
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	3,745,738,245
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,218,796,352
未収入金	12,284,668
(B)負債	27,394,262
未払解約金	12,767,377
未払信託報酬	14,262,749
その他未払費用	364,136
(C)純資産総額(A-B)	12,332,756,808
元本	5,257,441,108
次期繰越損益金	7,075,315,700
(D)受益権総口数	5,257,441,108口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,458円

(注) 期首元本額	4,588,589,764円
期中追加設定元本額	1,229,209,838円
期中一部解約元本額	560,358,494円

損益の状況

当期(2018年2月22日~2019年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 413,553円
受取利息	29,703
支払利息	△ 443,256
(B)有価証券売買損益	△ 87,153,597
売買益	243,130,675
売買損	△ 330,284,272
(C)信託報酬等	△ 28,517,714
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 116,084,864
(E)前期繰越損益金	2,289,198,829
(分配準備積立金)	(2,289,466,259)
(繰越欠損金)	(△ 267,430)
(F)追加信託差損益金*	4,902,201,735
(配当等相当額)	(5,171,238,703)
(売買損益相当額)	(△ 269,036,968)
(G)合計(D+E+F)	7,075,315,700
次期繰越損益金(G)	7,075,315,700
追加信託差損益金	4,902,201,735
(配当等相当額)	(5,171,238,703)
(売買損益相当額)	(△ 269,036,968)
分配準備積立金	2,289,466,259
繰越欠損金	△ 116,352,294

- (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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	5,171,238,703円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	2,289,466,259円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	7,460,704,962円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	14,190.75円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

代表取締役社長に西啓介が就任いたしました。

(2018年3月25日)

■各ファンドの約款変更

信用リスク分散規制にかかる投資制限条項の追加および変更に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

(2018年11月22日)

■《債券重視型》の関連会社の実質保有比率

2019年1月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に12.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

■《標準型》の関連会社の実質保有比率

2019年1月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に12.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

■《株式重視型》の関連会社の実質保有比率

2019年1月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に12.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

各ファンドの概要

		債券重視型	標準型	株式重視型
商品分類	信託期間	追加型投信／内外／資産複合		
運用方針		無期限		
主要運用対象		下記マザーファンド受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。		
	DCニッセイワールドセレクトファンド	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券		
	国内株式マザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等		
	国内債券マザーファンド	国内の公社債		
	外国株式マザーファンド	日本を除く主要先進国の株式		
	外国債券マザーファンド	日本を除く主要国の国債		
投資比率		各マザーファンドへは、原則として下記の比率で投資し、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。		
	国内株式マザーファンド	20%	30%	40%
	国内債券マザーファンド	45%	30%	15%
	外国株式マザーファンド	10%	20%	30%
	外国債券マザーファンド	20%	15%	10%
	短期金融資産	5%	5%	5%
運用方法	実質投資割合	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の65%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の85%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。
	国内株式マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。		
	国内債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限ります。		
	外国株式マザーファンド	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。		
	外国債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。		
分配方針		毎決算時に、原則として経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。		

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 19 期

(計算期間：2018年2月21日～2019年2月20日)

運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



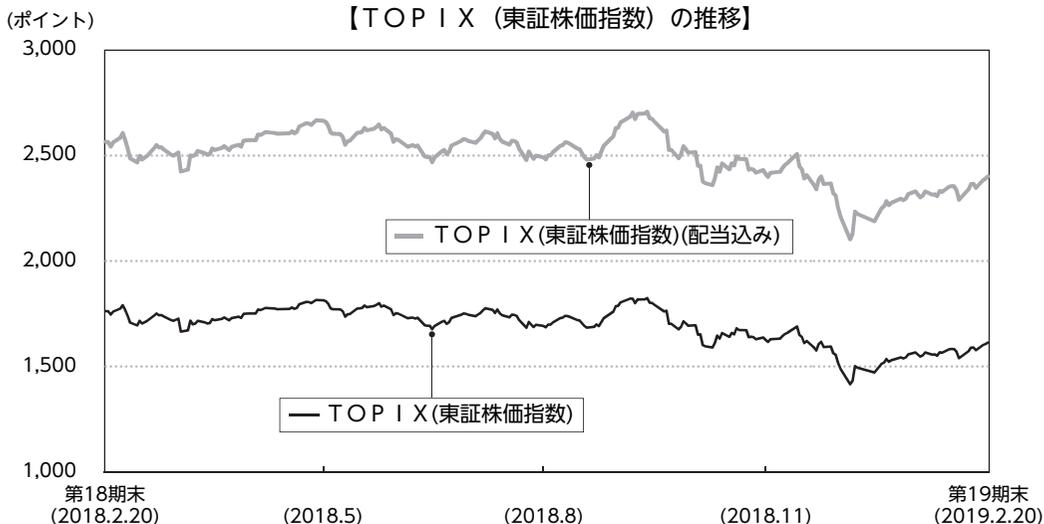
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年2月21日～2019年2月20日

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、米国における政権運営や保護主義政策に対する先行き不透明感の強まりなどから、国内株式市場は下落基調で推移しました。

4月に入り、米中貿易摩擦への警戒感がやわらいだことや、シリアや北朝鮮に対する地政学リスク懸念の後退もあり、国内株式市場は上昇しましたが、5月下旬になると、米国の保護主義政策やイタリアの政局混迷などから下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国不安等を背景に国内株式市場は上下する展開となりましたが、9月になると同貿易摩擦への警戒感が一服し、為替市場における円安進行などもあったことから、国内株式市場は上昇しました。

しかし10月以降は、米株急落を受けた世界同時株安や消費増税に対する懸念等、景気の先行き不透明感などを背景に国内株式市場は下落に転じ、12月になると、世界景気の減速懸念が強まったことからさらに下落しました。年明け以降は、米中関係好転への期待などから国内株式市場は上昇しましたが、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、米国の保護主義政策に対する懸念などを背景とした株価下落を受けて下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念や新興国不安などにより基準価額は上下する展開となりました。9月になると、同貿易摩擦に対する警戒感の一服や為替市場における円安進行等もあり、株価が上昇したことから基準価額は上昇しました。

しかし10月以降は、米株の急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念等、景気の先行き不透明感などを背景に基準価額は下落に転じ、12月になると、

世界景気の減速懸念が強まったことからさらに下落しました。年明け以降は、米中関係好転への期待などによる株価の上昇を受けて基準価額も上昇しましたが、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（東証株価指数）の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流出入などに対応するため、TOPIX（東証株価指数）先物も一部利用しました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-6.4%となり、ベンチマーク騰落率（-6.4%）に連動しました。

今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2015年2月20日)	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3	42,826
16期(2016年2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998
18期(2018年2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868
19期(2019年2月20日)	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5	58,316

(注1) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(配当込み)としており、設定時を10,000として指数化しています。なおTOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率
		%		%		
	円	%		%	%	%
(期首)2018年2月20日	18,076	-	18,261	-	98.2	1.9
2月末	18,140	0.4	18,326	0.4	97.6	2.4
3月末	17,769	△1.7	17,951	△1.7	97.0	3.0
4月末	18,403	1.8	18,589	1.8	97.4	2.5
5月末	18,102	0.1	18,278	0.1	96.0	3.9
6月末	17,953	△0.7	18,140	△0.7	97.1	3.1
7月末	18,185	0.6	18,376	0.6	98.4	1.8
8月末	18,005	△0.4	18,193	△0.4	96.8	3.2
9月末	19,007	5.2	19,203	5.2	98.1	1.8
10月末	17,222	△4.7	17,395	△4.7	96.8	3.1
11月末	17,449	△3.5	17,621	△3.5	96.6	3.4
12月末	15,663	△13.3	15,822	△13.4	97.7	2.3
2019年1月末	16,433	△9.1	16,601	△9.1	98.3	1.7
(期末)2019年2月20日	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年2月21日～2019年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
その他費用 (その他)	0 (0)	0.001 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	1	0.003	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,601円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年2月21日～2019年2月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		7,166	13,709,968	1,003	1,677,661
		(△1,277)			

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	20,510	20,478	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年2月21日～2019年2月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	55	382,948	6,962	トヨタ自動車	18	118,422	6,436
武田薬品工業	84	381,949	4,504	ソフトバンクグループ	6	51,652	8,467
ソフトバンク	194	268,384	1,382	三井住友フィナンシャルグループ	8	36,528	4,198
三菱UFJフィナンシャル・グループ	337	216,038	639	ブリヂストン	7	33,165	4,422
ソニー	35	202,735	5,726	ファーストリテイリング	0.700	32,937	47,052
ソフトバンクグループ	20	182,227	9,021	本田技研工業	9	27,688	3,009
日本電信電話	32	158,267	4,899	日本たばこ産業	8	26,413	3,107
キーエンス	2	154,275	59,336	リクルートホールディングス	9	24,653	2,709
三井住友フィナンシャルグループ	33	144,508	4,262	エヌ・ティ・ティ都市開発	14	24,528	1,680
本田技研工業	40	134,481	3,288	日本電信電話	4	22,559	4,799

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

組入有価証券明細表

2019年2月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)				
極洋	0.900	1	3,289	
日本水産	25	33	24,611	
マルハニチロ	4	4	18,130	
カネコ種苗	0.900	1	1,593	
サカタのタネ	3	4	15,272	
ホクト	2	2	5,451	
鉱業(0.3%)				
住石ホールディングス	7	6	646	
日鉄鉱業	0.600	0.800	3,644	
三井松島ホールディングス	1	1	2,165	
国際石油開発帝石	107	135	155,262	
日本海洋掘削	0.800	-	-	
石油資源開発	3	4	11,363	
K&Oエナジーグループ	1	1	2,433	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
建設業(2.9%)				
ヒノキヤグループ	-	0.800	1,841	
ショーボンドホールディングス	2	2	18,984	
ミライト・ホールディングス	6	9	16,074	
タマホーム	1	1	1,806	
ファーストコーポレーション	-	2	1,472	
ベストセラ	0.800	-	-	
TATERU	1	-	-	
スペースバリューホールディングス	-	4	3,620	
ダイセキ環境ソリューション	1	0.500	319	
安藤・間	17	21	16,567	
東急建設	8	9	9,652	
コムシスホールディングス	7	12	35,136	
ミサワホーム	1	2	1,989	
高松コンストラクショングループ	1	2	5,672	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東建コーポレーション	0.800	1	6,720
ソネック	1	2	1,503
ヤマウラ	1	1	1,471
大成建設	22	27	139,834
大林組	66	83	88,783
清水建設	67	85	80,608
飛鳥建設	20	2	3,564
長谷工コーポレーション	25	34	47,010
松井建設	2	3	2,284
銭高組	0.300	0.300	1,599
鹿島建設	98	65	104,247
不動テトラ	16	1	3,009
大末建設	0.700	1	1,502
鉄建建設	1	1	4,601
西松建設	5	6	15,048
三井住友建設	16	20	14,070
大豊建設	8	1	5,909
前田建設工業	15	19	23,064
佐田建設	2	3	1,391
ナカノフドー建設	2	3	1,542
奥村組	3	4	15,663
東鉄工業	2	3	10,032
浅沼組	8	1	2,661
戸田建設	26	32	22,874
熊谷組	3	4	13,060
青木あすなる建設	1	1	1,546
北野建設	5	0.600	1,848
植木組	0.500	0.700	1,643
三井ホーム	3	-	-
矢作建設工業	3	3	2,865
ピーエス三菱	2	2	1,812
日本ハウスホールディングス	4	5	2,316
大東建託	8	9	155,281
新日本建設	2	3	3,237
NIPPO	5	7	15,599
東亜道路工業	0.400	0.500	1,540
前田道路	7	8	18,513
日本道路	0.600	0.800	5,248
東亜建設工業	1	2	3,885
若築建設	1	1	2,095
東洋建設	7	10	4,273

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
五洋建設	26	33	18,060
世紀東急工業	3	4	2,595
福田組	0.700	0.900	3,901
住友林業	14	19	28,393
日本基礎技術	3	4	1,591
日成ビルド工業	3	-	-
巴コーポレーション	2	3	1,417
大和ハウス工業	65	77	261,630
ライト工業	4	5	8,154
積水ハウス	72	85	138,988
日特建設	2	2	1,466
北陸電気工事	1	1	1,500
ユアテック	3	4	3,987
四電工	0.500	0.600	1,614
中電工	2	3	8,406
関電工	8	12	13,220
きんでん	14	18	33,503
東京エネシス	2	2	2,830
トーエネック	0.600	0.800	2,592
住友電設	1	1	3,528
日本電設工業	3	4	11,107
協和エクシオ	8	10	31,806
新日本空調	1	2	4,363
NDS	0.300	-	-
九電工	4	5	21,175
三機工業	4	6	7,478
日揮	19	24	40,824
中外炉工業	0.700	0.800	1,417
ヤマト	1	3	1,419
太平電業	1	1	4,837
高砂熱学工業	6	7	12,600
三晃金属工業	0.300	0.500	1,490
朝日工業社	0.500	0.600	1,764
明星工業	4	5	3,670
大気社	2	3	12,141
ダイダン	1	1	4,772
日比谷総合設備	2	2	5,046
東芝プラントシステム	4	6	12,330
OSJBホールディングス	9	12	3,444
東洋エンジニアリング	2	3	2,537
千代田化工建設	14	20	6,210

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
新興プランテック	4	5	6,195	
食料品(4.3%)				
日本製粉	6	8	15,869	
日清製粉グループ本社	24	28	66,890	
昭和産業	1	2	6,969	
鳥越製粉	1	2	1,727	
中部飼料	2	3	3,261	
フィード・ワン	13	16	3,040	
東洋精糖	1	1	1,432	
日本甜菜製糖	1	1	2,555	
三井製糖	1	2	5,758	
塩水港精糖	5	6	1,507	
日新製糖	0.900	1	2,482	
森永製菓	4	6	31,122	
中村屋	0.500	0.600	2,553	
江崎グリコ	5	7	42,450	
名糖産業	1	1	1,694	
井村屋グループ	0.800	1	2,763	
不二家	1	1	3,152	
山崎製パン	16	20	39,127	
モロゾフ	0.300	0.400	2,012	
亀田製菓	1	1	8,352	
寿スピリッツ	1	2	11,375	
カルビー	9	11	35,340	
森永乳業	4	5	17,275	
六甲バター	1	1	3,587	
ヤクルト本社	11	18	137,270	
明治ホールディングス	13	17	154,521	
雪印メグミルク	4	6	16,302	
プリマハム	14	3	7,563	
日本ハム	17	10	46,170	
丸大食品	11	2	5,213	
S Foods	1	2	9,097	
伊藤ハム米久ホールディングス	12	16	10,770	
サッポロホールディングス	7	9	22,349	
アサヒグループホールディングス	41	52	252,556	
キリンホールディングス	95	113	292,218	
宝ホールディングス	14	18	23,244	
オエノンホールディングス	5	7	2,712	
養命酒製造	0.600	0.800	1,686	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14	19	57,032	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
サントリー食品インターナショナル	15	16	83,333	
ダイドールグループホールディングス	1	1	7,602	
伊藤園	6	7	39,140	
キーコーヒー	2	2	5,115	
日清オイリオグループ	2	3	10,880	
不二製油グループ本社	5	6	23,942	
かどや製油	0.200	0.300	1,512	
J-オイルミルズ	1	1	5,271	
キッコーマン	15	16	92,235	
味の素	45	55	92,294	
キューピー	11	13	35,639	
ハウス食品グループ本社	7	9	42,180	
カゴメ	8	10	29,630	
焼津水産化学工業	1	-	-	
アリアケジャパン	1	2	13,547	
エイトロ	0.800	0.900	1,476	
エバラ食品工業	0.700	0.700	1,485	
ニチレイ	9	13	35,945	
東洋水産	10	12	54,051	
イートアンド	-	0.900	1,524	
大冷	-	0.900	1,565	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	-	3	1,872	
日清食品ホールディングス	8	10	82,044	
永谷園ホールディングス	2	1	3,120	
一正蒲鉾	1	-	-	
フジッコ	2	2	6,231	
ロック・フィールド	2	2	4,363	
日本たばこ産業	123	144	407,936	
ケンコーマヨネーズ	1	1	3,103	
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,180	
なとり	1	1	2,367	
ビッグルスコオペレーション	0.800	0.700	1,325	
北の達人コーポレーション	5	9	4,331	
ユーグレナ	7	10	6,943	
ミヨシ油脂	1	1	1,491	
理研ビタミン	0.800	1	4,326	
繊維製品(0.6%)				
片倉工業	2	3	3,699	
グンゼ	1	1	8,128	
東洋紡	7	10	16,778	
ユニチカ	6	7	3,528	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富士紡ホールディングス	1	1	3,727
倉敷紡績	21	2	5,175
シキボウ	1	1	1,446
日本毛織	5	8	7,000
グイドーリミテッド	3	-	-
帝国繊維	2	2	6,679
帝人	17	19	37,193
東レ	150	189	148,651
サカイオーベックス	0.500	0.800	1,461
住江織物	0.500	0.700	1,853
日本フェルト	2	3	1,511
イチカワ	4	1	1,542
アツギ	1	2	1,920
セーレン	4	6	11,460
ソトー	1	1	1,468
東海染工	0.900	1	1,560
小松マテーレ	3	4	3,264
ワコールホールディングス	5	7	19,865
ホギメディカル	1	3	11,671
クラウドディアホールディングス	2	3	1,466
T S Iホールディングス	7	9	6,273
マツオカコーポレーション	0.400	0.800	2,696
ワールド	-	2	4,864
三陽商会	1	1	2,514
オンワードホールディングス	12	14	9,738
ゴールドウイン	0.600	2	30,118
デサント	4	5	14,224
キング	0.100	-	-
ヤマトインターナショナル	2	3	1,498
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	1	1	6,392
王子ホールディングス	87	109	72,687
日本製紙	9	11	23,996
三菱製紙	3	4	2,276
北越コーポレーション	11	16	10,319
中越パルプ工業	0.800	-	-
大王製紙	8	11	15,553
阿波製紙	2	3	1,444
レンゴー	20	25	23,158
トーモク	1	1	2,470
ザ・パック	1	1	6,146

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
化学(7.3%)			
クラレ	34	41	63,129
旭化成	129	173	210,420
共和レザー	1	1	1,483
昭和電工	13	16	63,504
住友化学	153	191	108,039
住友精化	0.900	1	5,274
日産化学	12	15	86,250
ラサ工業	0.700	1	1,684
クレハ	1	2	15,893
多木化学	0.300	0.700	3,941
テイカ	1	2	4,274
石原産業	3	4	5,724
片倉コープアグリ	1	1	1,484
日東エフシー	0.100	2	1,548
日本曹達	14	3	11,263
東ソー	30	37	62,657
トクヤマ	6	7	19,880
セントラル硝子	4	5	13,573
東亞合成	12	15	19,293
大阪ソーダ	1	2	7,217
関東電化工業	5	5	5,162
デンカ	7	9	32,976
信越化学工業	34	43	412,628
日本カーバイド工業	0.700	0.900	1,373
堺化学工業	1	1	3,907
第一稀元素化学工業	-	2	1,814
エア・ウォーター	17	20	36,640
太陽日酸	16	20	31,717
日本化学工業	0.800	0.800	1,897
日本パーカラライジング	10	13	19,431
高圧ガス工業	3	3	3,139
四国化成工業	3	4	5,362
戸田工業	0.400	0.700	1,577
ステラ ケミファ	1	1	4,417
保土谷化学工業	0.700	0.800	2,225
日本触媒	3	4	31,160
大日精化工業	1	2	6,340
カネカ	28	6	29,087
三菱瓦斯化学	17	25	44,979
三井化学	18	22	62,786

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
J S R	20	24	45,080
東京応化工業	3	4	14,364
大阪有機化学工業	1	2	2,792
三菱ケミカルホールディングス	139	163	135,974
K H ネオケム	3	3	11,026
ダイセル	28	37	43,547
住友ベークライト	17	4	18,312
積水化学工業	43	53	93,221
日本ゼオン	17	22	25,564
アイカ工業	5	7	28,178
宇部興産	10	12	31,672
積水樹脂	3	4	8,492
タキロンシーアイ	4	5	3,211
旭有機材	1	1	2,883
日立化成	10	11	23,458
ニチバン	1	1	2,915
リケンテクノス	4	6	3,154
大倉工業	5	1	2,122
積水化成成品工業	2	3	3,484
群栄化学工業	0.500	0.600	1,663
タイガースポリマー	-	2	1,542
ミライアル	0.700	1	1,549
ダイキョーニシカワ	4	5	6,461
竹本容器	-	1	1,452
森六ホールディングス	0.800	1	3,333
日本化薬	13	15	20,181
カーリットホールディングス	1	2	2,176
日本精化	1	2	2,430
扶桑化学工業	1	2	5,442
トリケミカル研究所	-	0.500	2,515
A D E K A	8	12	20,724
日油	8	9	35,955
新日本理化	5	7	1,432
ハリマ化成グループ	1	2	2,174
花王	48	60	503,011
第一工業製薬	4	0.900	2,781
石原ケミカル	-	0.900	1,660
日華化学	-	0.900	852
ニイタカ	0.500	1	1,483
三洋化成工業	1	1	8,800
有機合成薬品工業	4	6	1,352

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大日本塗料	2	2	3,236
日本ペイントホールディングス	16	20	83,415
関西ペイント	21	27	58,142
中国塗料	5	8	8,048
日本特殊塗料	1	1	2,453
藤倉化成	2	3	2,036
太陽ホールディングス	1	2	7,490
D I C	8	11	39,105
サカタインクス	4	5	6,545
東洋インキSCホールディングス	21	5	13,759
T & K T O K A	1	1	1,976
富士フイルムホールディングス	41	51	260,309
資生堂	36	49	357,142
ライオン	27	34	77,415
高砂香料工業	1	1	6,222
マンダム	3	5	15,545
ミルボン	2	3	15,298
ファンケル	4	11	27,949
コーセー	3	4	76,440
コタ	0.900	1	1,806
シーズ・ホールディングス	2	-	-
シーボン	0.400	0.600	1,602
ポーラ・オルビスホールディングス	8	10	33,496
ノエビアホールディングス	1	1	8,560
アジュバンコスメジャパン	1	1	1,468
エステー	1	1	3,456
アグロ カネショウ	0.800	1	2,086
コニシ	3	4	7,466
長谷川香料	2	3	5,199
星光PMC	1	1	1,565
小林製薬	5	7	62,510
荒川化学工業	1	2	3,110
メック	1	1	1,963
日本高純度化学	0.600	0.700	1,665
タカラバイオ	5	6	15,398
J C U	1	3	5,987
新田ゼラチン	-	2	1,575
デクセリアルズ	5	6	5,216
アース製薬	1	1	9,490
北興化学工業	2	2	1,482
大成ラミック	0.600	0.800	2,299

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クミアイ化学工業	9	10	7,333
日本農薬	5	6	2,958
アキレス	1	1	3,688
有沢製作所	3	3	3,182
日東電工	15	18	113,946
レック	1	2	4,446
藤森工業	1	2	6,809
前澤化成工業	1	1	1,705
未来工業	—	1	3,129
J S P	1	1	3,687
エフピコ	1	2	13,755
天馬	1	1	3,447
信越ポリマー	4	4	3,757
東リ	4	6	1,689
ニフコ	3	10	27,890
バルカー	1	2	4,612
ユニ・チャーム	42	52	186,912
医薬品(5.4%)			
協和発酵キリン	24	31	66,924
武田薬品工業	73	157	708,837
アステラス製薬	203	229	391,756
大日本住友製薬	14	18	51,300
塩野義製薬	28	32	228,069
田辺三菱製薬	24	26	41,730
わかもと製薬	5	5	1,478
あすか製薬	2	3	3,744
日本新薬	5	6	44,460
ビオフェルミン製薬	0.500	—	—
中外製薬	20	26	190,060
科研製薬	3	4	23,805
エーザイ	23	29	265,488
ロート製薬	10	12	38,528
小野薬品工業	46	58	134,093
久光製薬	5	7	41,218
持田製薬	1	1	21,831
参天製薬	37	47	74,056
扶桑薬品工業	0.700	0.900	2,317
ツムラ	7	7	27,296
日医工	5	6	10,195
キッセイ薬品工業	3	4	12,848
生化学工業	3	4	6,585

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
栄研化学	1	4	11,308
日水製薬	—	1	1,301
鳥居薬品	1	1	3,038
J C R ファーマ	1	1	10,260
東和薬品	1	1	10,560
富士製薬工業	0.700	1	3,134
沢井製薬	4	5	30,651
ゼリア新薬工業	4	4	9,305
第一三共	56	71	277,964
キョーリン製薬ホールディングス	5	5	12,347
大幸薬品	1	1	2,018
ダイト	1	1	4,252
大塚ホールディングス	41	47	214,864
大正製薬ホールディングス	4	5	63,504
ペプチドリーム	8	12	62,744
石油・石炭製品(0.7%)			
日本コークス工業	16	21	2,121
昭和シェル石油	18	23	40,319
ニチレキ	2	3	3,616
ユシロ化学工業	1	1	1,708
ビーピー・カストロール	0.800	1	1,635
富士石油	4	6	1,752
MORESCO	0.700	0.700	1,132
出光興産	16	19	80,288
J X T Gホールディングス	316	418	237,989
コスモエネルギーホールディングス	5	7	17,560
ゴム製品(0.8%)			
横浜ゴム	11	14	33,321
TOYO TIRE	11	12	18,201
ブリヂストン	70	76	336,370
住友ゴム工業	20	22	31,920
藤倉ゴム工業	1	1	697
オカモト	7	1	9,911
フコク	0.900	1	1,484
ニッタ	2	2	10,934
住友理工	3	4	4,900
三ツ星ベルト	5	3	7,174
バンドー化学	3	4	5,564
ガラス・土石製品(0.9%)			
日東紡績	2	3	7,259
A G C	20	24	96,309

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本板硝子	10	11	11,578
石塚硝子	—	0.700	1,215
日本山村硝子	8	1	1,491
日本電気硝子	8	10	32,724
オハラ	0.800	1	1,742
住友大阪セメント	39	5	23,575
太平洋セメント	12	15	58,090
日本ヒューム	2	2	2,037
日本コンクリート工業	4	5	1,618
三谷セキサン	1	1	3,396
アジアパイルホールディングス	2	3	2,194
東海カーボン	18	22	34,239
日本カーボン	1	1	6,180
東洋炭素	1	1	3,235
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	7,950
ＴＯＴＯ	15	19	83,232
日本碍子	24	30	51,315
日本特殊陶業	17	21	49,959
MA R U W A	0.700	0.900	5,688
品川リフラクトリーズ	0.500	0.700	2,411
黒崎播磨	0.400	0.500	2,850
ヨータイ	0.500	2	1,315
東京窯業	3	—	—
ニッカトー	1	1	1,454
フジインコーポレーテッド	1	2	5,132
エーアンドエーマテリアル	1	1	1,662
ニチアス	11	6	14,144
ニチハ	3	3	10,972
鉄鋼(1.0%)			
新日鐵住金	87	114	232,232
神戸製鋼所	35	45	40,093
中山製鋼所	2	3	1,689
合同製鐵	1	1	2,088
ジェイ エフ イー ホールディングス	52	66	128,644
日新製鋼	5	—	—
東京製鐵	10	13	11,616
共英製鋼	2	2	4,804
大和工業	4	5	15,808
東京鐵鋼	0.800	1	1,574
大阪製鐵	1	1	2,985

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
淀川製鋼所	2	3	7,434
東洋鋼鈑	5	—	—
丸一鋼管	6	8	28,927
モリ工業	0.600	0.700	1,806
大同特殊鋼	3	4	18,920
日本高周波鋼業	1	2	1,523
日本冶金工業	16	20	4,977
山陽特殊製鋼	2	3	7,768
愛知製鋼	1	1	4,956
日立金属	21	26	30,077
日本金属	0.500	0.600	778
大平洋金属	1	1	5,001
新日本電工	11	14	3,469
栗本鐵工所	1	1	1,810
三菱製鋼	1	1	2,959
日亜鋼業	3	5	1,770
日本精線	0.300	0.400	1,354
シンニッタン	0.700	4	1,597
新家工業	0.600	—	—
非鉄金属(0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	3	4	2,516
日本軽金属ホールディングス	57	67	16,439
三井金属鉱業	5	6	17,989
東邦亜鉛	1	1	4,438
三菱マテリアル	12	16	50,204
住友金属鉱山	25	33	107,907
DOWAホールディングス	5	5	20,064
古河機械金属	3	4	5,990
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	5,202
東邦チタニウム	3	4	4,338
U A C J	3	3	8,210
C K サンエツ	—	0.600	2,094
古河電気工業	6	7	25,098
住友電気工業	73	92	142,692
フジクラ	23	29	14,642
昭和電線ホールディングス	2	2	2,070
東京特殊電線	0.300	—	—
タツタ電線	3	4	2,562
カナレ電気	0.600	0.800	1,469
平河ヒューテック	1	1	2,163

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リョービ	2	3	8,259
アーレスティ	2	3	2,103
アサヒホールディングス	3	4	9,982
金属製品(0.6%)			
稲葉製作所	1	1	1,800
宮地エンジニアリンググループ	0.600	0.700	1,472
トーカロ	1	6	6,035
アルファ	0.700	1	1,654
SUMCO	18	27	42,432
川田テクノロジーズ	0.400	0.500	3,420
RS Technologies	0.300	0.600	1,917
東洋製罐グループホールディングス	13	15	36,062
ホッカシホールディングス	5	1	2,114
コロナ	1	1	1,460
横河ブリッジホールディングス	3	4	9,011
高田機工	0.300	-	-
三和ホールディングス	18	25	33,045
文化シャッター	5	7	6,110
三協立山	2	3	4,970
アルインコ	1	2	1,992
LIXILグループ	28	36	58,188
日本フィルコン	2	2	1,609
ノーリツ	4	5	9,036
長府製作所	2	2	5,527
リンナイ	3	4	32,428
ダイニチ工業	1	2	1,462
日東精工	2	3	1,880
三洋工業	0.500	-	-
岡部	4	5	4,860
ジーテクト	2	2	4,625
東プレ	3	4	11,316
高周波熱錬	3	4	4,150
東京製網	1	1	1,555
サンコール	1	1	1,188
モリテックスチール	1	3	1,598
パイオラックス	2	3	9,258
エイチワン	1	2	2,697
日本発条	19	24	25,774
アドバネクス	-	1	1,762
立川ブラインド工業	1	1	1,803
三益半導体工業	1	2	3,264

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械(4.9%)			
日本ドライケミカル	0.600	-	-
日本製鋼所	6	7	15,585
三浦工業	8	10	27,274
タクマ	6	9	13,203
ツガミ	5	5	4,202
オークマ	2	3	18,693
東芝機械	11	2	6,482
アマダホールディングス	30	38	43,776
アイダエンジニアリング	5	6	5,596
滝澤鉄工所	0.600	1	1,723
FUJII	5	7	11,677
牧野フライス製作所	10	2	13,267
オーエスジー	9	12	27,152
ダイジェット工業	0.700	-	-
旭ダイヤモンド工業	5	6	5,265
DMG森精機	10	15	23,618
ソディック	4	5	4,509
ディスコ	2	3	53,889
日東工器	1	1	3,082
日進工具	0.500	0.700	1,750
パンチ工業	1	2	1,725
豊和工業	1	1	1,698
OKK	1	1	1,549
石川製作所	0.500	1	1,437
東洋機械金属	1	2	1,522
津田駒工業	5	-	-
島精機製作所	2	3	13,107
オプトラン	1	2	5,500
NCホールディングス	1	1	833
フリュー	1	2	2,078
ヤマシンフィルタ	2	4	3,057
日阪製作所	2	3	2,697
やまびこ	3	4	5,011
平田機工	0.500	1	8,172
ペガサスミシン製造	1	2	1,603
ナブテスコ	10	13	40,567
三井海洋開発	2	2	7,917
レオン自動機	1	2	3,828
SMC	6	7	287,693
新川	1	3	2,075

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホソカワミクロン	0.700	0.900	4,347
ユニオンツール	0.900	1	3,327
オイレス工業	2	3	6,602
日精エー・エス・ビー機械	0.700	0.700	2,831
サトーホールディングス	2	3	8,130
技研製作所	1	1	5,797
日本エアージェット	1	2	1,490
カワタ	-	1	1,393
日精樹脂工業	1	2	1,957
オカダアイヨン	0.800	1	1,481
小松製作所	95	112	308,009
住友重機械工業	11	14	54,812
日立建機	9	10	28,930
日工	0.500	0.700	1,502
巴工業	0.800	1	2,624
井関農機	2	2	4,140
TOWA	1	-	-
丸山製作所	0.800	1	1,430
北川鉄工所	0.900	1	2,698
ローツェ	1	1	1,897
タカキタ	1	2	1,421
クボタ	106	133	205,035
荏原実業	0.700	0.700	1,557
三菱化工機	0.700	1	1,554
月島機械	3	4	6,869
帝国電機製作所	1	1	2,048
新東工業	4	5	5,970
澁谷工業	1	2	7,359
アイチコーポレーション	3	4	3,065
小森コーポレーション	5	6	8,080
鶴見製作所	1	1	3,414
酒井重工業	0.400	-	-
荏原製作所	8	11	35,035
石井鐵工所	0.700	0.800	1,457
西島製作所	2	2	2,365
北越工業	2	2	3,047
ダイキン工業	27	34	419,900
オルガノ	0.700	0.900	2,839
トーヨーカネツ	0.800	0.900	2,101
栗田工業	10	13	40,054
椿本チエイン	12	3	13,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
木村化工機	2	4	1,553
アネスト岩田	3	3	3,872
ダイフク	10	13	77,268
サムコ	1	1	1,438
加藤製作所	0.900	1	3,547
油研工業	0.500	0.800	1,517
タダノ	9	12	14,220
フジテック	6	9	10,989
C K D	5	6	7,383
キトー	1	1	3,448
平和	6	6	15,207
理想科学工業	2	2	4,285
SANKYO	5	6	25,141
日本金銭機械	1	2	3,040
マースグループホールディングス	1	1	3,515
福島工業	1	1	5,880
ダイコク電機	0.900	1	1,645
竹内製作所	3	4	8,517
アマノ	6	7	16,890
JUKI	2	3	4,658
サンデンホールディングス	2	3	2,538
蛇の目ミシン工業	1	3	1,455
マックス	3	3	5,749
グローリー	5	6	18,216
新晃工業	2	2	3,565
大和冷機工業	3	3	4,554
セガサミーホールディングス	19	24	31,838
日本ピストンリング	0.700	0.900	1,521
リケン	0.900	1	6,252
T P R	2	3	8,180
ツバキ・ナカシマ	2	3	7,619
ホシザキ	6	7	54,093
大豊工業	1	2	2,128
日本精工	40	51	53,910
NTN	45	53	18,992
ジェイテクト	21	23	34,392
不二越	18	2	10,327
日本トムソン	6	7	4,173
THK	12	15	43,849
ユースン精機	0.900	1	1,981
前澤給装工業	0.800	1	1,856

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イーグル工業	2	3	4,030
日本ピラー工業	2	2	3,507
キッツ	8	10	8,605
マキタ	25	30	123,018
日立造船	15	19	6,954
三菱重工業	33	41	181,395
IHI	15	19	62,361
スター精密	3	4	7,219
電気機器(13.0%)			
日清紡ホールディングス	12	13	13,248
イビデン	12	15	23,970
コニカミノルタ	46	54	59,132
ブラザー工業	24	32	68,396
ミネベアミツミ	36	46	82,882
日立製作所	476	112	390,332
三菱電機	198	248	357,544
富士電機	60	16	56,538
東洋電機製造	0.800	1	1,488
安川電機	23	28	92,480
シンフォニア テクノロジー	13	3	4,858
明電舎	17	4	7,918
オリジン電気	0.800	-	-
山洋電気	1	1	4,872
デンヨー	1	2	3,295
東芝テック	14	3	9,225
芝浦メカトロニクス	3	0.400	1,412
マブチモーター	5	6	26,565
日本電産	23	30	402,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.700	1	2,369
トレックス・セミコンダクター	-	1	1,376
東光高岳	1	1	1,842
ダブル・スコープ	2	3	4,820
ダイヘン	11	2	7,565
ヤーマン	2	3	4,813
JVCケンウッド	14	19	5,168
ミマキエンジニアリング	1	2	1,694
第一精工	0.900	1	1,270
日新電機	4	5	5,875
大崎電気工業	4	5	3,515
オムロン	21	26	131,175
日東工業	3	4	8,932

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
I D E C	2	3	6,930
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36	9	20,673
サクサホールディングス	-	0.800	1,492
メルコホールディングス	1	1	3,990
日本電気	25	32	120,911
富士通	204	24	180,432
沖電気工業	8	10	14,115
岩崎通信機	1	-	-
電気興業	1	1	3,458
サンケン電気	12	2	6,609
アイホン	1	1	2,461
ルネサスエレクトロニクス	10	25	17,802
セイコーエプソン	29	30	51,912
ワコム	15	18	8,561
アルバック	4	5	16,200
E I Z O	1	2	10,810
ジャパンディスプレイ	40	58	4,240
日本信号	5	6	6,180
京三製作所	5	5	2,120
能美防災	2	3	6,586
ホーチキ	1	1	1,846
星和電機	-	3	1,698
エレコム	1	2	7,693
パナソニック	226	284	296,771
シャープ	13	24	33,641
アンリツ	14	16	34,320
富士通ゼネラル	6	7	11,384
ソニー	132	167	880,758
T D K	10	13	114,140
帝国通信工業	1	1	1,441
タムラ製作所	7	9	5,702
アルプスアルパイン	17	25	59,777
池上通信機	9	1	1,414
パイオニア	33	41	2,739
日本電波工業	2	3	1,446
鈴木	1	2	1,615
日本トリム	0.400	0.500	2,785
ローランド ディー. ジー.	1	1	2,906
フォスター電機	2	2	4,564
クラリオン	10	2	5,500
SMK	6	0.700	1,841

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヨコオ	1	1	2,970
ホシデン	5	7	6,774
ヒロセ電機	3	3	42,012
日本航空電子工業	5	5	8,561
TOA	2	2	2,808
マクセルホールディングス	3	5	9,012
古野電気	2	3	3,132
ユニデンホールディングス	5	0.700	1,611
アルパイン	4	-	-
スミダコーポレーション	2	2	3,181
アイコム	1	1	3,144
リオン	0.800	1	2,125
本多通信工業	1	-	-
船井電機	2	2	1,915
横河電機	19	24	53,236
新電元工業	0.700	0.900	4,014
アズビル	5	16	38,784
東亜ディーケーケー	1	2	1,694
日本光電工業	8	11	37,565
チノー	0.800	-	-
共和電業	3	4	1,496
日本電子材料	2	2	1,424
堀場製作所	3	4	28,616
アドバンテスト	11	17	45,968
小野測器	1	2	1,414
エスパック	1	2	4,543
キーエンス	9	12	763,354
日置電機	1	1	5,798
シスメックス	15	19	129,572
日本マイクロニクス	3	4	3,272
メガチップス	1	2	4,528
OBARA GROUP	1	1	5,880
澤藤電機	0.700	0.500	798
コーセル	2	3	3,750
イリソ電子工業	1	2	11,109
新日本無線	1	-	-
オプテックスグループ	1	4	9,402
千代田インテグレ	1	1	2,144
アイ・オー・データ機器	1	1	1,575
レーザーテック	4	5	21,114
スタンレー電気	15	17	56,672

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
岩崎電気	0.900	-	-
ウシオ電機	12	15	19,811
岡谷電機産業	-	4	1,548
ハリオス テクノ ホールディング	1	2	1,626
日本セラミック	2	2	6,962
遠藤照明	1	2	1,495
古河電池	1	2	1,522
双信電機	-	4	1,816
山一電機	1	1	2,176
図研	1	1	2,558
日本電子	7	4	9,290
カシオ計算機	15	22	33,286
ファナック	18	23	460,017
日本シイエムケイ	3	6	4,246
エンプラス	0.900	1	3,355
大真空	1	-	-
ローム	8	12	90,720
浜松ホトニクス	14	17	71,331
三井ハイテック	2	2	2,737
新光電気工業	7	8	7,014
京セラ	32	37	236,496
太陽誘電	8	11	26,262
村田製作所	20	26	456,097
ユーシン	3	3	3,833
双葉電子工業	3	4	7,199
北陸電気工業	0.800	1	1,590
ニチコン	6	7	7,807
日本ケミコン	1	1	3,871
KOA	2	3	6,023
市光工業	3	3	2,534
小糸製作所	11	14	102,214
ミツバ	3	4	3,270
SCREENホールディングス	3	4	20,016
キャノン電子	1	2	4,236
キャノン	106	134	432,016
リコー	59	74	84,673
象印マホービン	-	4	5,612
MUTOHホールディングス	0.600	0.800	1,498
東京エレクトロン	13	16	260,039
輸送用機器(8.1%)			
トヨタ紡織	5	8	16,025

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
芦森工業	0.600	1	1,713
ユニプレス	3	4	9,566
豊田自動織機	16	20	112,962
モリタホールディングス	3	4	8,223
三櫻工業	2	3	1,782
デンソー	44	54	264,848
東海理化電機製作所	5	6	13,332
三井E&Sホールディングス	7	9	11,412
川崎重工業	15	19	55,348
名村造船所	5	7	3,240
日本車輛製造	7	0.900	2,370
三菱ロジスネクスト	2	3	4,116
近畿車輛	0.500	0.700	1,466
日産自動車	233	293	278,332
いすゞ自動車	57	78	127,415
トヨタ自動車	240	277	1,883,546
日野自動車	28	31	32,188
三菱自動車工業	73	92	58,115
エフテック	1	1	1,708
レシップホールディングス	0.900	-	-
武蔵精密工業	2	6	9,444
日産車体	7	4	4,924
新明和工業	8	11	14,772
極東開発工業	3	5	7,490
日信工業	4	4	7,208
トピー工業	1	2	4,746
ティラド	0.700	0.900	2,081
曙ブレーキ工業	9	13	2,356
タチエス	3	4	7,056
NOK	10	13	24,213
フタバ産業	6	6	4,222
KYB	2	2	7,943
大同メタル工業	2	4	3,204
プレス工業	10	12	7,822
ミクニ	2	3	1,584
太平洋工業	4	5	8,788
ケーヒン	4	5	11,058
河西工業	2	3	2,706
アイシン精機	16	20	89,585
マツダ	62	78	100,749
今仙電機製作所	1	2	2,496

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
本田技研工業	178	210	636,930
スズキ	39	45	262,899
S U B A R U	61	77	218,217
安永	1	1	1,885
ヤマハ発動機	28	35	79,059
ショーワ	5	5	9,363
T B K	2	3	1,537
エクセディ	2	3	9,193
豊田合成	7	8	19,928
愛三工業	3	3	2,928
盟和産業	1	1	1,471
日本プラスト	-	2	1,654
ヨロズ	2	2	3,769
エフ・シー・シー	3	4	11,871
シマノ	8	10	171,500
テイ・エス テック	4	5	18,763
ジャムコ	1	1	3,122
精密機器(2.0%)			
テルモ	30	35	236,368
クリエートメディック	1	1	1,495
日機装	6	7	8,427
島津製作所	23	32	89,216
JMS	0.100	-	-
長野計器	1	2	1,578
ブイ・テクノロジー	0.500	0.600	8,838
東京計器	1	1	1,785
インターアクション	-	1	2,131
オーバル	4	6	1,575
東京精密	3	4	13,590
マニー	2	3	15,360
ニコン	34	43	76,080
トプコン	10	13	20,743
オリンパス	29	37	177,709
理研計器	1	2	4,941
タムロン	1	2	4,329
HOYA	40	50	339,177
シード	0.300	1	1,466
ノーリツ鋼機	2	2	4,340
エー・アンド・デイ	2	2	1,697
朝日インテック	-	10	58,194
シチズン時計	23	27	17,244

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リズム時計工業	0.800	0.800	1,325
大研医器	1	2	1,470
メニコン	2	3	9,788
シンシア	－	3	1,437
松風	1	1	1,815
セイコーホールディングス	3	3	9,811
ニプロ	13	17	25,707
その他製品(2.0%)			
スノーピーク	1	1	1,807
パラマウントベッドホールディングス	2	2	14,529
トランザクシオン	－	2	1,514
S H O - B I	3	4	1,528
ニホンフラッシュ	0.900	1	2,266
前田工織	2	2	7,427
永大産業	3	3	1,489
アートネイチャー	2	2	1,706
パンダイナムコホールディングス	20	25	123,360
共立印刷	－	7	1,627
S H O E I	0.900	1	4,848
フランスベッドホールディングス	2	3	3,031
パイロットコーポレーション	3	4	23,100
萩原工業	1	1	2,311
トッパン・フォームズ	4	5	5,008
フジシールインターナショナル	4	5	23,324
タカラトミー	8	10	11,752
廣済堂	2	2	1,626
アーク	11	16	1,588
タカノ	1	－	－
プロネクサス	1	2	2,538
ホクシン	7	10	1,417
ウッドワン	1	－	－
大建工業	1	1	3,646
凸版印刷	56	35	61,284
大日本印刷	25	35	89,961
図書印刷	1	2	2,159
共同印刷	0.600	0.800	1,988
N I S S H A	4	5	7,007
宝印刷	1	1	1,988
アシックス	19	24	36,728
ツツミ	0.700	0.800	1,592
小松ウオール工業	0.700	0.800	1,549

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマハ	13	14	80,956
河合楽器製作所	0.700	0.800	2,684
クリナップ	1	2	1,524
ピジョン	12	15	70,200
キングジム	1	2	1,732
リンテック	4	5	14,850
イトーキ	4	4	2,654
任天堂	12	15	454,027
三菱鉛筆	3	4	9,393
タカラスタンダード	4	5	8,787
コクヨ	9	11	20,158
ナカバヤシ	－	2	1,474
グローブライド	0.900	1	3,406
オカムラ	6	8	11,397
美津濃	2	2	6,515
電気・ガス業(2.0%)			
東京電力ホールディングス	158	198	133,129
中部電力	60	76	135,216
関西電力	80	101	168,554
中国電力	27	34	50,602
北陸電力	19	24	22,643
東北電力	46	58	86,750
四国電力	17	22	32,300
九州電力	43	51	68,588
北海道電力	19	23	19,036
沖縄電力	3	4	9,494
電源開発	15	19	55,974
エフオン	1	1	1,342
イーレックス	3	4	3,685
レノバ	－	3	3,225
東京瓦斯	42	48	149,328
大阪瓦斯	38	48	109,061
東邦瓦斯	9	12	60,946
北海道瓦斯	5	1	1,896
広島ガス	4	5	1,759
西部瓦斯	2	2	7,005
静岡ガス	5	7	6,968
メタウォーター	1	1	3,726
陸運業(4.8%)			
S B S ホールディングス	2	2	4,867
東武鉄道	21	26	82,319

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
相鉄ホールディングス	6	8	28,347
東京急行電鉄	53	67	127,493
京浜急行電鉄	27	34	63,426
小田急電鉄	29	39	101,346
京王電鉄	11	13	89,238
京成電鉄	13	18	70,592
富士急行	2	3	13,498
新京成電鉄	0.300	0.200	415
東日本旅客鉄道	35	44	470,466
西日本旅客鉄道	17	22	184,019
東海旅客鉄道	17	22	553,820
西武ホールディングス	25	31	63,907
鴻池運輸	2	4	7,056
西日本鉄道	5	6	18,830
ハマキョウレックス	1	1	8,075
サカイ引越センター	1	1	8,567
近鉄グループホールディングス	18	23	117,056
阪急阪神ホールディングス	25	31	129,525
南海電気鉄道	8	10	31,458
京阪ホールディングス	8	10	48,037
神戸電鉄	0.400	0.600	2,379
名古屋鉄道	14	18	57,267
山陽電気鉄道	1	1	3,940
日本通運	7	9	65,472
ヤマトホールディングス	32	41	123,383
山九	4	6	36,234
丸運	4	-	-
丸全昭和運輸	7	1	5,415
センコーグループホールディングス	11	13	12,181
トナミホールディングス	0.500	0.600	3,894
ニッコンホールディングス	7	9	25,857
日本石油輸送	-	0.500	1,486
福山通運	2	3	13,500
セイノーホールディングス	14	17	27,647
神奈川中央交通	0.500	0.600	2,247
日立物流	4	5	16,978
丸和運輸機関	1	1	4,260
C&Fロジホールディングス	2	2	3,108
九州旅客鉄道	15	19	73,260
S Gホールディングス	13	22	71,025

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
海運業(0.2%)			
日本郵船	15	19	35,521
商船三井	11	14	37,086
川崎汽船	8	7	11,753
N S ユナイテッド海運	0.900	1	3,428
飯野海運	9	11	4,446
乾汽船	1	2	1,588
空運業(0.6%)			
日本航空	34	43	175,824
ANAホールディングス	36	43	178,821
パスコ	2	0.300	276
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.500	0.700	4,767
日新	1	2	3,914
三菱倉庫	6	8	22,664
三井倉庫ホールディングス	11	2	5,759
住友倉庫	13	8	12,869
澁澤倉庫	1	1	2,152
東陽倉庫	4	5	1,690
日本トランスシティ	5	5	2,303
ケイヒン	0.800	1	1,675
中央倉庫	1	1	1,582
安田倉庫	1	1	1,717
東洋埠頭	0.800	1	1,491
宇徳	3	2	1,531
上組	11	14	36,554
キムラユニティー	1	-	-
キューソー流通システム	0.500	0.600	1,234
近鉄エクスプレス	3	4	8,275
エーアイティー	1	1	1,611
日本コンセプト	0.300	1	1,573
情報・通信業(8.3%)			
NEC ネットエスアイ	2	2	6,860
システナ	1	8	9,996
デジタルアーツ	1	1	10,816
新日鉄住金ソリューションズ	3	3	11,070
コア	1	1	1,749
ソフトクリエイトホールディングス	0.900	1	1,702
T I S	6	8	42,606
電算システム	0.700	0.900	2,263

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
グリーン	10	16	7,812	
コーエーテクモホールディングス	3	5	9,265	
三菱総合研究所	0.800	1	3,315	
ボルテージ	1	2	1,502	
電算	0.600	0.700	1,553	
AGS	-	2	1,548	
ファインデックス	2	2	1,929	
ヒト・コミュニケーションズ	0.700	1	1,626	
ブレインパッド	-	0.500	2,575	
KLab	3	4	3,555	
ポルトウイン・ピットクルホールディングス	1	3	2,819	
ネクソン	21	62	101,883	
アイスタイル	4	6	4,247	
エムアップ	1	0.800	1,714	
エイチーム	1	1	2,839	
テクノスジャパン	1	2	1,562	
コロプラ	6	7	4,942	
モバイルクリエイト	3	-	-	
ブロードリーフ	4	12	6,945	
デジタルハーツホールディングス	1	1	1,452	
メディアドゥホールディングス	0.700	0.800	1,912	
じげん	-	2	1,726	
サイバーリンクス	1	1	1,516	
フィックスターズ	0.400	2	2,967	
CARTA HOLDINGS	1	1	1,472	
オプティム	0.600	0.500	1,970	
セレス	-	0.900	1,696	
ティーガイア	1	2	4,852	
セック	-	0.400	1,488	
豆蔵ホールディングス	1	1	1,785	
テクマトリックス	1	1	3,077	
プロシップ	-	1	1,492	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52	58	17,846	
GMOペイメントゲートウェイ	1	4	25,440	
ザッパラス	3	4	1,584	
インターネットイニシアティブ	3	4	10,116	
さくらインターネット	2	3	1,624	
GMOクラウド	0.600	0.500	1,715	
SRAホールディングス	1	1	3,460	
MINORISソリューションズ	-	0.900	1,473	
朝日ネット	2	2	1,496	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アドソル日進	-	1	1,756	
フリービット	1	1	1,756	
コムチュア	1	1	4,319	
サイバーコム	1	-	-	
メディカル・データ・ビジョン	0.700	2	2,503	
gumi	2	3	1,822	
モバイルファクトリー	1	0.600	868	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	-	1	1,654	
PCIホールディングス	0.400	0.600	1,371	
パイプドHD	1	1	1,345	
ランドコンピュータ	-	1	1,711	
オープンドア	0.800	1	3,780	
マイネット	-	0.800	896	
アカツキ	0.400	0.900	5,121	
LINE	5	7	29,933	
シンクロ・フード	0.300	2	1,792	
オークネット	-	1	1,598	
AOI TYO HOLDINGS	1	2	2,108	
マクロミル	1	4	5,955	
ビーグリー	-	1	1,659	
野村総合研究所	13	15	68,665	
サイバネットシステム	1	2	1,552	
CEホールディングス	1	2	1,537	
日本システム技術	-	1	1,383	
インテージホールディングス	2	3	2,641	
東邦システムサイエンス	1	1	1,457	
ソースネクスト	2	9	5,025	
インフォコム	-	1	4,005	
FIG	-	4	1,543	
アルテリア・ネットワークス	-	2	2,558	
フォーカスシステムズ	1	1	1,662	
クレスコ	0.400	0.700	2,401	
フジ・メディア・ホールディングス	20	25	41,517	
オービック	6	8	87,805	
ジャストシステム	3	3	9,411	
TDCソフト	1	2	1,988	
ヤフー	140	159	49,223	
トレンドマイクロ	9	13	68,510	
インフォメーション・ディベロップメント	-	1	1,524	
日本オラクル	3	4	40,670	
アルファシステムズ	0.600	0.800	2,145	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フューチャー	2	3	5,817
CAC Holdings	1	1	2,040
ソフトバンク・テクノロジー	0.800	1	2,108
トーセ	0.700	1	1,461
オービックビジネスコンサルタント	1	2	10,962
伊藤忠テクノソリューションズ	4	11	29,115
アイティフォー	2	3	2,520
東計電算	0.400	-	-
エックスネット	1	1	1,438
大塚商会	5	13	53,658
サイボウズ	2	2	1,879
電通国際情報サービス	1	1	5,587
デジタルガレージ	3	4	13,963
イーエムシステムズ	0.700	2	2,524
ウェザーニューズ	0.700	0.800	2,504
C I J	2	1	1,540
東洋ビジネスエンジニアリング	0.800	0.800	1,580
日本エンタープライズ	6	8	1,459
WOWOW	0.900	1	3,624
スカラ	1	2	1,776
IMAGICA GROUP	1	2	1,416
ネットワンシステムズ	7	8	21,878
システムソフト	-	14	1,440
アルゴグラフィックス	0.900	1	4,975
マーベラス	3	3	3,355
エイベックス	3	4	5,959
日本ユニシス	5	7	21,796
兼松エレクトロニクス	1	1	4,283
東京放送ホールディングス	11	16	31,282
日本テレビホールディングス	17	22	40,252
朝日放送グループホールディングス	1	2	1,855
テレビ朝日ホールディングス	5	6	13,386
スカパーJ SATホールディングス	14	18	9,262
テレビ東京ホールディングス	1	2	4,988
日本BS放送	1	1	1,492
ビジョン	0.500	0.800	3,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,411
ワイヤレスゲート	1	3	1,287
コネクシオ	1	1	2,453
日本通信	17	21	2,743
日本電信電話	139	167	785,035

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
KDDI	175	215	585,293
ソフトバンク	-	194	262,170
光通信	2	2	58,841
NTTドコモ	143	175	457,355
エムティーアイ	2	2	1,764
GMOインターネット	7	8	16,242
カドカワ	5	7	7,952
学研ホールディングス	0.700	0.800	4,296
ゼンリン	2	4	15,312
昭文社	1	3	1,519
インプレスホールディングス	6	10	1,560
アイネット	1	1	1,978
松竹	1	1	18,288
東宝	12	16	65,124
東映	0.700	1	13,500
エヌ・ティ・ティ・データ	60	65	79,105
ビジネスブレイン太田昭和	0.800	0.800	1,724
D T S	2	2	11,043
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9	11	36,138
シーイーシー	1	2	6,013
カプコン	4	10	23,509
アイ・エス・ビー	1	0.800	1,765
ジャステック	1	1	1,566
S C S K	4	6	31,104
日本システムウエア	0.600	0.900	1,780
アイネス	2	3	4,057
T K C	1	2	7,948
富士ソフト	2	3	16,254
N S D	3	4	9,924
コナミホールディングス	7	10	44,550
福井コンピュータホールディングス	0.600	0.900	1,741
J B C Cホールディングス	1	1	3,110
ミロク情報サービス	1	2	6,763
ソフトバンクグループ	88	102	1,061,840
卸売業(5.1%)			
高千穂交易	1	1	1,518
伊藤忠食品	0.500	0.600	2,928
エレマテック	0.900	1	2,049
J A L U X	0.600	0.700	1,764
あらた	1	1	6,209
トーマンデバイス	0.500	0.600	1,474

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京エレクトロニクス デバイス	0.700	0.900	1,667
フィールズ	1	2	1,516
双日	115	135	57,545
アルフレッサ ホールディングス	21	27	87,448
横浜冷凍	4	6	5,939
ラサ商事	1	1	1,560
アルコニックス	2	2	3,304
神戸物産	1	3	13,542
あい ホールディングス	3	3	6,849
ディーブイエックス	1	1	1,515
ダイワボウホールディングス	1	2	14,102
マクニカ・富士エレホールディングス	3	6	10,873
ラクト・ジャパン	-	0.500	4,245
バイタルケーエスケーホールディングス	3	4	5,023
八洲電機	1	1	1,577
UKCホールディングス	1	1	3,286
ジュテックホールディングス	1	0.900	931
大光	1	2	1,655
OCHIホールディングス	1	1	1,613
TOKAIホールディングス	10	13	12,025
Cominix	-	1	1,519
三洋貿易	1	1	2,506
ビューティガレージ	0.600	0.900	1,349
ウイン・パートナーズ	1	1	1,838
シップヘルスケアホールディングス	4	5	22,006
明治電機工業	-	0.900	1,639
コメダホールディングス	3	5	12,180
富士興産	2	2	1,538
協栄産業	0.700	1	1,599
小野建	1	2	3,528
佐鳥電機	1	1	1,794
エコートレーディング	1	2	1,497
伯東	1	1	2,097
コンドーテック	1	1	1,976
ナガイレーベン	2	3	8,232
三菱食品	2	2	7,797
松田産業	1	1	2,647
第一興商	2	3	19,944
メディバルホールディングス	19	26	70,225
SPK	-	0.600	1,386
萩原電気ホールディングス	0.700	0.900	2,749

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アズワン	1	1	14,994
尾家産業	1	-	-
シモジマ	1	1	1,704
ドウシシャ	2	2	3,972
小津産業	0.600	0.800	1,496
高速	1	1	1,776
丸文	1	2	1,564
ハピネット	1	2	2,944
橋本総業ホールディングス	0.800	-	-
日本ライフライン	5	7	13,544
エクセル	0.800	0.900	2,097
マルカキカイ	0.700	0.800	1,702
I DOM	5	8	3,012
日本エム・ディ・エム	1	1	1,611
進和	1	1	3,082
ダイトロン	0.900	1	1,867
シークス	1	3	5,421
田中商事	1	2	1,647
オーハシテクニカ	1	1	2,010
白銅	0.700	0.900	1,512
伊藤忠商事	143	171	348,230
丸紅	160	241	198,566
長瀬産業	11	13	22,921
蝶理	1	1	2,536
豊田通商	21	27	99,051
三共生興	3	4	1,843
兼松	8	9	12,838
三井物産	165	202	364,206
日本紙パルプ商事	1	1	5,915
日立ハイテクノロジーズ	6	7	32,250
カメイ	2	3	3,977
東都水産	0.700	-	-
OUGホールディングス	0.500	0.600	1,503
スターゼン	0.800	0.900	3,618
山善	7	9	11,491
椿本興業	0.400	0.600	2,169
住友商事	123	145	239,975
内田洋行	0.900	1	2,588
三菱商事	136	172	560,013
第一実業	0.900	1	3,839
キャノンマーケティングジャパン	5	7	14,784

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西華産業	1	1	2,151
佐藤商事	1	2	2,116
菱洋エレクトロ	1	2	3,877
東京産業	2	2	1,474
ユアサ商事	1	2	8,537
神鋼商事	0.400	0.600	1,510
小林産業	4	5	1,571
阪和興業	3	4	14,211
正栄食品工業	1	1	3,984
カナデン	1	2	2,987
菱電商事	1	1	2,813
フルサト工業	1	1	2,338
岩谷産業	4	5	19,737
すてきなイスグループ	1	1	1,514
昭光通商	12	2	1,435
極東貿易	3	-	-
イワキ	3	3	1,508
三菱石油	5	6	6,514
稲畑産業	4	5	9,316
明和産業	2	-	-
ワキタ	4	5	6,323
東邦ホールディングス	5	7	19,826
サンゲツ	6	7	15,466
ミツウロコグループホールディングス	2	3	2,944
シナネンホールディングス	0.900	1	2,216
伊藤忠エネクス	4	5	5,119
サンリオ	5	7	17,822
サンワ テクノス	1	1	1,465
リョーサン	2	2	8,397
新光商事	2	2	4,370
トーホー	0.900	1	2,305
三信電気	1	2	3,750
東陽テクニカ	2	2	2,497
モスフードサービス	2	3	8,828
加賀電子	1	2	5,112
ソーダニッカ	2	2	1,624
立花エレテック	1	1	3,038
PALTAC	2	4	25,080
三谷産業	3	5	1,489
西本Wismettacホールディングス	0.400	0.600	2,646
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.900	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
国際紙パルプ商事	-	5	1,573
ヤマタネ	1	1	1,998
丸紅建材リース	6	0.800	1,628
日鉄住金物産	1	1	8,083
泉州電業	0.600	0.800	2,150
トラスコ中山	4	5	15,861
オートバックスセブン	7	9	17,983
モリト	1	2	1,576
加藤産業	3	3	13,965
イノテック	1	1	1,581
イエローハット	1	2	6,752
J Kホールディングス	2	2	1,625
日伝	1	2	3,114
北沢産業	5	5	1,482
杉本商事	1	1	2,307
因幡電機産業	2	3	15,820
バイテックホールディングス	0.900	1	2,237
東テック	0.600	0.800	1,824
ミスミグループ本社	22	30	84,609
タキヒヨー	0.600	0.800	1,452
蔵王産業	0.800	1	1,456
スズケン	8	11	67,312
ジェコス	1	1	1,815
ルネサスイーストン	1	3	1,564
小売業(4.9%)			
ローソン	4	6	42,098
サンエー	1	1	8,445
カワチ薬品	1	1	3,950
エービーシー・マート	3	3	24,282
ハードオフコーポレーション	1	1	1,465
アスクル	1	2	6,151
ゲオホールディングス	3	3	6,071
アダストリア	3	3	6,667
ジーフット	1	2	1,504
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1	-	-
くらコーポレーション	1	1	7,882
キャンドウ	0.900	1	1,893
パルグループホールディングス	1	1	4,017
エディオン	7	10	10,160
サーラコーポレーション	3	5	2,920
ハローズ	0.700	0.900	1,930

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
あみやき亭	0.400	0.500	1,842
ひらまつ	2	4	1,715
大黒天物産	0.500	0.600	2,460
ハニーズホールディングス	1	2	2,101
ファーマライズホールディングス	2	-	-
アルペン	1	1	3,127
クオールホールディングス	2	3	5,313
ジンズ	1	1	9,197
ビックカメラ	11	13	16,309
DCMホールディングス	10	13	14,731
ペッパーフードサービス	1	1	5,179
MonotaRO	6	15	38,533
DDホールディングス	0.400	0.700	1,504
きちりホールディングス	1	2	1,597
アークランドサービスホールディングス	1	1	3,673
J.フロント リテイリング	23	31	38,716
ドトール・日レスホールディングス	3	4	9,421
マツモトキヨシホールディングス	8	10	39,087
ブロンコピリー	1	1	3,510
ZOZO	19	26	45,871
物語コーポレーション	0.600	0.600	5,712
ココカラファイン	2	2	13,944
三越伊勢丹ホールディングス	36	45	50,535
Hamee	0.700	1	1,313
ウエルシアホールディングス	5	6	26,357
クリエイトSDホールディングス	2	3	10,418
ミサワ	-	3	1,465
ティーライフ	-	1	1,640
チムニー	0.600	0.700	1,859
シュッピン	1	2	1,619
ネクステージ	2	3	3,841
ジョイフル本田	2	7	10,447
鳥貴族	0.700	0.800	1,453
キリン堂ホールディングス	0.700	1	1,711
ホットランド	1	1	1,773
すかいらーくホールディングス	12	22	38,896
綿半ホールディングス	0.700	0.900	2,083
コイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6	7	8,335
ブックオフコーポレーション	1	-	-
あさひ	1	2	3,018
日本調剤	0.700	0.900	3,541

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモス薬品	1	1	23,199
セブン&アイ・ホールディングス	81	102	511,532
薬王堂	0.800	1	2,883
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5	6	8,494
ツルハホールディングス	4	5	52,258
サンマルクホールディングス	1	1	4,881
フェリシモ	1	1	1,475
トリドールホールディングス	2	3	6,774
TOKYO BASE	0.400	2	1,982
ジャパンミート	-	0.900	1,593
サツドラホールディングス	0.700	0.800	1,518
パロックジャパンリミテッド	1	2	1,830
クスリのアオキホールディングス	1	2	18,480
スシローグローバルホールディングス	1	2	19,440
LIXILビバ	1	2	3,066
メディカルシステムネットワーク	2	-	-
総合メディカル	0.800	-	-
ノジマ	3	4	8,958
カッパ・クリエイト	2	3	4,800
ライトオン	1	2	1,701
良品計画	2	3	93,450
三城ホールディングス	0.800	3	1,450
アドヴァン	2	3	3,737
アルビス	0.400	0.900	2,112
コナカ	2	3	1,445
ハウス オブ ローゼ	0.800	-	-
G-7ホールディングス	0.600	0.700	1,580
イオン北海道	2	2	1,967
コジマ	4	3	2,358
ヒマラヤ	1	1	1,590
コーナン商事	2	3	9,174
エコス	1	0.900	1,532
ワタミ	2	3	5,171
マルシェ	1	1	1,468
バ・バフィック・インターナショナルホールディングス	12	14	100,401
西松屋チェーン	4	5	4,919
ゼンショーホールディングス	10	11	29,092
幸楽苑ホールディングス	1	1	3,718
サイゼリヤ	2	4	8,244
V Tホールディングス	6	8	3,494
魚力	1	1	1,462

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニテッドアローズ	2	2	10,010
ハイデイ日高	2	3	7,427
京都きもの友禅	1	2	924
コロワイド	6	8	19,140
ピーシーデポコーポレーション	2	3	1,511
壺番屋	1	1	8,228
トップカルチャー	2	5	1,495
P L A N T	1	1	1,408
スギホールディングス	4	5	25,704
ヴィア・ホールディングス	-	3	1,998
スクロール	3	3	1,501
ヨンドシーホールディングス	2	2	5,826
エー・ファミリーマートホールディングス	6	6	88,113
木曽路	2	3	7,740
S R Sホールディングス	2	2	2,946
千趣会	3	-	-
タカキュー	6	-	-
ケーヨー	3	4	2,448
上新電機	2	2	6,730
日本瓦斯	3	4	16,140
ロイヤルホールディングス	3	4	11,567
東天紅	0.700	-	-
いなげや	2	2	3,653
島忠	4	5	16,749
チヨダ	2	2	4,916
ライフコーポレーション	1	1	4,647
リンガーハット	2	3	7,140
MrMaxHD	2	3	1,727
テンアライド	2	3	1,531
AOKIホールディングス	3	4	6,203
オークワ	3	3	3,944
コメリ	3	3	10,590
青山商事	3	4	11,932
しまむら	2	2	26,593
はせがわ	2	3	1,446
高島屋	31	19	28,627
松屋	3	4	5,331
エイチ・ツー・オー リテイリング	9	12	19,656
近鉄百貨店	0.700	0.900	3,105
パルコ	1	2	2,757
丸井グループ	18	20	41,772

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アクシアル リテイリング	1	2	7,000
イオン	75	94	225,377
イズミ	3	5	27,000
平和堂	4	5	12,605
フジ	2	3	5,604
ヤオコー	2	2	16,744
ゼビオホールディングス	2	3	3,903
ケーズホールディングス	8	25	25,551
Olympicグループ	2	2	1,687
Genky DrugStores	0.800	1	3,134
総合メディカルホールディングス	-	2	4,023
アインホールディングス	2	3	24,618
元気寿司	0.500	0.700	2,709
ヤマダ電機	65	74	39,815
アークランドサカモト	3	4	6,064
ニトリホールディングス	7	10	148,930
グルメ杵屋	1	1	2,004
愛眼	2	5	1,560
吉野家ホールディングス	6	8	15,944
松屋フーズホールディングス	0.900	1	4,422
サガミホールディングス	2	3	4,511
関西スーパーマーケット	1	1	1,911
王将フードサービス	1	1	13,284
プレナス	2	2	4,870
ミニストップ	1	1	3,450
アークス	3	4	11,799
パローホールディングス	4	5	14,506
藤久	0.800	2	1,490
ベルク	0.900	1	6,084
大 庄	1	1	2,031
ファーストリテイリング	3	3	166,122
サンドラッグ	8	9	32,108
サックスパー ホールディングス	1	2	2,343
やまや	-	0.700	1,680
ペルーナ	4	6	5,454
銀行業(6.4%)			
島根銀行	1	2	1,472
じもとホールディングス	13	16	2,041
めぶきフィナンシャルグループ	101	127	39,045
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2	3	5,385
九州フィナンシャルグループ	32	40	18,538

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ゆうちょ銀行	55	69	87,696	
富山第一銀行	5	5	2,289	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	118	156	71,474	
西日本フィナンシャルホールディングス	13	15	15,684	
関西みらいフィナンシャルグループ	-	11	9,523	
三十三フィナンシャルグループ	-	2	3,357	
第四北越フィナンシャルグループ	-	4	15,157	
新生銀行	16	18	27,486	
あおぞら銀行	11	13	44,643	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,380	1,709	1,003,711	
りそなホールディングス	214	269	137,259	
三井住友トラスト・ホールディングス	38	48	203,343	
三井住友フィナンシャルグループ	147	173	699,497	
第四銀行	2	-	-	
北越銀行	2	-	-	
千葉銀行	70	87	59,073	
群馬銀行	39	49	23,518	
武蔵野銀行	3	3	8,835	
千葉興業銀行	5	6	2,251	
筑波銀行	8	10	2,101	
七十七銀行	6	7	14,260	
青森銀行	1	2	5,722	
秋田銀行	1	1	3,486	
山形銀行	2	2	5,446	
岩手銀行	1	1	5,985	
東邦銀行	17	22	6,798	
東北銀行	1	-	-	
みちのく銀行	1	1	2,571	
ふくおかフィナンシャルグループ	79	19	49,212	
静岡銀行	52	61	54,754	
十六銀行	2	3	7,626	
スルガ銀行	20	25	13,554	
八十二銀行	35	44	21,045	
山梨中央銀行	12	3	4,263	
大垣共立銀行	3	3	8,868	
福井銀行	1	2	3,334	
北國銀行	2	2	9,274	
清水銀行	0.700	1	1,762	
富山銀行	0.400	0.500	1,577	
滋賀銀行	18	4	12,730	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
南都銀行	2	2	6,478	
百五銀行	18	22	8,574	
京都銀行	7	8	41,184	
紀陽銀行	7	8	13,563	
三重銀行	0.900	-	-	
ほくほくフィナンシャルグループ	13	16	20,260	
広島銀行	28	36	23,349	
山陰合同銀行	11	14	11,957	
中国銀行	13	15	16,669	
鳥取銀行	0.800	1	1,537	
伊予銀行	27	32	20,247	
百十四銀行	21	2	6,380	
四国銀行	3	3	3,605	
阿波銀行	16	4	12,260	
大分銀行	1	1	5,360	
宮崎銀行	1	1	4,584	
佐賀銀行	1	1	2,709	
十八銀行	12	1	4,388	
沖縄銀行	1	2	7,808	
琉球銀行	3	5	6,629	
セブン銀行	73	82	28,351	
みずほフィナンシャルグループ	2,655	3,336	587,856	
山口フィナンシャルグループ	19	30	32,374	
長野銀行	0.700	0.900	1,398	
名古屋銀行	1	2	6,940	
北洋銀行	29	37	11,322	
愛知銀行	0.700	0.900	3,087	
第三銀行	1	-	-	
中京銀行	0.900	1	2,159	
大光銀行	0.700	0.900	1,502	
愛媛銀行	2	3	3,699	
みなと銀行	1	-	-	
京葉銀行	17	10	7,635	
関西アーバン銀行	2	-	-	
栃木銀行	10	12	3,035	
北日本銀行	0.600	0.800	1,679	
東和銀行	3	4	3,040	
福島銀行	1	-	-	
トモニホールディングス	16	19	7,657	
フィデアホールディングス	19	23	3,141	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
池田泉州ホールディングス	20	26	7,803
証券、商品先物取引業(0.8%)			
F P G	6	7	8,131
S B Iホールディングス	22	29	67,595
ジャフコ	2	4	15,800
大和証券グループ本社	167	197	114,240
野村ホールディングス	336	432	191,289
岡三証券グループ	17	20	10,220
丸三証券	6	7	5,964
東洋証券	7	8	1,434
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21	29	14,620
光世証券	1	1	1,436
水戸証券	6	7	1,881
いちよし証券	4	5	4,544
松井証券	9	12	14,340
だいちこう証券ビジネス	2	0.200	86
マネックスグループ	20	22	9,984
カブドットコム証券	12	18	10,248
極東証券	2	3	3,940
岩井コスモホールディングス	2	2	3,165
藍澤証券	3	4	3,215
マネーパートナーズグループ	1	5	1,470
保険業(2.3%)			
かんぽ生命保険	7	9	23,045
S O M P Oホールディングス	38	43	182,812
アニコム ホールディングス	1	2	5,980
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	51	64	215,776
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	20	42,864
第一生命ホールディングス	110	138	236,824
東京海上ホールディングス	73	89	495,730
T & Dホールディングス	60	75	104,324
アドバンスクリエイト	0.700	0.500	865
その他金融業(1.2%)			
全国保証	5	7	28,420
日本モーゲージサービス	-	1	1,442
アルヒ	1	2	5,346
プレミアグループ	-	0.500	1,620
クレディセゾン	14	17	27,382
アクリーティブ	4	-	-
芙蓉総合リース	2	2	15,652
興銀リース	3	4	12,433

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京センチュリー	3	4	25,431
日本証券金融	8	10	6,739
アイフル	32	37	11,475
リコーリース	1	1	6,536
イオンフィナンシャルサービス	13	15	34,555
アコム	39	49	19,128
ジャックス	2	2	5,148
オリエントコーポレーション	42	66	7,768
日立キャピタル	5	5	14,743
アプラスフィナンシャル	13	18	1,565
オリックス	130	163	268,468
三菱UFJリース	49	55	31,910
日本取引所グループ	57	66	132,533
イー・ギャランティ	0.500	2	2,461
アサックス	-	2	1,463
NECキャピタルソリューション	0.800	1	1,649
不動産業(2.4%)			
いちご	27	31	11,949
日本駐車場開発	23	29	4,588
ヒューリック	40	51	52,480
三栄建築設計	0.800	1	1,648
スター・マイカ	0.700	1	1,519
野村不動産ホールディングス	13	16	33,838
三重交通グループホールディングス	4	5	3,055
サムティ	1	3	5,208
ディア・ライフ	-	3	1,445
日本商業開発	1	1	2,316
プレサンスコーポレーション	2	3	5,385
ユニゾホールディングス	2	3	7,884
T H E グローバル社	1	2	1,341
日本管理センター	1	1	1,319
サンセイランディック	1	1	1,357
エストラスト	-	1	1,502
フージャースホールディングス	4	5	3,619
オープンハウス	3	4	15,620
東急不動産ホールディングス	47	66	40,986
飯田グループホールディングス	16	20	41,389
イーブランド	-	2	1,493
ムゲンエステート	1	1	802
ハウスドゥ	0.500	1	2,188
シーアールイー	0.900	-	-

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ケイアイスター不動産	0.700	—	—
アグレ都市デザイン	—	2	1,516
テンポイノベーション	—	1	1,800
パーク24	10	14	38,095
パラカ	0.600	0.900	1,711
三井不動産	97	130	349,204
三菱地所	145	172	329,208
平和不動産	3	4	9,324
東京建物	21	26	34,330
ダイビル	5	7	7,905
京阪神ビルディング	3	4	4,039
住友不動産	47	55	234,710
大京	3	—	—
テーオーシー	6	5	4,401
東京楽天地	0.300	0.400	1,854
レオパレス21	23	30	6,211
スタートコーポレーション	2	3	7,986
フジ住宅	2	3	2,709
空港施設	2	2	1,580
明和地所	1	2	1,530
ゴールドクレスト	1	1	3,057
日本エスリード	0.800	1	1,611
日神不動産	2	3	1,688
日本エスコン	3	4	3,361
タカラレーベン	9	11	4,105
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,508
イオンモール	12	12	23,136
ファースト住建	0.800	1	1,605
カチタス	2	2	9,976
トーセイ	2	3	3,570
穴吹興産	—	0.500	1,425
エヌ・ティ・ティ都市開発	12	—	—
サンフロンティア不動産	2	3	4,168
エフ・ジェー・ネクスト	1	2	1,862
ランドビジネス	4	—	—
グランディハウス	2	3	1,543
日本空港ビルデング	5	7	33,813
サービス業(4.9%)			
日本工営	1	1	4,123
LIFULL	6	9	5,713
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	4,675

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本M&Aセンター	6	17	51,418
メンバーズ	1	—	—
タケエイ	2	2	2,037
トラスト・テック	0.800	1	4,706
コシダカホールディングス	1	6	10,368
パソナグループ	1	2	4,242
CDS	1	1	1,654
リンクアンドモチベーション	3	4	4,158
GCA	2	2	2,157
エス・エム・エス	3	8	16,938
パーソルホールディングス	17	23	46,267
リニカル	1	1	2,251
クックパッド	5	7	2,182
アイ・ケイ・ケイ	1	2	1,492
学情	0.900	1	1,582
スタジオアリス	1	1	2,839
シミックホールディングス	1	1	2,099
NJS	0.900	1	1,510
総合警備保障	7	9	45,980
カカココム	14	17	38,413
アイロムグループ	0.600	—	—
セントケア・ホールディング	1	2	1,590
ルネサンス	0.900	1	2,607
ディップ	2	3	7,622
オプトホールディング	1	1	2,553
新日本科学	2	3	2,384
ツクイ	4	5	4,149
ベネフィット・ワン	—	3	13,711
エムスリー	19	50	87,324
ツカダ・グローバルホールディング	2	2	1,488
アウトソーシング	5	12	16,850
ウエルネット	1	2	2,424
ワールドホールディングス	0.600	0.700	1,509
ディー・エヌ・エー	10	12	21,580
博報堂DYホールディングス	26	33	59,116
ぐるなび	3	3	2,488
エスアールジー・タカミヤ	2	2	1,720
ジャパンバスターシキュシステム	2	1	2,395
ファンコミュニケーションズ	5	6	3,458
ライク	0.700	1	1,297
ビジネス・ブレークスルー	3	4	1,642

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
WDBホールディングス	0.900	1	3,076
バリューコマース	1	1	3,416
インフォーマート	9	13	16,276
J Pホールディングス	5	6	1,931
E P Sホールディングス	2	3	6,480
プレステージ・インターナショナル	3	4	5,808
アミューズ	1	1	3,512
ドリームインキュベータ	0.600	0.900	1,354
クイック	1	1	2,370
T A C	4	6	1,459
ケネディクス	25	20	11,724
電通	23	29	142,245
テイクアンドギヴ・ニーズ	1	0.900	1,620
ぴあ	0.600	0.700	2,824
イオンファンタジー	0.600	0.800	2,259
シーティーエス	1	2	1,944
ネクシィーズグループ	0.800	0.800	1,383
みらかホールディングス	5	6	20,130
アルプス技研	1	2	4,162
日本空調サービス	2	2	1,790
オリエンタルランド	22	28	345,208
ダスキン	5	6	17,344
明光ネットワークジャパン	2	3	2,829
ファルコホールディングス	1	1	1,856
秀英予備校	2	3	1,485
ラウンドワン	5	7	10,434
リゾートトラスト	8	10	16,008
ビー・エム・エル	2	3	10,431
ワタベウエディング	2	-	-
りらいあコミュニケーションズ	3	4	4,201
リソー教育	3	12	5,916
早稲田アカデミー	0.800	-	-
ユー・エス・エス	23	29	58,665
サイバーエージェント	12	14	49,318
楽天	97	110	88,720
クリーク・アンド・リバー社	1	1	1,639
テー・オー・ダブリュー	1	2	1,680
セントラルスポーツ	0.700	0.900	3,141
フルキャストホールディングス	1	2	5,448
エン・ジャパン	-	2	10,192
リソルホールディングス	-	0.400	1,704

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テクノロ・ホールディングス	3	4	28,656
インターワークス	1	2	1,535
K e e P e r 技研	1	1	1,822
ファーストロジック	1	-	-
G u n o s y	0.900	1	4,212
イー・ガーディアン	1	1	2,328
リブセンス	2	5	1,484
ジャパンマテリアル	1	6	9,379
ベクトル	2	2	4,251
ウチヤマホールディングス	2	3	1,455
キャリアリンク	2	4	1,685
I B J	1	0.800	730
アサンテ	0.500	1	2,211
N・フィールド	1	1	1,473
M&Aキャピタルパートナーズ	0.400	0.600	3,366
ライドオンエクスプレスホールディングス	-	1	1,453
E R Iホールディングス	1	1	1,575
アビスト	0.300	0.500	1,660
シグマクシス	-	1	1,684
ウィルグループ	0.900	1	1,872
エスコロー・エージェント・ジャパン	2	5	1,517
日本ビューホテル	0.900	1	1,470
リクルートホールディングス	146	170	515,460
エラン	-	1	2,420
土木管理総合試験所	2	-	-
日本郵政	107	195	264,420
ベルシステム24ホールディングス	3	4	6,060
鎌倉新書	-	1	3,029
一蔵	1	2	1,565
エポラブルアジア	-	0.700	1,831
ストライク	-	0.700	1,477
ソラスト	1	5	6,449
セラク	-	2	1,342
インソース	-	0.800	1,895
バイカレント・コンサルティング	-	1	4,283
M S - J a p a n	-	1	1,944
グレイステクノロジー	-	0.800	1,922
ジャパエリベーターサービスホールディングス	-	1	2,837
フルテック	-	1	1,441
日総工産	-	0.700	1,857
キュービーネットホールディングス	-	1	2,278

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スプリックス	－	0.700	1,910
リログループ	10	13	38,649
東祥	1	1	5,250
エイチ・アイ・エス	3	4	18,039
ラックランド	0.700	0.700	1,343
共立メンテナンス	3	3	19,260
イチネンホールディングス	2	2	3,352
建設技術研究所	1	1	2,412
スペース	1	1	2,017
燦ホールディングス	0.500	0.600	1,518
東京テアトル	1	1	1,552
ナガワ	0.400	0.700	3,885
よみうりランド	0.400	0.500	2,135
東京都競馬	1	1	5,712
常磐興産	0.800	1	1,602
カナモト	2	3	10,479
東京ドーム	7	8	8,757
西尾レントオール	1	2	8,148
トランス・コスモス	2	2	5,678
乃村工芸社	4	5	18,284
藤田観光	0.800	0.900	2,406
KNT-CTホールディングス	1	1	1,690
日本管財	2	2	4,772
トーカイ	1	2	6,529
白洋舎	0.400	0.500	1,447
セコム	20	25	239,878
セントラル警備保障	0.900	1	4,796
丹青社	3	4	5,692

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メイテック	2	3	15,000
応用地質	2	2	3,021
船井総研ホールディングス	3	4	12,318
進学会ホールディングス	2	2	1,367
いであ	1	1	1,477
学究社	0.900	1	1,496
ベネッセホールディングス	6	8	26,926
イオンディライト	2	2	11,875
ナック	1	1	1,572
ニチイ学館	3	3	4,284
ダイセキ	3	4	10,608
ステップ	0.800	1	1,718
合計	株数・金額	23,939	28,825 57,384,775
	銘柄数<比率>	1,820	1,840 <98.4%>

(注1) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
国内 TOPIX	855	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2019年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	57,384,775	98.1
コール・ローン等、その他	1,115,528	1.9
投資信託財産総額	58,500,303	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	58,463,038,974円
コール・ローン等	958,221,458
株式(評価額)	57,384,775,610
未収入金	41,476,380
未収配当金	91,185,526
差入委託証拠金	△ 12,620,000
(B)負債	146,632,061
未払解約金	146,631,400
その他未払費用	661
(C)純資産総額(A-B)	58,316,406,913
元本	34,475,094,643
次期繰越損益金	23,841,312,270
(D)受益権総口数	34,475,094,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,916円

(注1) 期首元本額 28,140,482,546円
 期中追加設定元本額 15,227,365,012円
 期中一部解約元本額 8,892,752,915円

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

ニッセイTOPIXオープン	7,001,913,903円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,024,057,407円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,238,812円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,210,844円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,206,570,755円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	4,301,785,562円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,932,098,974円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	12,600,088円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	44,132,565円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	51,055,008円
DCニッセイ国内株式インデックス	158,434,319円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	13,107,204,121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)	473,776,130円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	26,130,458円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	13,740,453円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	16,118,045円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	25,983,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,039,005円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	21,997,831円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	24,360,716円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,998,804円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	705,242円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	1,334,030円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	11,608,114円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	286,261円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	274,456円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	258,945円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	180,148円

損益の状況

当期 (2018年2月21日~2019年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,169,874,563円
受取配当金	1,167,820,086
受取利息	15,860
その他収益	3,255,653
支払利息	△ 1,217,036
(B)有価証券売買損益	△ 4,584,656,585
売却益	2,231,455,208
売却損	△ 6,816,111,793
(C)先物取引等損益	△ 127,796,540
取引益	219,356,860
取引損	△ 347,153,400
(D)信託報酬等	△ 431,025
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△ 3,543,009,587
(F)前期繰越損益金	22,727,568,381
(G)追加信託差損益金	11,357,388,355
(H)解約差損益金	△ 6,700,634,879
(I)合計(E+F+G+H)	23,841,312,270
次期繰越損益金(I)	23,841,312,270

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 18 期

(計算期間：2018年2月21日～2019年2月20日)

運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りま



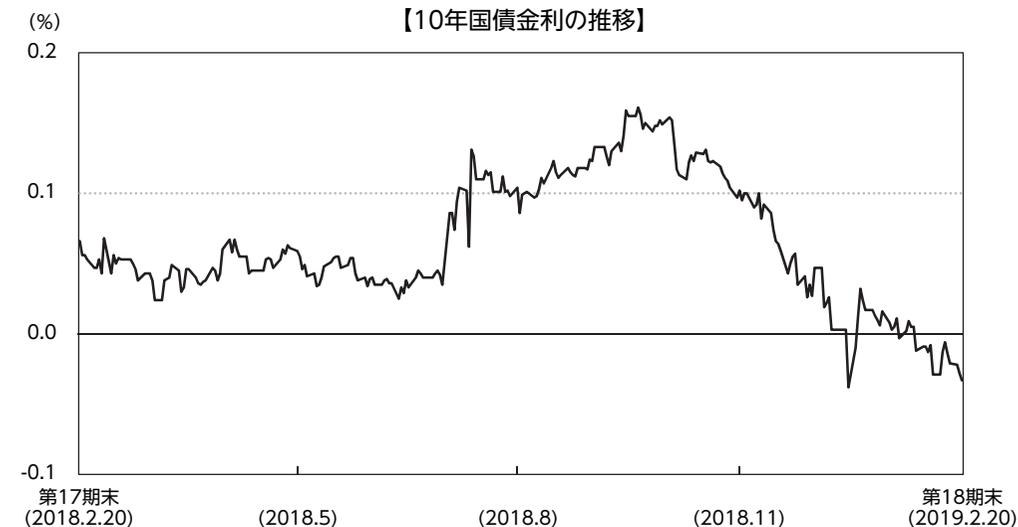
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年2月21日～2019年2月20日

国内債券市況



(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

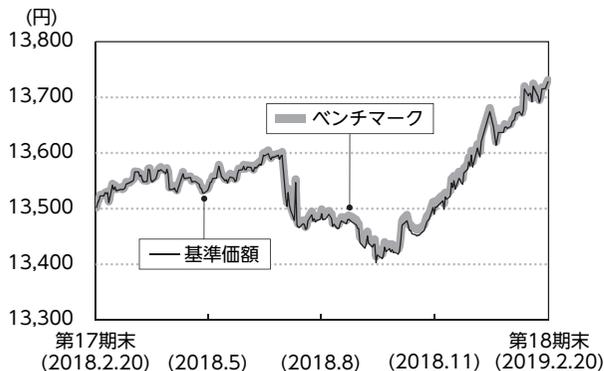
当期の10年国債金利は低下しました。

期初以降、米金利の先高観などから上昇する場面もありましたが、米保護主義政策や米中貿易摩擦の強まりに対する懸念などもあり、国内金利は上下する展開となりました。

7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利は上昇し、以降、円安・株高の進行等を受けて上昇傾向となりました。

しかし10月には、日米の株価が大きく下落したことなどから金利は低下し、その後も世界景気の減速懸念を背景に低下しました。年明け後は、世界的な株価の反発から金利が上昇する場面もありましたが、米金利の先高観が弱まったことなどから国内金利も低下基調となり、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、米金利の先高観や米保護主義政策に対する懸念などを背景とした国内金利の変動を受けて上下しました。7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利が上昇（債券価格は下落）したため基準価額は下落し、その後は下落基調となりました。

しかし10月になると、日米の株価が大きく下落したことなどから金利が低下したことを受けて、基準価額は上昇しました。以降も世界景気の減速懸念を背景とした金利低下傾向から基準価額は上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公債券流通市場全体の動向を表すために、野村証券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村証券株式会社の知的財産です。野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

当期も上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しおおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

(注) デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+1.7%となり、ベンチマーク騰落率（+1.7%）に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
14期(2015年 2月20日)	12,827	2.3	12,839	2.4	99.5	34,807
15期(2016年 2月22日)	13,389	4.4	13,376	4.2	99.0	25,320
16期(2017年 2月20日)	13,369	△0.1	13,372	△0.0	99.3	28,941
17期(2018年 2月20日)	13,502	1.0	13,506	1.0	99.0	29,566
18期(2019年 2月20日)	13,728	1.7	13,736	1.7	99.0	33,405

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、設定時を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
	円	%		%	%
(期首)2018年 2月20日	13,502	-	13,506	-	99.0
2月末	13,527	0.2	13,533	0.2	98.7
3月末	13,548	0.3	13,555	0.4	99.4
4月末	13,536	0.3	13,546	0.3	99.5
5月末	13,567	0.5	13,576	0.5	99.3
6月末	13,573	0.5	13,582	0.6	99.6
7月末	13,547	0.3	13,558	0.4	99.4
8月末	13,472	△0.2	13,484	△0.2	99.0
9月末	13,438	△0.5	13,451	△0.4	99.4
10月末	13,461	△0.3	13,475	△0.2	99.0
11月末	13,517	0.1	13,531	0.2	99.0
12月末	13,620	0.9	13,634	0.9	96.5
2019年 1月末	13,677	1.3	13,685	1.3	99.1
(期末)2019年 2月20日	13,728	1.7	13,736	1.7	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年2月21日～2019年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,539円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年2月21日～2019年2月20日

公社債

		買付額	売付額
国		千円	千円
内	国債証券	33,836,483	30,232,548

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

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

主要な売買銘柄

2018年2月21日～2019年2月20日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第94回 利付国債(20年)	2,402,830	第152回 利付国債(20年)	2,438,276
第385回 利付国債(2年)	2,394,825	第385回 利付国債(2年)	2,391,442
第392回 利付国債(2年)	2,103,489	第303回 利付国債(10年)	2,294,087
第338回 利付国債(10年)	2,102,558	第321回 利付国債(10年)	1,971,898
第110回 利付国債(20年)	2,088,375	第342回 利付国債(10年)	1,537,727
第129回 利付国債(5年)	2,079,310	第100回 利付国債(20年)	1,487,322
第328回 利付国債(10年)	1,886,941	第310回 利付国債(10年)	1,478,839
第18回 利付国債(30年)	1,733,682	第333回 利付国債(10年)	1,402,131
第143回 利付国債(20年)	1,572,003	第55回 利付国債(20年)	1,267,938
第346回 利付国債(10年)	1,538,013	第85回 利付国債(20年)	997,418

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2019年2月20日現在

国内(邦貨建) 公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	29,799,000	33,058,232	99.0	-	62.3	25.0	11.6
合計	29,799,000	33,058,232	99.0	-	62.3	25.0	11.6

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

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 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。

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第390回 利付国債(2年)	0.1000	2020/7/1	933,000	936,741
	第392回 利付国債(2年)	0.1000	2020/9/1	2,040,000	2,048,894
	第125回 利付国債(5年)	0.1000	2020/9/20	73,000	73,329
	第127回 利付国債(5年)	0.1000	2021/3/20	836,000	840,957

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第129回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/9/20	2,004,000	2,018,789
	第131回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/3/20	288,000	290,537
	第135回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/3/20	1,011,000	1,022,818
	第 2 回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	121,000	174,547
	第 4 回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	34,000	49,770
	第 8 回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	581,000	723,124
	第310回 利付国債 (10年)	1.0000	2020/9/20	811,000	826,206
	第321回 利付国債 (10年)	1.0000	2022/3/20	479,000	496,545
	第328回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/3/20	2,386,000	2,462,375
	第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/3/20	485,000	504,370
	第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/3/20	2,105,000	2,179,306
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/3/20	1,473,000	1,502,474
	第 18 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/3/20	1,169,000	1,546,481
	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/3/20	259,000	352,851
	第 30 回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/3/20	411,000	560,266
	第 33 回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/9/20	100,000	131,781
	第 34 回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/3/20	559,000	762,313
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/3/20	1,030,000	1,333,468
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/3/20	1,264,000	1,344,112
	第 61 回 利付国債 (20年)	1.0000	2023/3/20	1,166,000	1,222,457
第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/3/20	950,000	1,070,688	
第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/3/20	1,671,000	1,975,857	
第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/3/20	14,000	16,917	
第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/3/20	1,670,000	2,029,417	
第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/3/20	1,362,000	1,711,380	
第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/3/20	1,277,000	1,533,268	
第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/3/20	1,237,000	1,316,180	
合計		-	-	-	33,058,232

投資信託財産の構成

2019年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 33,058,232	% 98.9
コール・ローン等、その他	380,721	1.1
投資信託財産総額	33,438,954	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券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

(2019年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	33,438,954,135円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	253,673,365
公 社 債 (評 価 額)	33,058,232,530
未 収 利 息	116,542,079
前 払 費 用	10,506,161
(B)負債	33,907,429
未 払 解 約 金	33,907,195
そ の 他 未 払 費 用	234
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	33,405,046,706
元 本	24,333,886,950
次 期 繰 越 損 益 金	9,071,159,756
(D)受 益 権 総 口 数	24,333,886,950口
1万口当たり基準価額 (C / D)	13,728円

(注1) 期首元本額 21,897,583,332円
 期中追加設定元本額 7,947,309,643円
 期中一部解約元本額 5,511,006,025円

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

ニッセイ国内債券インデックス S A (適格機関投資家限定)	1,555,629,635円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,461,494,141円
ニッセイ日本バランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)	3,873,812円
ニッセイ日本バランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)	2,711,425円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	3,293,018,741円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	5,191,672,341円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	1,326,747,651円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (債券重視型) S A (適格機関投資家限定)	41,662,764円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)	62,601,767円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)	32,370,435円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	4,788,224,471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)	573,879,767円

損益の状況

当期 (2018年2月21日~2019年2月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	345,776,604円
受 取 利 息	345,999,041
支 払 利 息	△ 222,437
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	189,860,375
売 買 益	367,406,957
売 買 損	△ 177,546,582
(C)信 託 報 酬 等	△ 60,350
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	535,576,629
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,669,263,737
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,818,069,059
(G)解 約 差 損 益 金	△ 1,951,749,669
(H)合 計 (D + E + F + G)	9,071,159,756
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	9,071,159,756

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 22 期

(計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

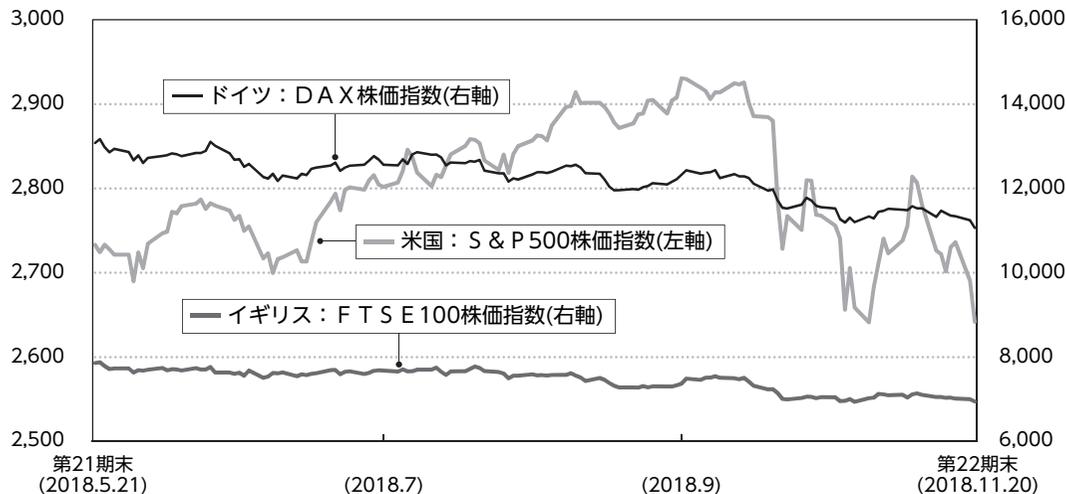
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期を通じて見ると下落しました。

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

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

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

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-2.4%となり、ベンチマーク騰落率（-2.5%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415
19期(2017年5月22日)	15,268	13.8	15,052	13.7	94.6	2.8	2.4	82,206
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613
21期(2018年5月21日)	17,317	4.5	17,031	4.4	95.6	1.9	2.2	131,686
22期(2018年11月20日)	16,899	△2.4	16,598	△2.5	94.2	3.3	2.4	149,718

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年5月21日	17,317	-	17,031	-	95.6	1.9	2.2
5月末	16,847	△2.7	16,571	△2.7	95.8	1.9	2.2
6月末	16,982	△1.9	16,701	△1.9	95.4	2.1	2.2
7月末	17,653	1.9	17,358	1.9	95.7	1.9	2.2
8月末	18,035	4.1	17,730	4.1	95.1	2.4	2.2
9月末	18,492	6.8	18,174	6.7	95.8	1.9	2.2
10月末	16,868	△2.6	16,571	△2.7	94.2	3.4	2.3
(期末)2018年11月20日	16,899	△2.4	16,598	△2.5	94.2	3.3	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円	0.002%	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (株式)	1	0.008	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	5 (4)	0.029 (0.023)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(1)	(0.006)	
			・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	7	0.040	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,533円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年5月22日～2018年11月20日

(1) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
アメリカ	百株 16,961 (710)	千米ドル 132,982 (△ 1,479)	百株 1,507	千米ドル 9,567
カナダ	2,605 (75)	千カナダ・ドル 10,191	173	千カナダ・ドル 316
オーストラリア	4,048 (△ 8)	千オーストラリア・ドル 6,642 (△ 17)	222	千オーストラリア・ドル 156
香港	5,473 (311)	千香港ドル 19,336	2,000	千香港ドル 779
シンガポール	2,446	千シンガポール・ドル 1,368	529	千シンガポール・ドル 99
ニュージーランド	662	千ニュージーランド・ドル 539	218	千ニュージーランド・ドル 68
イギリス	19,298 (27,453)	千イギリス・ポンド 11,563 (△ 90)	39,408	千イギリス・ポンド 1,501
イスラエル	326 (△ 10)	千イスラエル・シケル 797 (△ 347)	4	千イスラエル・シケル 178
スイス	1,036 (67)	千スイス・フラン 6,483	54	千スイス・フラン 189
デンマーク	229	千デンマーク・クローネ 8,509	46	千デンマーク・クローネ 1,587
ノルウェー	358	千ノルウェー・クローネ 5,784	—	千ノルウェー・クローネ —
スウェーデン	1,326 (342)	千スウェーデン・クローナ 17,797	512	千スウェーデン・クローナ 1,435

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

		買付		売付		
		株数	金額	株数	金額	
外国	ユーロ		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		アイルランド	251	613	—	—
		オランダ	1,067	2,825	557	903
		ベルギー	105	683	0.99	4
		ルクセンブルグ	65	148	—	—
		フランス	1,655	7,176	47	149
				(△ 2)		
		ドイツ	1,507	6,789	411	1,754
			(298)	(△ 9)		
		ポルトガル	240	126	—	—
		スペイン	2,927	2,102	—	—
			(20)	(0.1000)		
		イタリア	3,260	1,649	388	93
	(68)					
フィンランド	452	663	43	26		
オーストリア	40	151	0.27	1		
		(△ 11)				
その他	11	92	—	—		

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	9	150
COLONY CAPITAL INC	—	—	15	94
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.581	92	—	—
INVITATION HOMES INC	2	46	—	—
BROOKFIELD PROPERTY PARTNERS	—	—	0.355	6
	(0.355)	(8)		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	0.589	11	—	0.010
	(8)	(△ 271)		
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	37	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1	39	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	43	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	8	83	—	—
GPT GROUP	15	80	—	—
GOODMAN GROUP	10	102	5	48
STOCKLAND	18	74	—	—
WESTFIELD CORP	—	—	64	569
MIRVAC GROUP	28	66	—	—
VICINITY CENTRES	26	70	—	—
SCENTRE GROUP	37	154	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	11	820	0.500	34
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	18	50	0.200	0.528
		(△0.648)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25	45	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	21	45	1	2
SUNTEC REIT	16	29	11	19
		(△0.583)		
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	6	39	0.176	1
HAMMERSON PLC	4	23	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	5	48	—	—
SEGRO PLC	7	49	—	—

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	30,329	27,759	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年5月22日～2018年11月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	22	531,819	23,195	MONSANTO CO	14	198,582	14,149
AMAZON.COM INC	2	454,037	201,704	LINDE PLC	10	188,369	18,406
MICROSOFT CORP	37	448,098	12,010	APPLE INC	4	104,876	25,850
FACEBOOK INC-A	12	249,131	19,174	SKY PLC	36	89,988	2,479
JOHNSON & JOHNSON	13	209,145	15,039	KEURIG DR PEPPER INC	5	79,763	13,641
ALPHABET INC-CL C	1	208,989	128,214	RELX PLC	33	78,357	2,361
ALPHABET INC-CL A	1	205,138	129,998	XL GROUP LTD	8	57,559	6,541
EXXON MOBIL CORP	22	201,250	9,129	CA Inc	11	55,863	5,013
JPMORGAN CHASE & CO	15	197,343	12,498	OLD MUTUAL PLC	156	47,539	304
LINDE PLC	10	192,403	18,651	AMGEN INC	1	31,429	20,044

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

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

組入有価証券明細表

2018年11月20日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
3M CO	186	217	4,467	503,371	資本財
ABBOTT LABORATORIES	546	641	4,528	510,181	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	501	555	4,970	559,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	-	15	463	52,260	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	192	235	3,829	431,450	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	225	264	1,300	146,576	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	13	14	185	20,863	資本財
ADOBE INC	154	180	3,962	446,410	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	23	27	480	54,193	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	257	337	644	72,590	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	42	45	230	25,938	資本財
AES CORP	210	245	377	42,503	公益事業
AETNA INC	102	119	2,484	279,880	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	17	19	216	24,425	各種金融
AFLAC INC	245	282	1,279	144,153	保険
AGCO CORP	19	22	131	14,777	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	100	116	731	82,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	68	80	1,280	144,226	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	53	62	425	47,990	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	34	40	403	45,419	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	70	81	936	105,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	23	27	569	64,193	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	48	56	193	21,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	4	5	344	38,820	保険
ALLEGION PLC	30	34	310	34,937	資本財
ALLERGAN PLC	104	124	1,936	218,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	18	353	39,876	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	73	85	389	43,899	公益事業
ALLSTATE CORP	112	128	1,133	127,670	保険
ALLY FINANCIAL INC	138	157	392	44,255	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27	33	236	26,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	93	109	11,239	1,266,407	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	98	115	11,730	1,321,619	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	598	692	3,858	434,732	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	128	151	22,844	2,573,907	小売
AMERCO	2	3	120	13,583	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMEREN CORPORATION	76	89	627	70,702	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	44	160	18,072	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	154	181	1,403	158,149	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	231	267	2,899	326,683	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23	26	278	31,407	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	281	328	1,422	160,277	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	56	65	615	69,342	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	46	52	664	74,904	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	51	60	547	61,703	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	88	103	539	60,832	各種金融
AMETEK INC	72	84	611	68,898	資本財
AMGEN INC	227	242	4,722	532,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	95	110	950	107,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	171	188	1,046	117,962	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	115	135	1,159	130,696	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	46	-	-	-	エネルギー
ANSYS INC	26	30	458	51,632	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	69	74	105	11,891	エネルギー
ANTHEM INC	80	93	2,632	296,633	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	78	89	1,479	166,727	保険
APACHE CORP	118	139	509	57,374	エネルギー
APPLE INC	1,611	1,800	33,457	3,769,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	334	368	1,270	143,094	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	83	96	699	78,820	自動車・自動車部品
ARAMARK	76	89	321	36,272	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41	147	417	46,989	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	175	203	943	106,322	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	135	158	323	36,435	資本財
ARISTA NETWORKS INC	14	19	426	48,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	27	31	233	26,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	56	66	518	58,399	保険
ASSURANT INC	16	18	188	21,182	保険
AT&T INC	1,930	2,663	8,084	910,875	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	33	56	247	27,891	保険
ATMOS ENERGY CORP	33	41	407	45,945	公益事業
AUTODESK INC	61	80	1,010	113,832	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	27	31	269	30,413	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	139	161	2,312	260,570	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	16	-	-	-	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AUTOZONE INC	8	9	811	91,387	小売
AVERY DENNISON CORP	27	32	296	33,432	素材
AVNET INC	37	42	183	20,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	69	81	197	22,302	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	25	29	160	18,033	保険
BAKER HUGHES A GE CO	127	151	349	39,350	エネルギー
BALL CORP	104	121	600	67,703	素材
BANK OF AMERICA CORP	3,108	3,525	9,784	1,102,377	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	320	369	1,851	208,640	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	153	186	1,210	136,347	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	246	283	1,466	165,204	銀行
BECTON DICKINSON & CO	83	97	2,382	268,424	ヘルスケア機器・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	398	468	10,203	1,149,679	各種金融
BEST BUY CO INC	84	92	576	64,992	小売
BIOGEN INC	66	77	2,466	277,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	55	64	606	68,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	37	43	1,789	201,650	各種金融
BOEING CO	177	202	6,505	732,933	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	15	17	3,141	353,975	小売
BORGWARNER INC	66	76	301	33,937	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	431	504	1,781	200,730	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	26	38	153	17,307	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	513	598	3,200	360,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	128	150	3,445	388,222	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	36	43	435	49,032	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	80	96	460	51,864	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	44	51	300	33,846	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	45	52	474	53,451	運輸
CA Inc	98	-	-	-	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	145	165	426	48,021	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	88	102	440	49,624	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	56	65	253	28,522	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151	177	1,561	175,895	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	98	113	620	69,882	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	57	65	406	45,805	小売
CARNIVAL CORP	108	155	921	103,769	消費者サービス
CATERPILLAR INC	186	218	2,757	310,681	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32	41	455	51,364	各種金融
CBRE GROUP INC	95	119	522	58,878	不動産

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CBS CORP-CL B	109	126	694	78,285	メディア
CDK GLOBAL INC	39	46	228	25,759	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	48	55	488	55,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	42	49	503	56,714	素材
CELGENE CORP	247	265	1,842	207,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	54	75	986	111,129	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	130	151	425	47,885	公益事業
CENTURYLINK INC	303	357	679	76,598	電気通信サービス
CERNER CORP	93	109	614	69,232	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	73	85	387	43,707	素材
CHARLES SCHWAB CORP	378	444	2,043	230,215	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	58	61	1,976	222,734	メディア
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	40	46	517	58,286	ソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO/THE - W/I	57	65	190	21,438	素材
CHENIERE ENERGY INC	63	77	463	52,239	エネルギー
CHEVRON CORP	596	699	8,354	941,328	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	9	426	48,027	消費者サービス
CHUBB LTD	145	170	2,284	257,400	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	89	577	65,123	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	77	89	1,880	211,892	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	29	34	306	34,565	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	48	56	455	51,278	保険
CINTAS CORP	28	33	595	67,073	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,552	1,723	7,883	888,234	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	41	41	186	21,038	銀行
CITIGROUP INC	829	933	6,031	679,612	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	153	176	633	71,430	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	47	49	531	59,858	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	40	47	768	86,542	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	106	124	2,435	274,368	各種金融
CMS ENERGY CORP	90	105	542	61,133	公益事業
COCA-COLA CO	1,270	1,480	7,478	842,558	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	68	79	390	43,987	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	54	63	257	29,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	184	214	1,483	167,108	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	262	303	1,904	214,630	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	1,465	1,683	6,429	724,378	メディア
COMERICA INC	54	62	504	56,808	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	60	71	128	14,525	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CONAGRA BRANDS INC	128	143	479	54,067	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	46	73	1,016	114,476	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	374	427	2,841	320,115	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	97	114	887	100,015	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	54	61	1,190	134,112	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	28	33	160	18,030	エネルギー
COOPER COS INC/THE	15	17	459	51,791	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	-	76	370	41,750	商業・専門サービス
CORNING INC	272	303	947	106,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	11	13	464	52,303	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	137	160	3,674	414,003	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	152	178	162	18,356	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	42	49	242	27,378	素材
CSX CORP	268	306	2,207	248,672	運輸
CUMMINS INC	49	57	831	93,699	資本財
CVS HEALTH CORP	317	372	2,923	329,405	ヘルスケア機器・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	-	124	110	12,434	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	196	230	2,330	262,544	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	38	45	512	57,704	消費者サービス
DAVITA INC	46	51	309	34,905	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	85	112	1,608	181,242	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	63	72	752	84,800	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	57	65	369	41,625	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	71	83	306	34,563	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	155	191	566	63,785	エネルギー
DIAMONDBACK ENERGY INC	27	36	410	46,213	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	113	127	893	100,679	各種金融
DISCOVERY INC-A	47	60	182	20,612	メディア
DISCOVERY INC-C	95	110	306	34,522	メディア
DISH NETWORK CORP	72	85	267	30,167	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	85	97	1,082	121,909	小売
DOLLAR TREE INC	74	87	731	82,425	小売
DOMINION ENERGY INC	202	240	1,787	201,346	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	13	14	371	41,805	消費者サービス
DOVER CORP	48	56	487	54,885	資本財
DOWDUPONT INC	734	849	4,909	553,189	素材
DR HORTON INC	111	131	458	51,694	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	56	67	799	90,111	公益事業
DUKE ENERGY CORP	220	257	2,258	254,443	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DXC TECHNOLOGY CO	89	104	618	69,633	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	83	96	494	55,705	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	44	51	272	30,746	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	45	51	425	47,918	素材
EATON CORP PLC	137	159	1,171	132,033	資本財
EATON VANCE CORP	36	42	179	20,193	各種金融
EBAY INC	311	345	967	108,989	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	81	95	1,523	171,615	素材
EDISON INTERNATIONAL	102	119	645	72,754	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	66	77	1,155	130,232	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	96	112	932	105,059	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	310	357	4,140	466,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	201	230	1,576	177,577	資本財
ENERGY CORP	57	66	579	65,269	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	38	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	180	211	2,235	251,844	エネルギー
EQT CORP	79	-	-	-	エネルギー
EQUIFAX INC	37	43	446	50,282	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	70	81	1,169	131,803	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	12	14	320	36,083	保険
EVERGY INC	-	100	598	67,446	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	100	116	787	88,754	公益事業
EXELON CORP	301	354	1,635	184,270	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	39	45	512	57,687	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	58	65	485	54,666	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	177	205	1,992	224,446	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	1,329	1,549	12,278	1,383,423	エネルギー
F5 NETWORKS INC	19	22	381	42,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	748	878	11,556	1,302,089	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	90	105	603	68,013	資本財
FEDEX CORP	80	93	2,119	238,806	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	80	99	321	36,265	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	104	120	1,262	142,235	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	220	249	682	76,934	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	143	193	327	36,852	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	49	58	551	62,127	銀行
FIRSTENERGY CORP	140	176	680	76,619	公益事業
FISERV INC	131	149	1,177	132,681	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	28	32	626	70,615	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FLEX LTD	166	192	155	17,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	43	50	229	25,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	40	47	231	26,127	資本財
FLUOR CORP	43	51	224	25,259	資本財
FMC CORP	42	49	402	45,390	素材
FORD MOTOR CO	1,162	1,361	1,259	141,869	自動車・自動車部品
FORTINET INC	46	52	353	39,848	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	98	114	844	95,130	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	47	53	226	25,543	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	103	116	376	42,444	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	430	502	578	65,147	素材
GAP INC	72	85	216	24,401	小売
GARMIN LTD	38	41	266	30,018	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	28	33	486	54,775	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	79	92	1,655	186,484	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,721	3,181	2,493	280,989	資本財
GENERAL MILLS INC	178	216	959	108,129	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	400	464	1,657	186,703	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	45	53	544	61,370	小売
GILEAD SCIENCES INC	409	476	3,237	364,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	50	58	609	68,634	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	-	59	350	39,480	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	112	131	2,606	293,662	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	77	87	195	21,978	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	65	76	213	24,049	消費者サービス
HALLIBURTON CO	273	319	1,055	118,891	エネルギー
HANESBRANDS INC	114	132	197	22,268	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	53	61	245	27,631	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	37	43	641	72,268	資本財
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	111	130	570	64,297	保険
HASBRO INC	35	43	412	46,474	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	89	102	1,384	156,030	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	55	64	242	27,374	資本財
HELMERICH & PAYNE	33	39	251	28,382	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	49	56	485	54,740	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	44	51	560	63,138	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	89	100	574	64,760	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	499	558	828	93,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60	104	744	83,855	消費者サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HOLLYFRONTIER CORP	52	61	381	42,993	エネルギー
HOLOGIC INC	86	99	415	46,808	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	366	422	7,335	826,537	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	226	273	4,029	454,017	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	375	446	286	32,261	不動産
HORMEL FOODS CORP	90	105	480	54,107	食品・飲料・タバコ
HP INC	523	601	1,415	159,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	44	50	1,564	176,227	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	337	401	595	67,066	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	14	16	343	38,735	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	23	28	477	53,819	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	23	27	374	42,208	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	27	31	616	69,445	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	124	142	722	81,388	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	96	111	1,494	168,342	資本財
ILLUMINA INC	45	53	1,623	182,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	56	65	423	47,770	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	78	90	933	105,197	資本財
INGREDION INC	22	26	274	30,912	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,468	1,706	8,190	922,799	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	183	211	1,722	194,050	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	275	336	4,043	455,553	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	24	32	453	51,069	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	123	143	664	74,880	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	123	142	334	37,682	メディア
INTUIT INC	76	89	1,776	200,194	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	35	41	2,001	225,523	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	127	149	300	33,835	各種金融
IPG PHOTONICS CORP	11	13	186	21,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	42	58	677	76,374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24	28	379	42,765	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39	46	337	37,995	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	68	82	522	58,842	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	70	82	292	33,001	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	18	21	313	35,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	28	33	363	40,956	運輸
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	100	113	240	27,141	各種金融
JM SMUCKER CO	35	41	463	52,223	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	843	982	14,507	1,634,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	290	338	1,132	127,551	資本財
JONES LANG LASALLE INC	14	16	236	26,592	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,088	1,246	13,813	1,556,419	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	118	128	360	40,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	33	38	384	43,325	運輸
KELLOGG CO	81	95	587	66,225	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	56	-	-	-	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	336	386	705	79,494	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	-	68	378	42,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	110	127	1,412	159,151	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	631	726	1,265	142,539	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	49	57	526	59,327	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	44	51	165	18,604	運輸
KOHL'S CORP	52	61	436	49,165	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	190	222	1,156	130,346	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	297	908	102,410	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	75	86	300	33,827	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	24	28	536	60,419	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	31	37	604	68,156	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	50	60	863	97,235	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	123	143	726	81,846	消費者サービス
LEAR CORP	21	24	325	36,649	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	41	47	179	20,248	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	44	52	335	37,811	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	89	105	438	49,359	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	13	294	33,142	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	33	39	322	36,369	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62	71	170	19,191	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	176	200	464	52,336	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29	32	125	14,166	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	57	65	252	28,456	メディア
LIBERTY MEDIA GROUP-C	63	74	223	25,197	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	68	79	498	56,148	保険
LINDE PLC	-	205	3,285	370,163	素材
LIVE NATION INC	46	54	287	32,443	メディア
LKQ CORP	97	113	311	35,145	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	81	94	2,775	312,663	資本財
LOEWS CORP	89	98	476	53,671	保険
LOWE'S COS INC	260	301	2,750	309,883	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LULULEMON ATHLETICA INC	31	37	473	53,297	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	105	121	1,128	127,198	素材
M&T BANK CORP	42	50	843	95,045	銀行
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	27	-	-	-	運輸
MACY'S INC	95	111	370	41,695	小売
MANPOWER GROUP	20	23	185	20,926	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	264	310	531	59,844	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	153	254	1,612	181,725	エネルギー
MARKEL CORP	4	5	561	63,250	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	97	109	1,280	144,268	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	160	185	1,646	185,517	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	19	23	427	48,172	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	122	224	340	38,403	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	99	113	350	39,479	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	294	339	6,426	724,087	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	108	126	167	18,892	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	88	102	530	59,812	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	37	44	662	74,596	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	250	287	5,369	605,024	消費者サービス
MCKESSON CORP	65	73	932	105,112	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	424	495	4,480	504,822	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	77	90	148	16,699	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	13	15	515	58,118	ソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	854	984	7,519	847,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	279	314	1,374	154,910	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	9	536	60,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	142	193	496	55,930	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	47	54	244	27,542	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	73	85	634	71,478	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	361	424	1,563	176,152	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	2,299	2,673	27,965	3,150,902	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	17	20	235	26,520	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	23	288	32,478	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	59	69	459	51,740	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	468	539	2,398	270,260	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	138	-	-	-	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	123	154	880	99,247	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	54	63	938	105,739	各種金融
MORGAN STANLEY	425	486	2,160	243,398	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MOSAIC CO/THE	104	133	467	52,622	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	51	59	755	85,161	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	28	32	475	53,584	各種金融
MYLAN NV	142	188	652	73,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	36	42	377	42,582	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	118	139	457	51,546	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	-	62	238	26,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	83	98	659	74,288	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	135	159	4,308	485,437	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	151	174	167	18,859	銀行
NEWELL BRANDS INC	153	177	380	42,922	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	62	72	140	15,844	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	165	193	635	71,594	素材
NEWS CORP - CLASS A	121	143	191	21,541	メディア
NEXTERA ENERGY INC	147	173	3,149	354,895	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	130	334	37,658	商業・専門サービス
NIKE INC	411	469	3,406	383,857	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	108	134	349	39,382	公益事業
NOBLE ENERGY INC	144	176	440	49,669	エネルギー
NORDSTROM INC	39	42	220	24,799	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	91	104	1,781	200,763	運輸
NORTHERN TRUST CORP	67	77	761	85,762	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	51	60	1,632	183,966	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	57	77	383	43,249	消費者サービス
NUCOR CORP	99	115	717	80,816	素材
NVIDIA CORP	190	211	3,055	344,261	半導体・半導体製造装置
NVR INC	1	1	309	34,847	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	106	125	1,024	115,483	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	239	279	2,051	231,102	エネルギー
OGE ENERGY CORP	63	73	291	32,830	公益事業
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20	23	312	35,198	運輸
OMNICOM GROUP	73	84	646	72,854	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	-	155	274	30,948	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	120	150	937	105,572	エネルギー
ORACLE CORP	982	1,121	5,554	625,859	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	26	30	1,063	119,856	小売
OWENS CORNING	34	40	196	22,193	資本財
PACCAR INC	110	128	775	87,380	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	29	34	333	37,522	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PALO ALTO NETWORKS INC	28	33	551	62,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	41	48	813	91,681	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	70	90	193	21,784	エネルギー
PAYCHEX INC	101	117	806	90,912	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	358	413	3,309	372,884	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	53	61	257	29,043	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	105	120	193	21,772	銀行
PEPSICO INC	446	519	6,182	696,536	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	39	47	301	33,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,869	2,141	9,459	1,065,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	161	189	440	49,664	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	487	569	4,990	562,243	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	136	162	1,537	173,237	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	35	41	368	41,543	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53	62	977	110,152	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	45	54	111	12,561	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	149	171	2,319	261,332	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	18	21	202	22,842	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	79	91	982	110,642	素材
PPL CORPORATION	217	257	809	91,226	公益事業
PRAXAIR INC	89	-	-	-	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	89	103	509	57,395	保険
PROCTER & GAMBLE CO	795	920	8,585	967,357	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	182	212	1,383	155,854	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	132	153	1,402	157,990	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	159	185	1,012	114,124	公益事業
PULTE GROUP INC	83	99	250	28,270	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	24	28	312	35,211	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	39	46	292	32,900	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	462	515	2,827	318,582	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	42	49	467	52,665	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	142	160	365	41,203	小売
RALPH LAUREN CORP	17	20	230	25,984	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	77	-	-	-	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	40	47	371	41,889	各種金融
RAYTHEON CO	90	105	1,854	208,953	資本財
RED HAT INC	55	65	1,126	126,961	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	24	29	985	111,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	362	407	657	74,094	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STATE STREET CORP	116	133	958	107,944	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	74	85	339	38,256	素材
STERICYCLE INC	26	31	144	16,247	商業・専門サービス
STRYKER CORP	105	123	2,064	232,584	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	148	169	1,067	120,273	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	16	19	463	52,262	銀行
SYMANTEC CORP	194	227	506	57,027	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	245	262	669	75,426	各種金融
SYNOPSIS INC	46	54	464	52,369	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	155	181	1,195	134,725	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	75	88	838	94,473	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	35	41	443	49,933	ソフトウェア・サービス
TAPESTRY INC	89	105	412	46,431	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	67	79	377	42,504	エネルギー
TARGET CORP	161	185	1,441	162,443	小売
TE CONNECTIVITY LTD	110	127	954	107,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	138	159	387	43,664	エネルギー
TELEFLEX INC	14	16	421	47,446	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	11	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA, INC.	42	46	1,649	185,905	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	286	353	778	87,744	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	309	358	3,390	381,956	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	82	93	520	58,661	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	125	147	3,429	386,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	38	40	418	47,178	小売
TIME WARNER INC	244	-	-	-	メディア
TJX COS INC	198	458	2,246	253,088	小売
T-MOBILE US INC	93	125	854	96,244	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	47	52	163	18,455	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	34	38	336	37,969	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	51	59	506	57,061	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39	44	411	46,382	小売
TRANSDIGM GROUP INC	16	17	584	65,895	資本財
TRANSUNION	48	67	411	46,412	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	85	98	1,287	145,101	保険
TRIMBLE INC	78	90	317	35,827	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	35	38	235	26,561	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	138	160	780	87,952	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	330	387	1,893	213,340	メディア

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TWITTER INC	198	248	793	89,395	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	93	108	645	72,726	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	55	64	366	41,267	公益事業
ULTA BEAUTY INC	18	21	659	74,300	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	55	70	148	16,675	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	59	67	131	14,839	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	248	285	4,300	484,567	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	23	26	239	27,008	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	218	254	2,827	318,579	運輸
UNITED RENTALS INC	26	30	344	38,775	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	237	278	3,554	400,527	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	13	15	183	20,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	304	351	9,362	1,054,910	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	27	31	417	47,075	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	69	79	283	31,889	保険
US BANCORP	519	569	3,134	353,115	銀行
VAIL RESORTS INC	12	14	386	43,547	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	137	157	1,272	143,325	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	28	33	385	43,386	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	35	44	373	42,029	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	28	40	607	68,451	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	49	57	702	79,168	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,283	1,515	9,189	1,035,388	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	79	93	1,503	169,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	105	122	982	110,655	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	110	130	409	46,095	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	569	654	8,815	993,283	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	80	124	294	33,151	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	22	26	413	46,561	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	55	61	266	30,059	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	41	48	503	56,694	素材
WABCO HOLDINGS INC	15	19	227	25,626	資本財
WABTEC CORP	27	31	275	31,026	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	263	308	2,527	284,733	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	468	540	5,229	589,230	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	474	545	6,294	709,154	メディア
WASTE CONNECTIONS INC	82	95	734	82,747	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	136	158	1,465	165,132	商業・専門サービス
WATERS CORP	24	28	565	63,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
WEC ENERGY GROUP INC	99	116	833	93,869	公益事業
WELLS FARGO & CO	1,467	1,694	9,036	1,018,113	銀行
WESTAR ENERGY INC	45	-	-	-	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP	92	109	493	55,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	143	167	314	35,387	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	-	13	97	10,953	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	79	93	430	48,543	素材
WEYERHAEUSER CO	236	280	758	85,468	不動産
WHIRLPOOL CORP	22	23	279	31,535	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	259	443	1,122	126,440	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	39	48	769	86,689	保険
WORKDAY INC-CLASS A	43	53	664	74,871	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC	93	108	854	96,220	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	30	34	274	30,892	保険
WR GRACE & CO	21	-	-	-	素材
WW GRAINGER INC	16	17	531	59,847	資本財
WYNDHAM DESTINATIONS INC	31	-	-	-	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	25	35	373	42,085	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	160	187	969	109,178	公益事業
XEROX CORP	68	83	221	25,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	78	92	814	91,768	半導体・半導体製造装置
XL GROUP LTD	80	-	-	-	保険
XPO LOGISTICS INC	-	44	331	37,300	運輸
XYLEM INC	56	65	455	51,276	資本財
YUM! BRANDS INC	100	118	1,043	117,556	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	61	80	209	23,590	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	33	42	116	13,072	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	63	74	844	95,117	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.	62	70	343	38,683	銀行
ZOETIS INC	153	177	1,596	179,824	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	96,098 601	112,261 595	850,286 -	95,801,747 <64.0%>
(カナダ)			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	72	85	402	34,388	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	135	158	1,033	88,391	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	55	97	154	13,206	公益事業
ARC RESOURCES LTD	107	128	140	11,995	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'	26	31	126	10,831	公益事業
AURORA CANNABIS INC	-	239	192	16,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF MONTREAL	203	234	2,295	196,268	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	375	438	3,101	265,232	銀行
BARRICK GOLD CORP	364	426	735	62,905	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	104	115	357	30,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	53	62	350	30,005	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	157	186	211	18,096	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC	608	770	159	13,646	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	266	311	1,793	153,397	各種金融
CAE INC	85	97	256	21,973	資本財
CAMECO CORP	124	144	233	19,931	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	136	162	1,845	157,853	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	238	272	3,100	265,114	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	343	450	1,614	138,110	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	46	53	1,474	126,117	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	20	22	350	29,976	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	44	51	163	14,016	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	44	54	287	24,607	素材
CENOVUS ENERGY INC	326	382	405	34,663	エネルギー
CGI GROUP INC	80	93	757	64,809	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	86	98	193	16,542	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	7	660	56,513	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	169	199	99	8,469	エネルギー
DOLLARAMA INC	33	114	397	33,960	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	117	-	-	-	各種金融
EMERA INC	22	26	116	9,980	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	53	63	157	13,501	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	520	624	2,736	234,020	エネルギー
ENCANA CORP	305	353	355	30,391	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	10	618	52,921	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	53	61	166	14,199	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	52	77	151	12,935	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	215	251	311	26,606	素材
FORTIS INC	135	159	735	62,922	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	57	68	604	51,684	素材
GEORGE WESTON LTD	16	28	269	23,039	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	69	78	325	27,806	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	271	317	396	33,935	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	93	107	331	28,310	保険
HUSKY ENERGY INC	110	128	216	18,520	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
HYDRO ONE LTD	100	127	248	21,257	公益事業
IGM FINANCIAL INC	27	32	108	9,240	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	93	106	440	37,641	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	33	39	193	16,518	保険
INTACT FINANCIAL CORP	44	51	528	45,191	保険
INTER PIPELINE LTD	119	141	321	27,468	エネルギー
KEYERA CORP	63	75	223	19,085	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	387	454	154	13,206	素材
LINAMAR CORP	15	16	80	6,921	自動車・自動車部品
LOBLAW COS LTD	67	69	409	34,992	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	204	235	126	10,858	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	107	123	815	69,731	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	620	725	1,580	135,136	保険
METHANEX CORP	26	24	183	15,724	素材
METRO INC	71	89	384	32,846	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	107	124	754	64,493	銀行
NUTRIEN LTD	202	232	1,600	136,870	素材
ONEX CORPORATION	26	32	274	23,455	各種金融
OPEN TEXT CORP	84	98	421	36,076	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	159	184	828	70,864	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	112	130	350	30,014	保険
POWER FINANCIAL CORP	79	91	258	22,124	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	67	76	143	12,256	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	71	87	618	52,888	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	118	136	962	82,300	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	457	527	5,003	427,936	銀行
SAPUTO INC	67	85	337	28,848	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	76	98	118	10,099	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	171	433	37,037	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	27	32	570	48,782	ソフトウェア・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	55	64	303	25,969	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	192	222	1,077	92,135	保険
SUNCOR ENERGY INC	519	598	2,583	220,907	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	178	185	524	44,828	素材
THOMSON REUTERS CORP	90	105	672	57,478	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	579	675	4,846	414,431	銀行
TOURMALINE OIL CORP	70	94	188	16,123	エネルギー
TRANSCANADA CORP	274	328	1,745	149,312	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	312	355	87	7,469	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
VERMILION ENERGY INC		36	52	176	15,086	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		21	21	153	13,163	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		137	161	340	29,079	素材
WSP GLOBAL INC		-	37	245	20,988	資本財
小計		12,669	15,178	61,805	5,285,617	
	株数・金額 銘柄数<比率>	86	87	-	<3.5%>	
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD		217	253	467	38,420	公益事業
ALUMINA LTD		818	936	217	17,860	素材
AMCOR LTD		383	452	610	50,171	素材
AMP LTD		976	1,127	290	23,922	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		176	217	561	46,187	消費者サービス
ASX LTD		68	78	476	39,142	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD		723	846	350	28,805	運輸
AUSNET SERVICES		843	941	150	12,380	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		933	1,078	2,713	223,148	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		139	170	166	13,652	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		167	201	203	16,745	銀行
BHP BILLITON LTD		1,016	1,188	3,849	316,561	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		181	207	266	21,947	素材
BORAL LTD		390	455	241	19,855	素材
BRAMBLES LTD		521	609	625	51,448	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		88	103	272	22,435	エネルギー
CHALLENGER LTD		198	222	215	17,682	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED		33	39	168	13,824	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED		191	212	215	17,760	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		19	22	349	28,701	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		556	652	4,471	367,723	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		155	181	349	28,721	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		131	154	181	14,897	消費者サービス
CSL LIMITED		143	166	3,037	249,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		20	23	113	9,334	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		18	22	103	8,474	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		500	600	243	19,987	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		190	234	73	6,078	小売
HEALTHSCOPE LTD		589	693	162	13,392	ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD		572	670	261	21,501	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		785	890	629	51,797	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		147	173	278	22,892	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千ドル	千円		
MACQUARIE GROUP LTD	104	121	1,417	116,554	各種金融	
MEDIBANK PRIVATE LTD	928	1,090	283	23,324	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	856	1,017	2,399	197,336	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	247	290	598	49,227	素材	
OIL SEARCH LTD	460	525	391	32,227	エネルギー	
ORICA LTD	125	150	263	21,692	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED	566	667	457	37,627	エネルギー	
QBE INSURANCE GROUP LTD	442	521	591	48,672	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	47	55	303	24,982	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	20	22	164	13,496	ソフトウェア・サービス	
RIO TINTO LTD	132	154	1,230	101,205	素材	
SANTOS LTD	606	664	405	33,324	エネルギー	
SEEK LTD	114	135	238	19,616	商業・専門サービス	
SONIC HEALTHCARE LTD	136	160	348	28,627	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	1,649	1,909	632	51,974	素材	
SUNCORP GROUP LTD	433	510	685	56,328	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	629	735	331	27,266	消費者サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,408	1,631	494	40,639	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD	136	162	119	9,804	電気通信サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	236	272	390	32,090	食品・飲料・タバコ	
WESFARMERS LIMITED	362	421	1,848	151,982	食品・生活必需品小売り	
WESTPAC BANKING CORP	1,078	1,274	3,200	263,217	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	303	349	1,137	93,509	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	418	494	1,417	116,567	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,350 56	27,167 56	41,670 -	3,426,540 <2.3%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	3,792	4,426	29,017	417,269	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	98	111	831	11,955	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	402	454	1,189	17,104	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,165	1,350	4,091	58,838	銀行	
CK ASSET HOLDINGS LTD	809	964	5,437	78,190	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	854	989	8,194	117,838	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	220	250	1,453	20,904	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD	526	606	5,382	77,394	公益事業	
FIRST PACIFIC CO	720	-	-	-	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	758	868	4,071	58,546	消費者サービス	
HANG LUNG GROUP LTD	300	360	779	11,207	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	631	791	1,238	17,802	不動産	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HANG SENG BANK LTD	241	279	5,010	72,046	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	382	510	1,985	28,549	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	2,713	3,426	5,236	75,295	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	370	433	9,874	142,001	各種金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	190	260	1,032	14,843	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD	210	250	666	9,580	不動産	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	1,220	-	-	-	各種金融	
LI & FUNG LTD	1,872	2,212	367	5,282	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	308	352	428	6,155	消費者サービス	
MINTH GROUP LTD	220	260	704	10,132	自動車・自動車部品	
MTR CORP	527	597	2,372	34,113	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,876	2,336	2,514	36,155	不動産	
NWS HOLDINGS LTD	500	560	917	13,190	資本財	
PCCW LTD	1,560	1,830	796	11,447	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	445	515	2,775	39,909	公益事業	
SANDS CHINA LTD	765	889	2,927	42,096	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD	380	480	560	8,062	消費者サービス	
SINO LAND CO	1,000	1,260	1,638	23,554	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	590	720	501	7,206	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	460	595	6,553	94,239	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	163	193	1,710	24,603	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	376	452	1,337	19,239	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	440	505	2,179	31,335	耐久消費財・アパレル	
WH GROUP LTD	2,785	3,240	2,106	30,284	食品・飲料・タバコ	
WHARF HOLDINGS LTD	387	467	974	14,011	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	387	457	2,380	34,230	不動産	
WHEELOCK & CO LTD	270	330	1,527	21,971	不動産	
WYNN MACAU LTD	493	577	967	13,906	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	235	270	638	9,182	耐久消費財・アパレル	
小計	株数・金額	31,648	35,433	122,369	1,759,679	
	銘柄数<比率>	41	39	-	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND LTD	812	986	309	25,440	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	129	156	130	10,703	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	742	843	181	14,892	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	561	651	1,510	124,102	銀行	
GENTING SINGAPORE LTD	1,886	2,171	204	16,768	消費者サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,154	2,237	52	4,319	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	32	35	122	10,060	小売	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
KEPPEL CORP LTD		458	524	329	27,082	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		984	1,139	1,263	103,793	銀行
SATS LTD		248	284	137	11,318	運輸
SENBCORP INDUSTRIES LTD		315	357	96	7,891	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		185	207	194	15,988	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		252	281	203	16,740	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		516	604	161	13,251	メディア
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		497	545	190	15,673	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,635	3,060	942	77,443	電気通信サービス
STARHUB LTD		244	-	-	-	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		417	484	1,173	96,442	銀行
UOL Group Limited		153	193	119	9,784	不動産
VENTURE CORP LTD		-	98	146	12,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		503	677	220	18,079	食品・飲料・タバコ
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING		703	811	102	8,463	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,426 21	16,343 21	7,792 -	640,280 <0.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
A2 MILK CO LTD		-	267	279	21,571	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		326	393	279	21,520	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		178	209	271	20,914	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		214	311	172	13,319	素材
MERCURY NZ LTD		218	-	-	-	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		395	467	151	11,687	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		123	146	173	13,389	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		608	715	294	22,737	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,065 7	2,510 7	1,623 -	125,139 <0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		300	348	282	40,886	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		63	72	144	20,956	保険
ANGLO AMERICAN PLC		416	382	659	95,519	素材
ANTOFAGASTA PLC		121	139	113	16,452	素材
ASHTREAD GROUP PLC		156	179	322	46,715	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		111	130	322	46,715	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		397	463	2,863	414,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		307	349	149	21,651	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		1,256	1,460	608	88,047	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC		76	90	53	7,732	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イリス・ポンド	千円	
BAE SYSTEMS PLC	1,000	1,166	606	87,804	資本財
BARCLAYS PLC	5,348	6,264	1,039	150,586	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	316	368	181	26,233	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	40	46	155	22,557	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	659	770	1,251	181,183	素材
BP PLC	6,210	7,305	3,818	552,954	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	719	840	2,287	331,211	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	2,666	3,116	797	115,531	電気通信サービス
BUNZL PLC	106	122	281	40,813	資本財
BURBERRY GROUP PLC	133	153	273	39,538	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC	57	65	295	42,739	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,763	2,074	294	42,717	公益事業
COBHAM PLC	755	-	-	-	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	57	73	169	24,479	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	496	580	921	133,457	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	432	504	81	11,781	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	41	48	232	33,691	素材
DCC PLC	28	32	189	27,474	資本財
DIAGEO PLC	782	901	2,511	363,705	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	431	497	157	22,858	保険
EASYJET PLC	52	61	72	10,489	運輸
EXPERIAN PLC	290	336	620	89,861	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	78	84	414	60,069	資本財
FRESNILLO PLC	68	78	70	10,224	素材
G4S PLC	490	569	104	15,124	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,545	1,816	2,849	412,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	3,830	4,212	1,266	183,378	素材
GVC HOLDINGS PLC	-	199	155	22,562	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81	103	189	27,489	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	6,272	7,338	4,780	692,259	銀行
IMI PLC	85	-	-	-	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	299	349	895	129,634	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	-	466	341	49,413	メディア
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	56	66	276	39,992	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	50	59	266	38,609	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	210	245	122	17,805	各種金融
ITV PLC	1,149	1,348	197	28,530	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	60	70	203	29,496	素材
KINGFISHER PLC	677	781	191	27,742	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ST JAMES'S PLACE PLC		166	194	195	28,359	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC		1,035	1,028	614	88,940	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		835	853	219	31,751	各種金融
TAYLOR WIMPEY PLC		1,023	1,189	176	25,519	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		2,572	3,581	735	106,519	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC		78	90	91	13,261	資本財
TUI AG-DI		136	158	201	29,170	消費者サービス
UNILEVER PLC		386	447	1,906	276,024	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		222	258	192	27,850	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		8,426	9,847	1,534	222,168	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE		70	87	132	19,129	資本財
WHITBREAD PLC		57	66	304	44,067	消費者サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC		211	248	159	23,089	エネルギー
WPP PLC		398	465	398	57,735	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	130,936 97	138,280 97	64,786 -	9,381,730 <6.3%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		12	16	309	9,420	不動産
BANK HAPOALIM BM		326	380	1,009	30,722	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		449	519	1,263	38,441	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		647	792	369	11,237	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		7	8	366	11,146	資本財
FRUTAROM		12	-	-	-	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		213	252	575	17,524	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		41	48	323	9,832	銀行
NICE LTD		18	22	930	28,305	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,728 9	2,040 8	5,147 -	156,631 <0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		577	674	1,340	152,031	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		50	59	280	31,832	商業・専門サービス
BALOISE HOLDING AG		15	17	255	28,955	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.67	0.82	141	16,043	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.33	0.39	271	30,764	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	238	27,084	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		164	191	1,262	143,222	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		73	73	152	17,295	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		760	938	1,156	131,163	各種金融
DUFREY AG-REG		11	11	123	13,993	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	161	18,346	素材
GEBERIT AG-REG	11	13	511	58,043	資本財
GIVAUDAN-REG	2	3	817	92,734	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	70	82	360	40,894	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	18	21	282	32,054	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	142	178	814	92,364	素材
LONZA GROUP AG	23	27	818	92,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	976	1,140	9,497	1,077,172	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	697	793	6,929	785,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR	12	13	97	11,114	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5	6	427	48,438	各種金融
ROCHE HOLDING AG	220	257	6,343	719,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6	6	134	15,235	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12	15	300	34,113	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	1	1	445	50,529	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER	0.66	47	589	66,912	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	16	20	305	34,655	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	3	3	239	27,145	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	9	11	364	41,352	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10	12	471	53,494	保険
SWISS PRIME SITE-REG	22	28	233	26,506	不動産
SWISS RE AG	98	114	1,013	115,007	保険
SWISSCOM AG	8	9	461	52,324	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	-	22	274	31,110	ソフトウェア・サービス
THE SWATCH GROUP AG-REG	15	16	97	11,097	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG	1,149	1,414	1,919	217,737	各種金融
VIFOR PHARMA AG	15	16	212	24,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	47	55	1,688	191,459	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,256 37	6,307 38	41,037 -	4,654,480 <3.1%>
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	2	2,120	36,639	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S	1	1	1,156	19,979	運輸
CARLSBERG AS-B	33	39	2,855	49,341	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	31	36	2,270	39,237	素材
COLOPLAST-B	37	43	2,669	46,133	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	235	261	3,544	61,248	銀行
DSV A/S	61	70	3,559	61,506	運輸
GENMAB A/S	18	22	2,088	36,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
H LUNDBECK A/S		21	25	695	12,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		52	60	1,350	23,338	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S		584	665	19,629	339,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		70	79	2,542	43,930	素材
ORSTED A/S		59	69	3,090	53,411	公益事業
PANDORA A/S		33	40	1,382	23,888	耐久消費財・アパレル
TRYGVESTA AS		35	41	669	11,567	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		67	71	3,265	56,433	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING		36	36	719	12,440	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,383	1,566	53,610	926,384	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
AKER BP ASA		-	39	958	12,729	エネルギー
DNB ASA		307	357	5,369	71,303	銀行
EQUINOR ASA		362	428	8,789	116,724	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		62	72	980	13,023	保険
MARINE HARVEST		130	152	3,019	40,092	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		415	485	2,039	27,084	素材
ORKLA ASA		256	299	2,142	28,445	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-B SHS		30	36	1,027	13,648	メディア
TELENOR ASA		238	280	4,610	61,223	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		55	65	2,237	29,707	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,860	2,219	31,173	413,985	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		93	108	2,151	26,909	資本財
ASSA ABLOY AB		316	369	6,331	79,212	資本財
ATLAS COPCO AB		122	142	2,727	34,127	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		207	-	-	-	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		211	247	5,084	63,609	資本財
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION		119	-	-	-	資本財
BOLIDEN AB		84	98	2,014	25,205	素材
BOLIDEN AB-REDEMPTION		83	-	-	-	素材
ELECTROLUX AB		76	89	1,691	21,160	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		-	247	1,949	24,392	資本財
EPIROC AB-B		-	143	1,087	13,603	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		192	223	4,922	61,584	家庭用品・パーソナル用品
GETINGE AB-B SHS		72	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		298	322	5,170	64,677	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEXAGON AB-B SHS	82	95	4,050	50,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS	135	155	1,045	13,084	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB	24	29	968	12,122	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	52	63	1,160	14,523	各種金融	
INVESTOR AB	143	168	6,425	80,378	各種金融	
KINNEVIK AB - B	73	86	2,031	25,417	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS	24	28	773	9,677	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	61	69	1,684	21,068	エネルギー	
NORDEA BANK AB	954	-	-	-	銀行	
NORDEA BANK ABP	-	1,119	9,096	113,792	銀行	
SANDVIK AB	356	415	5,545	69,376	資本財	
SECURITAS AB	101	117	1,796	22,478	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	478	602	5,626	70,383	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	107	125	1,795	22,463	資本財	
SKF AB	120	139	1,927	24,114	資本財	
SVENSKA HANDELSBANKEN	483	565	5,489	68,667	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	286	336	6,926	86,651	銀行	
SWEDISH MATCH AB	58	65	2,643	33,076	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB	123	139	1,497	18,730	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	970	1,130	8,581	107,352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	921	1,066	4,377	54,758	電気通信サービス	
VOLVO AB	492	575	7,194	89,998	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,931 33	9,088 31	113,770 -	1,423,266 <1.0%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
AIB GROUP PLC	259	301	114	14,746	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	293	361	213	27,489	銀行	
CRH PLC	266	310	743	95,958	素材	
KERRY GROUP PLC-A	50	58	539	69,616	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	25	31	256	33,020	消費者サービス	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	-	83	209	26,985	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	895 5	1,146 6	2,076 -	267,817 <0.2%>	
(ユーロ/オランダ)						
ABN AMRO GROUP NV-CVA	132	154	349	45,078	銀行	
AEGON NV	553	648	345	44,559	保険	
AIRBUS SE	182	213	1,980	255,485	資本財	
AKZO NOBEL NV	78	92	679	87,650	素材	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
	ALTICE NV - A-W/I	171	-	-	-	メディア
	ASML HOLDING NV	121	150	2,162	278,909	半導体・半導体製造装置
	BOSKALIS WESTMINSTER	27	-	-	-	資本財
	CNH INDUSTRIAL NV	322	373	316	40,821	資本財
	EXOR NV	34	39	201	26,037	各種金融
	FERRARI NV	38	45	429	55,388	自動車・自動車部品
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	337	394	567	73,149	自動車・自動車部品
	HEINEKEN HOLDING NV	36	42	329	42,477	食品・飲料・タバコ
	HEINEKEN NV	81	95	765	98,759	食品・飲料・タバコ
	ING GROEP NV-CVA	1,217	1,425	1,551	200,142	銀行
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	401	456	1,044	134,710	食品・生活必需品小売り
	KONINKLIJKE DSM NV	56	66	516	66,670	素材
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	295	344	1,127	145,478	ヘルスケア機器・サービス
	NN GROUP NV	95	109	416	53,725	保険
	QIAGEN NV	68	82	246	31,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	RANDSTAD NV	37	43	182	23,523	商業・専門サービス
	RELX NV	303	-	-	-	商業・専門サービス
	ROYAL KPN NV	1,101	1,299	312	40,361	電気通信サービス
	STMICROELECTRONICS NV	200	252	308	39,763	半導体・半導体製造装置
	UNILEVER NV	511	565	2,755	355,348	家庭用品・パーソナル用品
	VOPAK	21	25	100	12,948	エネルギー
	WOLTERS KLUWER NV	90	106	552	71,238	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,518	7,028	17,242	2,223,972	
(ユーロ/ベルギー)						
	AGEAS	58	66	295	38,062	保険
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	239	279	1,911	246,516	食品・飲料・タバコ
	COLRUYT NV	17	21	122	15,758	食品・生活必需品小売り
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	24	29	235	30,385	各種金融
	KBC GROEP NV	78	91	568	73,338	銀行
	PROXIMUS	51	60	142	18,347	電気通信サービス
	SOLVAY SA	23	27	275	35,536	素材
	TELENET GROUP HOLDING NV	17	20	88	11,439	メディア
	UCB SA	39	46	351	45,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	UMICORE	65	76	312	40,248	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	616	720	4,302	554,924	
		10	10	-	<0.4%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELORMITTAL		207	244	530	68,389	素材
RTL GROUP		12	14	76	9,855	メディア
TENARIS SA		147	172	209	26,998	エネルギー
小計	株数・金額	367	432	815	105,243	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.1%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		58	71	277	35,735	消費者サービス
ADP		10	12	214	27,604	運輸
AIR LIQUIDE		134	158	1,666	214,945	素材
ALSTOM RGPT		48	59	227	29,302	資本財
AMUNDI SA		18	23	113	14,596	各種金融
ARKEMA		21	26	229	29,662	素材
ATOS SE		29	35	252	32,591	ソフトウェア・サービス
AXA		607	714	1,549	199,874	保険
BIOMERIEUX		12	16	103	13,393	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		352	413	1,873	241,677	銀行
BOLLORE		301	376	145	18,795	運輸
BOUYGUES		67	82	270	34,928	資本財
BUREAU VERITAS SA		84	103	199	25,732	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		50	59	610	78,788	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		182	215	374	48,283	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON		16	21	81	10,525	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		156	185	579	74,763	資本財
CNP ASSURANCES		54	70	142	18,328	保険
CREDIT AGRICOLE SA		357	427	465	60,066	銀行
DANONE		189	227	1,474	190,145	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		0.80	0.97	131	16,902	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		40	48	513	66,241	ソフトウェア・サービス
EDENRED		70	88	290	37,415	商業・専門サービス
EDF		181	220	329	42,494	公益事業
EIFFAGE		23	31	272	35,127	資本財
ENGIE		574	681	830	107,181	公益事業
ESSILORLUXOTTICA		65	77	889	114,730	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO		14	18	123	15,959	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC		3	4	165	21,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		56	67	125	16,176	メディア
FAURECIA		23	29	115	14,948	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR		162	195	214	27,649	運輸
HERMES INTERNATIONAL		10	11	570	73,604	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ILIAD SA	8	10	112	14,512	電気通信サービス
IMERYS SA	11	14	73	9,531	素材
INGENICO GROUP	18	22	141	18,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	11	14	170	22,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	23	31	89	11,594	メディア
KERING	23	27	1,068	137,778	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.	37	-	-	-	メディア
LEGRAND SA	83	100	531	68,534	資本財
L'OREAL SA	79	93	1,915	247,042	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	87	102	2,651	341,937	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	53	63	565	72,993	自動車・自動車部品
NATIXIS	296	368	181	23,376	各種金融
ORANGE S.A.	636	756	1,109	143,045	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	66	78	1,103	142,354	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	183	217	429	55,421	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	65	78	414	53,473	メディア
REMY COINTREAU	7	8	91	11,787	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	60	71	419	54,153	自動車・自動車部品
REXEL SA	95	115	117	15,124	資本財
SAFRAN SA	104	123	1,328	171,369	資本財
SANOFI	356	413	3,245	418,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	177	201	1,279	165,002	資本財
SCOR REGROUPE	53	63	266	34,399	保険
SEB SA	7	8	102	13,253	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA	8	10	95	12,267	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE	240	283	936	120,734	銀行
SODEXO	28	33	309	39,881	消費者サービス
SUEZ	118	145	192	24,869	公益事業
TELEPERFORMANCE	18	21	310	40,097	商業・専門サービス
THALES SA	33	40	440	56,862	資本財
TOTAL SA	753	879	4,355	561,810	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	19	29	198	25,570	ソフトウェア・サービス
VALEO SA	75	89	221	28,583	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	152	205	378	48,881	公益事業
VINCI SA	159	187	1,440	185,800	資本財
VIVENDI SA	326	386	836	107,904	メディア
WENDEL	9	11	123	15,877	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,478 70	10,086 69	42,674 -	5,504,213 <3.7%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
1 AND 1 DRILLISCH AG	17	20	89	11,519	電気通信サービス
ADIDAS AG	59	69	1,385	178,730	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	139	161	3,038	391,913	保険
AXEL SPRINGER SE	15	18	108	14,004	メディア
BASF SE	287	336	2,320	299,291	素材
BAYER AG	259	333	2,080	268,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	103	121	901	116,276	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	17	19	129	16,689	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	31	36	336	43,415	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	48	56	237	30,625	資本財
COMMERZBANK AG	333	367	298	38,497	銀行
CONTINENTAL AG	34	40	546	70,454	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	50	70	392	50,578	素材
DAIMLER AG	302	333	1,680	216,762	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE	-	33	109	14,148	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BANK AG	530	719	616	79,510	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG	60	70	788	101,759	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	75	88	179	23,109	運輸
DEUTSCHE POST AG	309	367	1,033	133,256	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,055	1,236	1,875	241,897	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	111	133	544	70,268	不動産
E.ON SE	692	810	746	96,253	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	50	59	152	19,713	素材
FRAPORT AG	14	17	112	14,461	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	130	152	785	101,311	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	21	25	100	12,980	素材
GEA GROUP AG	57	63	163	21,108	資本財
HANNOVER RUECK SE	18	21	264	34,052	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	46	54	322	41,628	素材
HENKEL AG & CO KGAA	32	37	336	43,426	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	55	65	641	82,716	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	5	6	86	11,192	資本財
HUGO BOSS AG	19	23	141	18,229	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	355	415	710	91,595	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	43	51	206	26,659	公益事業
K+S AG	60	70	115	14,905	素材
KION GROUP AG	22	25	131	17,004	資本財
LANXESS	28	31	162	20,995	素材
LINDE AG - TENDER	58	-	-	-	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ/ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MAN SE		10	-	-	-	資本財
MERCK KGAA		40	47	458	59,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG		54	64	92	11,936	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG		16	18	342	44,169	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		48	54	1,041	134,285	保険
OSRAM LICHT AG		31	36	117	15,096	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		47	55	320	41,294	自動車・自動車部品
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG		73	87	151	19,520	メディア
PUMA AG		1	3	133	17,195	耐久消費財・アパレル
RWE AG		163	190	368	47,498	公益事業
SAP SE		308	359	3,201	412,905	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		-	13	148	19,205	ヘルスケア機器・サービス
SCHAEFFLER AG		50	60	47	6,152	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		239	280	2,800	361,242	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		-	54	201	25,989	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG		38	45	322	41,572	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		245	291	100	12,936	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		137	159	257	33,196	素材
UNIPER SE		61	73	190	24,620	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		38	44	172	22,313	ソフトウェア・サービス
VOLKSWAGEN AG		10	11	158	20,419	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		58	68	1,006	129,761	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		152	181	766	98,837	不動産
WIRECARD AG		36	42	591	76,297	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE		34	40	111	14,382	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,457 61	8,853 62	36,975 -	4,769,157 <3.2%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		748	949	292	37,722	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		156	182	265	34,255	エネルギー
JERONIMO MARTINS		78	91	97	12,525	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	983 3	1,223 3	655 -	84,502 <0.1%>	
(ユーロ/スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		74	93	309	39,922	資本財
AENA SME SA		22	26	351	45,321	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		137	160	1,057	136,432	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		2,087	2,438	1,197	154,409	銀行
BANCO DE SABADELL SA		1,670	2,046	235	30,351	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	4	5	724	81,630	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	12	15	1,719	193,726	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	3	473	53,317	
PROLOGIS INC	16	23	1,572	177,139	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	35	41	417	47,029	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	5	968	109,111	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	3	325	36,694	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4	5	289	32,586	
DUKE REALTY CORP	11	13	383	43,173	
EQUITY RESIDENTIAL	11	13	952	107,296	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	2	636	71,689	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	2	359	40,475	
GGP INC	18	—	—	—	
HCP INC	14	17	503	56,687	
WELLTOWER INC	11	13	969	109,273	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	23	27	529	59,626	
KIMCO REALTY CORP	13	15	247	27,898	
LIBERTY PROPERTY TRUST	4	5	248	28,024	
MACERICH CO/THE	3	4	199	22,487	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	4	433	48,876	
PUBLIC STORAGE	4	5	1,233	138,936	
REGENCY CENTERS CORP	4	5	365	41,184	
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	11	2,138	240,969	
SL GREEN REALTY CORP	3	3	311	35,088	
UDR INC	8	10	422	47,638	
VENTAS INC	11	13	817	92,119	
VORNADO REALTY TRUST	5	6	460	51,859	
REALTY INCOME CORP	8	10	682	76,925	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	4	452	50,927	
DIGITAL REALTY TRUST INC	6	7	854	96,245	
IRON MOUNTAIN INC	8	10	341	38,521	
AGNC INVESTMENT CORP	11	16	294	33,163	
AMERICAN TOWER REIT INC	13	16	2,706	304,929	
EQUINIX INC	2	2	1,127	127,024	
VEREIT	30	36	277	31,232	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	9	—	—	—	
COLONY CAPITAL INC	15	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	3	4	743	83,746	
INVITATION HOMES INC	9	11	250	28,183	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	8	160	18,129	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	378 39	413 37	25,593 —	2,883,569 <1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		2	3	103	8,839
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		4	6	136	11,670
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5	6	168	14,446
小計	□数・金額	11	16	408	34,956
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		35	43	440	36,234
GPT GROUP		63	79	419	34,533
GOODMAN GROUP		61	65	680	55,963
STOCKLAND		85	103	374	30,834
WESTFIELD CORP		64	—	—	—
MIRVAC GROUP		130	159	350	28,861
VICINITY CENTRES		116	142	381	31,335
SCENTRE GROUP		176	214	828	68,168
小計	□数・金額	733	808	3,477	285,930
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		69	80	5,895	84,773
小計	□数・金額	69	80	5,895	84,773
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		79	98	250	20,614
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		77	102	174	14,373
CAPITALAND MALL TRUST		78	98	216	17,779
SUNTEC REIT		80	85	152	12,490
小計	□数・金額	315	385	794	65,258
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		29	35	210	30,496
HAMMERSON PLC		25	29	125	18,200
LAND SECURITIES GROUP PLC		23	28	240	34,824
SEGRO PLC		31	38	238	34,546
小計	□数・金額	109	133	815	118,068
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年11月20日現在)

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

(注1) 期首元本額	76,045,712,874円
期中追加設定元本額	19,369,725,952円
期中一部解約元本額	6,819,262,947円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	562,227,597円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,650,340,512円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	2,084,617,874円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ (適格機関投資家限定)	11,709,845,155円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	60,295,944,002円
DCニッセイ外国株式インデックス	10,792,141,547円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	406,450,400円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	13,254,832円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	9,183,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	7,256,656円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	10,766,461円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,134,713円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	14,090,128円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	23,703,740円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	1,668,453円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	602,496円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	8,947,629円

損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

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

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 24 期

(計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日)

運用方針

主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

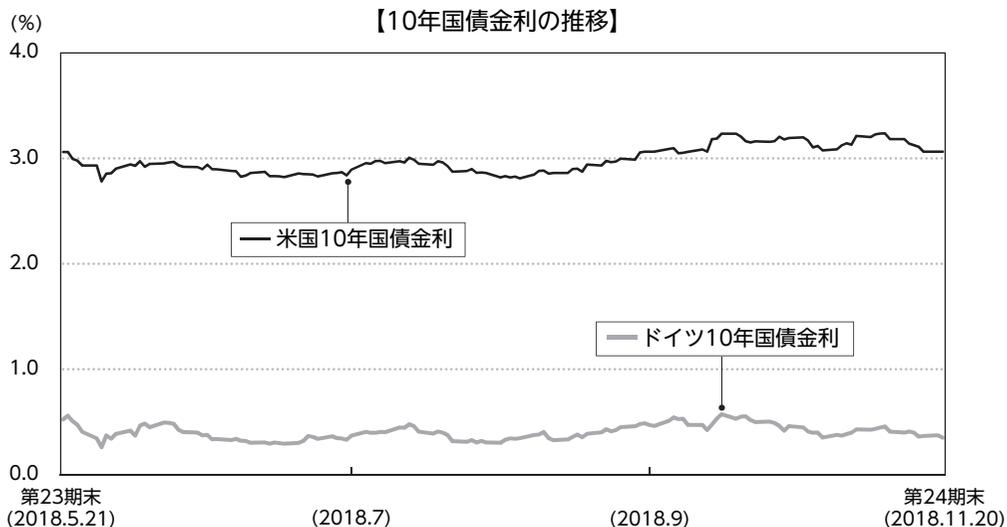
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

投資環境

海外債券市況

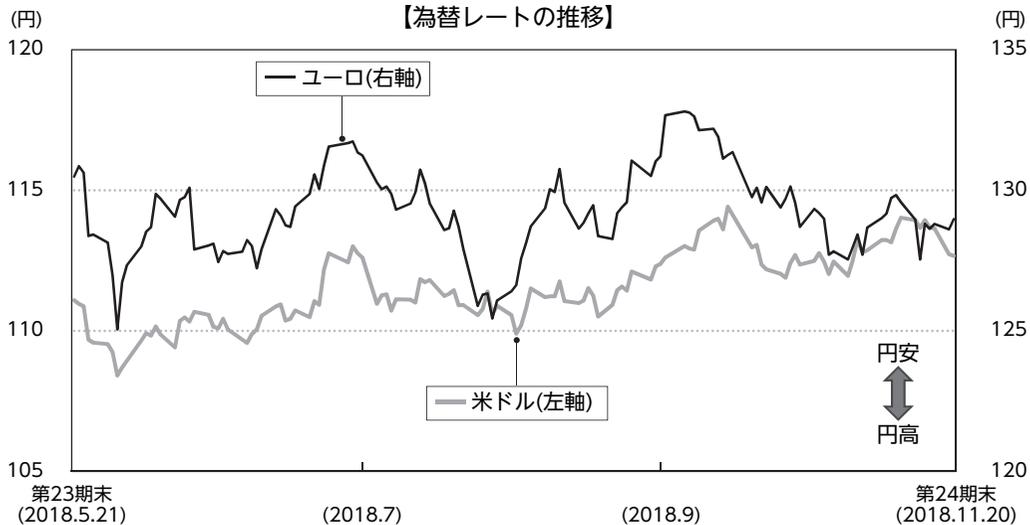


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

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

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

■為替市況

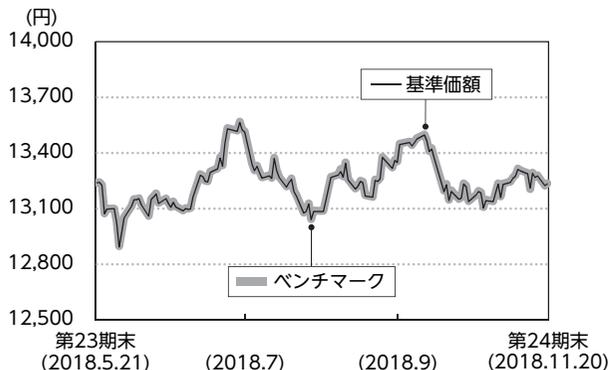


(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは上昇しました。米中貿易摩擦に対する懸念や世界的な株価下落などを受けて下落する場面もありましたが、堅調な米経済指標等を背景に、米ドルは上昇基調となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、イタリアの財政や米中貿易摩擦への懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やイギリスの欧州連合（EU）離脱交渉の進展期待の高まりが上昇要因となりましたが、ユーロはおおむね下落傾向で推移しました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

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

(注) ベンチマークはF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。以下同じです。

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-0.0%となり、ベンチマーク騰落率（-0.0%）に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
20期(2016年11月21日)	12,470	△3.7	12,576	△3.7	98.7	10,062
21期(2017年5月22日)	13,045	4.6	13,165	4.7	98.8	11,666
22期(2017年11月20日)	13,528	3.7	13,656	3.7	98.8	13,064
23期(2018年5月21日)	13,240	△2.1	13,369	△2.1	99.1	16,026
24期(2018年11月20日)	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1	17,768

(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、設定時を10,000として、指数化しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018年11月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,235円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2018年5月22日～2018年11月20日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2018年5月22日～2018年11月20日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY	111,525	US TREASURY	130,876
US TREASURY	98,331	US TREASURY	120,319
US TREASURY	92,556	US TREASURY	115,432
US TREASURY	74,936	US TREASURY	102,124
US TREASURY	72,063	US TREASURY	97,022
US TREASURY	71,012	US TREASURY	87,574
US TREASURY	67,901	FRANCE (GOVT OF)	52,419
US TREASURY	66,494	UK TSY 1 3/4% 2019	51,132
US TREASURY	54,405	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,165
US TREASURY	51,691	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	28,236

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2018年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	73,750	71,862	8,096,694	45.6	—	18.4	17.6	9.6
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	4,070	4,223	361,158	2.0	—	0.9	0.6	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	4,290	4,514	371,210	2.1	—	1.3	0.6	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	830	848	69,712	0.4	—	0.2	0.1	0.0
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	6,740	8,091	1,171,742	6.6	—	4.8	1.3	0.5
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	5,190	6,293	108,751	0.6	—	0.4	0.1	0.1

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末								
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ノルウェー	千ルウェー・クローネ 3,040	千ルウェー・クローネ 3,123	千円 41,482	% 0.2	% -	% 0.1	% 0.1	% -	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 4,710	千スウェーデン・クローナ 5,269	65,923	0.4	-	0.2	0.2	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 26,020	千メキシコ・ペソ 24,522	135,853	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 3,200	千マレーシア・リンギット 3,167	85,214	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 14,090	千南アフリカ・ランド 12,694	101,812	0.6	-	0.5	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,360	千ポーランド・ズロチ 3,532	105,223	0.6	-	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	980	1,063	137,112	0.8	-	0.5	0.1	0.1
	オランダ	2,480	2,880	371,548	2.1	-	1.3	0.6	0.2
	ベルギー	2,850	3,334	430,031	2.4	-	1.7	0.5	0.1
	フランス	12,180	13,965	1,801,301	10.1	-	6.3	2.8	1.0
	ドイツ	8,230	9,502	1,225,689	6.9	-	3.9	2.0	1.0
	スペイン	7,100	8,029	1,035,642	5.8	-	3.7	1.4	0.7
	イタリア	11,690	11,850	1,528,414	8.6	-	4.8	2.8	1.1
	フィンランド	780	845	109,044	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	1,730	2,012	259,576	1.5	-	0.9	0.4	0.1	
合計	-	-	17,613,140	99.1	-	51.3	32.1	15.7	

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	430	414	46,652
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	430	404	45,527
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	80	104	11,752
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	160	187	21,111
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	140	164	18,508
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	150	161	18,148
小計		-	-	-	-	8,096,694
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	40	44	3,764
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2019/11/01	130	129	11,034
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2020/02/01	130	128	11,005
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2020/03/01	210	208	17,816
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/05/01	110	109	9,352
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2020/06/01	120	122	10,467
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/08/01	100	99	8,488
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2020/09/01	250	243	20,842
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2020/11/01	100	99	8,517
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/03/01	230	222	19,026
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2021/06/01	120	122	10,515
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/09/01	190	182	15,599
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2022/03/01	140	132	11,309
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/06/01	130	132	11,296
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2022/09/01	140	133	11,424
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2023/03/01	140	137	11,716
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/06/01	120	116	9,921
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/09/01	120	118	10,131
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	30	29	2,559
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	130	131	11,230
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	110	109	9,364
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	120	113	9,669
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	150	134	11,496
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/06/01	40	57	4,906
CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	120	116	9,950	
CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	50	49	4,229	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	100	131	11,222	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	110	155	13,257	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	120	165	14,179
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	140	177	15,187
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	160	193	16,552
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	140	149	12,798
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	30	27	2,321
小計		-	-	-	-	361,158
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2020/04/15	230	237	19,558
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/11/21	250	248	20,440
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/05/15	280	304	25,066
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	160	159	13,107
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	230	258	21,283
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	130	130	10,702
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	230	261	21,481
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	250	254	20,952
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	250	261	21,516
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	300	334	27,525
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	280	325	26,763
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	260	262	21,574
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	250	241	19,853
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	240	241	19,882
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	200	210	17,310
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	150	150	12,407
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	80	78	6,443
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	130	155	12,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	60	58	4,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	110	121	9,993
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	70	71	5,913	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	40	37	3,092	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	110	106	8,735	
小計		-	-	-	-	371,210
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2020/09/01	100	102	8,387
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/06/01	80	80	6,601
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	80	82	6,806
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	110	112	9,258
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	50	51	4,268
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	30	30	2,472

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千シンガポールドル	千円
シンガポール		%		千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	50	49	4,041
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	70	75	6,232
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	40	40	3,344
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	10	10	848
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	40	41	3,383
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	50	54	4,447
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	30	28	2,302
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	40	39	3,264
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	50	49	4,053
小計		-	-	-	-	69,712
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	3.7500	2020/09/07	170	179	25,961
	UK TREASURY	3.7500	2021/09/07	140	151	21,960
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	180	249	36,098
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	180	269	38,963
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	200	273	39,592
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	160	239	34,616
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	130	163	23,674
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	150	198	28,721
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	140	196	28,518
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	160	227	32,968
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	160	260	37,667
	UK TREASURY	4.7500	2020/03/07	170	178	25,904
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	130	176	25,597
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	120	132	19,209
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	140	225	32,653
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	140	208	30,122
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	150	186	26,962
	UK TREASURY	8.0000	2021/06/07	120	142	20,580
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	100	144	20,856
	UK TREASURY	1.5000	2021/01/22	240	244	35,356
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	170	174	25,237
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	210	189	27,454
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	220	219	31,791
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	150	153	22,221
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	100	92	13,340
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	80	80	11,589
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	220	227	32,976

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	千円
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	30	28	4,151	
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	150	144	20,952	
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	160	170	24,643	
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	120	131	19,101	
	UK TREASURY	2.0000	2020/07/22	240	245	35,514	
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	160	169	24,588	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	160	244	35,338	
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	220	276	40,023	
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	140	204	29,545	
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	210	275	39,939	
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	130	200	28,998	
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	240	237	34,400	
	UK TREASURY	0.7500	2023/07/22	250	248	35,940	
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	130	127	18,495	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	170	203	29,510	
小計		-	-	-	-	1,171,742	
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0000	2019/11/15	720	753	13,018	
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2020/11/15	410	417	7,206	
	KINGDOM OF DENMARK	3.0000	2021/11/15	830	916	15,844	
	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	490	531	9,176	
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	720	803	13,880	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	830	842	14,552	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	1,190	2,029	35,072	
小計		-	-	-	-	108,751	
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.7500	2021/05/25	790	838	11,136	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/05/24	650	663	8,806	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	420	449	5,965	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	310	310	4,123	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	320	313	4,166	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	340	337	4,476	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	210	211	2,806	
小計		-	-	-	-	41,482	
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0000	2020/12/01	880	977	12,229	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/06/01	940	1,062	13,290	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	760	815	10,202	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千スイーデン・クローナ	千円
スウェーデン		%		千スイーデン・クローナ	千円	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	520	595	7,450
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	620	648	8,114
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	560	568	7,115
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	430	601	7,519
小計		-	-	-	-	65,923
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千円	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2019/12/11	1,980	1,910	10,582
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2020/06/11	2,570	2,551	14,134
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2021/06/10	3,300	3,141	17,404
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	2,550	2,380	13,185
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	1,670	1,619	8,970
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	2,490	2,625	14,547
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	1,490	1,239	6,865
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	2,400	2,186	12,115
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	840	806	4,466
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	1,450	1,291	7,154
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	720	628	3,480
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	900	954	5,290
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	1,230	1,132	6,272
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	1,830	1,539	8,528
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	600	515	2,856
小計		-	-	-	-	135,853
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千円	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3780	2019/11/29	260	262	7,058
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/07/31	270	271	7,304
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1600	2021/07/15	310	314	8,447
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	280	276	7,437
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	280	275	7,418
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	210	211	5,687
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	200	198	5,330
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	120	121	3,277
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	60	58	1,581
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	250	244	6,574
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	80	77	2,080
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	110	110	2,960
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	120	117	3,148
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/04/15	30	28	773
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	200	184	4,953

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
マレーシア		%		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	70	65	1,769
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	110	109	2,933
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	100	99	2,676
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	80	76	2,063
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.2480	2028/09/15	60	64	1,734
小計		-	-	-	-	85,214
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.2500	2020/01/15	260	262	2,106
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/03/31	450	443	3,557
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/02/28	840	820	6,580
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	2,030	2,186	17,537
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/01/31	1,240	1,109	8,901
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/02/28	1,020	831	6,666
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/03/31	830	741	5,943
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/02/28	810	746	5,988
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/03/31	890	630	5,056
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/01/31	1,140	1,007	8,078
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/01/31	730	668	5,361
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/02/28	860	596	4,780
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/01/31	1,260	1,118	8,967
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/02/28	1,730	1,531	12,285
小計		-	-	-	-	101,812
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2020/04/25	280	280	8,342
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.2500	2020/10/25	330	353	10,516
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	590	655	19,517
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	420	473	14,120
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	550	588	17,543
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	330	337	10,059
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	350	337	10,051
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	300	285	8,502
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	140	134	4,016
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	70	85	2,552
小計		-	-	-	-	105,223
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド						
国債証券	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	70	72	9,301
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	100	102	13,165
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	40	38	5,016

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	17,915,615,404円
コーポレート債(評価額)	132,034,626
未収入金	17,613,140,774
未収利息	49,636,345
前払費用	113,252,488
(B)負債	146,922,591
未払金	128,197,594
未払解約金	18,722,533
その他未払費用	7,551,171
(C)純資産総額(A-B)	17,768,692,813
元本	13,426,526,479
次期繰越損益金	4,342,166,334
(D)受益権総口数	13,426,526,479口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,234円

(注1)	期首元本額	12,105,288,821円
	期中追加設定元本額	2,723,768,228円
	期中一部解約元本額	1,402,530,570円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。	
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	1,461,969,133円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,584,015,447円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	903,148,588円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	7,278,919,564円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	528,387,080円
	D Cニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円
	D Cニッセイターゲットデットファンド2055	5,967,897円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	59,712,782円
	D Cニッセイターゲットデットファンド2045	3,292,189円
	D Cニッセイターゲットデットファンド2035	4,935,002円
	D Cニッセイターゲットデットファンド2025	2,849,336円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	18,318,542円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	1,959,566円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	11,639,679円

損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	205,719,770円
受取利息	205,757,393
支払利息	△ 37,623
(B)有価証券売買損益	△ 200,798,492
売買益	180,386,988
売買損	△ 381,185,480
(C)信託報酬等	△ 3,607,130
(D)当期損益金(A+B+C)	1,314,148
(E)前期繰越損益金	3,921,668,054
(F)追加信託差損益金	879,729,378
(G)解約差損益金	△ 460,545,246
(H)合計(D+E+F+G)	4,342,166,334
次期繰越損益金(H)	4,342,166,334

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