

第6期末 (2019年11月20日)

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 16,829円 |
| 純資産総額 | 1,432億円 |
| 騰落率   | 12.4%   |
| 分配金   | 0円      |

# <購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド

追加型投信／海外／株式／インデックス型

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2018年11月21日～2019年11月20日

第6期(決算日 2019年11月20日)

### 受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第6期の決算を行いました。

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

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

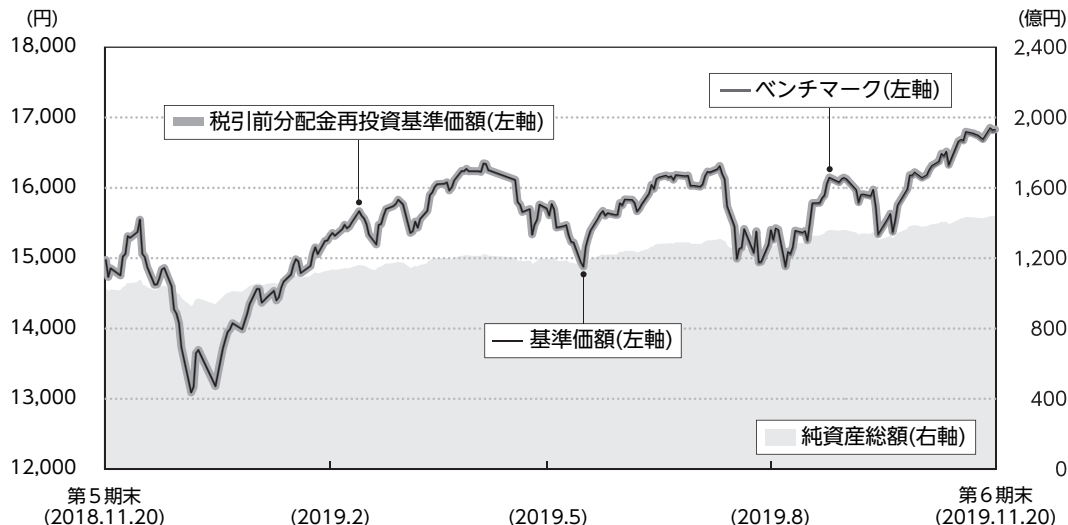
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2018年11月21日～2019年11月20日

## 基準価額等の推移



|      |         |                 |       |
|------|---------|-----------------|-------|
| 第6期首 | 14,973円 | 既払分配金           | 0円    |
| 第6期末 | 16,829円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 12.4% |

(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) ベンチマークは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。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ■基準価額の主な変動要因

### <上昇要因>

- ・2019年1月以降、堅調な企業決算や米中通商協議の進展期待等を受けて海外株式市場が上昇基調となったこと
- ・10月以降、米連邦公開市場委員会（FOMC）における追加利下げ決定および金利の据え置き見通しなどをを受けて海外株式市場が上昇基調となったこと

### <下落要因>

- ・2018年末から2019年始めに米中関係の悪化やグローバルマクロ経済の減速懸念、米金利の逆イールド（長短金利の逆転）や米政府閉鎖懸念等を受けて海外株式市場が軟調に推移したこと

## 1万口当たりの費用明細

| 項目         | 第6期  |         | 項目の概要  |
|------------|------|---------|--|
|            | 金額   | 比率      |  |
| 信託報酬       | 18円  | 0.113%  | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は15,508円です。 |
| (投信会社)     | ( 7) | (0.044) | ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価   |
| (販売会社)     | ( 7) | (0.048) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価  |
| (受託会社)     | ( 3) | (0.022) | 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    | 0.003   |  |
| (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    | 2    | 0.012   |  |
| (株式)       | ( 2) | (0.012) | 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    | 0.045   | 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)     | ( 6) | (0.040) | 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)     | ( 0) | (0.001) | 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用   |
| (その他)      | ( 1) | (0.004) | ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用<br>・ 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         | 27   | 0.174   |  |

(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。

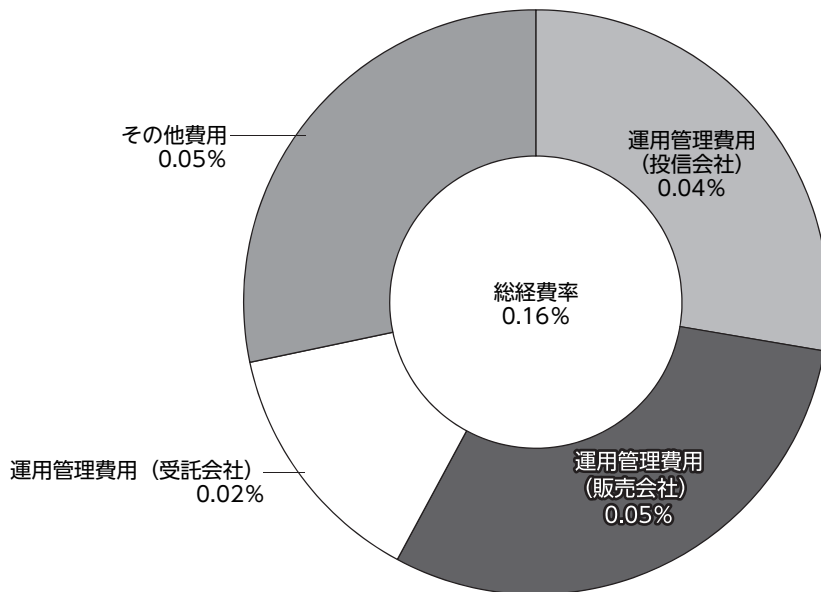
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.16%**です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

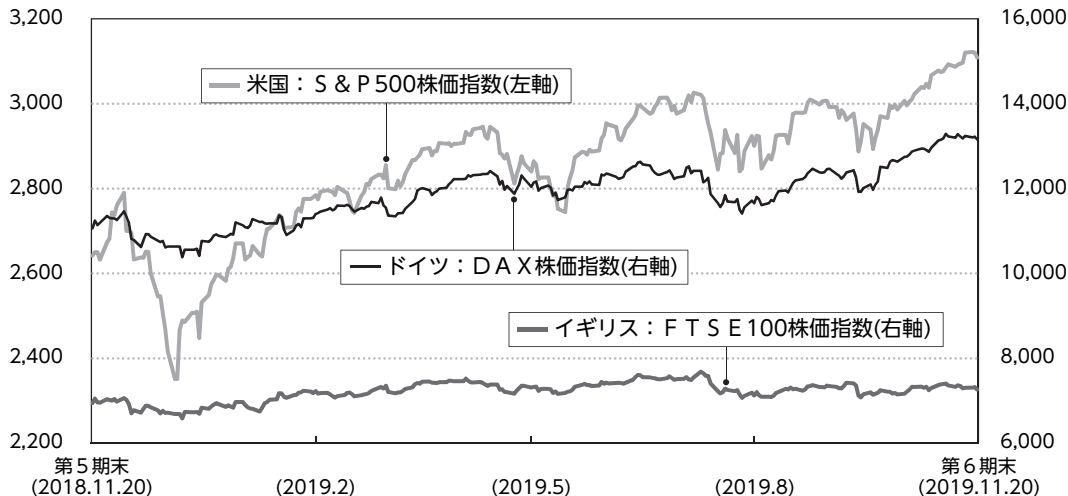
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は上昇しました。

期初以降、米中関係の悪化やグローバルマクロ経済の減速懸念、米金利の逆イールドや米政府閉鎖懸念などを背景に、海外株式市場は大幅に下落しましたが、2019年1月以降は、堅調な企業決算や米中通商協議の進展期待等から上昇基調が継続しました。5月になると米中間の緊張感が高まったことから一時下落する展開となりましたが、6月末の米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことや米国の利下げ期待から海外株式市場は上昇しました。8月になると米国による対中追加関税の発表や中国の報復措置等を受けて再び下落しましたが、10月以降は米中貿易交渉の進展期待や市場予想を上回る決算内容、また、FOMCにおける追加利下げ決定および今後の金利据え置き見通しを背景に上昇する展開となり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

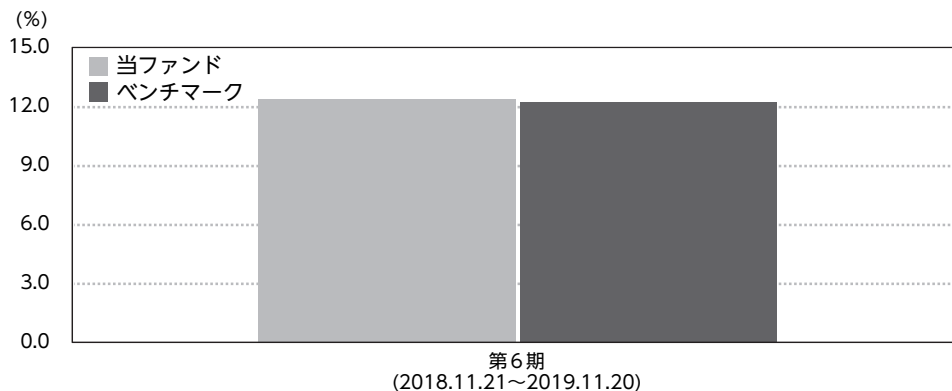
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

日本を除く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。

\*ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+12.4%となり、ベンチマーク騰落率（+12.3%）にほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金

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

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

### 【分配原資の内訳（1万口当たり）】

| 項目         | 当期<br>2018年11月21日～2019年11月20日 |
|------------|-------------------------------|
| 当期分配金(税引前) | —                             |
| 対基準価額比率    | —                             |
| 当期の収益      | —                             |
| 当期の収益以外    | —                             |
| 翌期繰越分配対象額  | 6,829円                        |

(注1) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り捨てで算出しているため、合計が当期分配金と一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 今後の運用方針

### ■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く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。

### ■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。

# ファンドデータ

## 当ファンドの組入資産の内容

### ■組入ファンド

|                           | 第6期末<br>2019年11月20日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド | 100.0%              |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

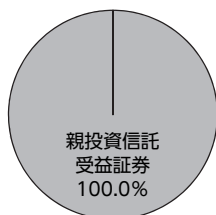
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

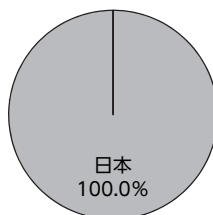
| 項目         | 第6期末<br>2019年11月20日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額      | 143,238,909,972円    |
| 受益権総口数     | 85,111,936,866口     |
| 1万口当たり基準価額 | 16,829円             |

(注) 当期間中における追加設定元本額は34,562,497,368円、同解約元本額は17,501,726,293円です。

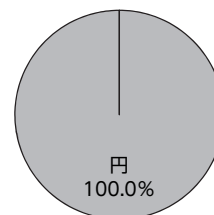
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

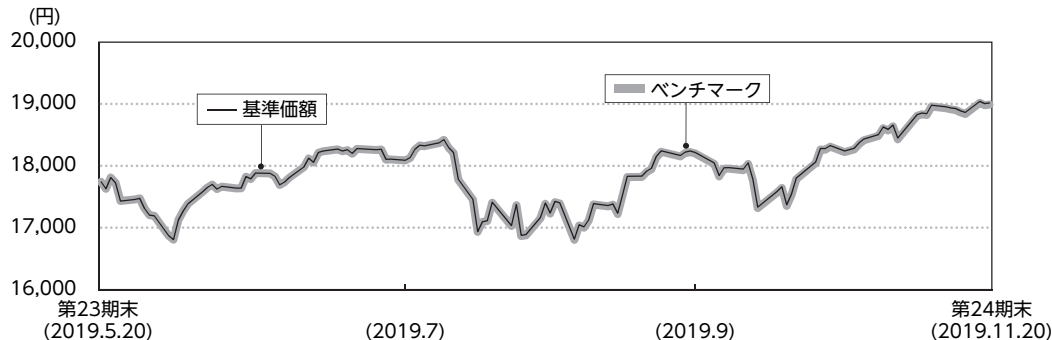


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2019年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



## ニッセイ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) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 上位銘柄

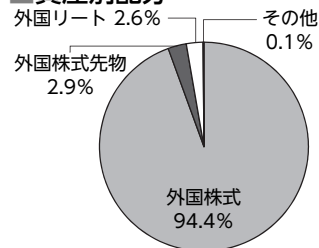
| 銘柄名                     | 通貨      | 比率    |
|-------------------------|---------|-------|
| APPLE INC               | 米ドル     | 3.0%  |
| MICROSOFT CORP          | 米ドル     | 2.7%  |
| AMAZON.COM INC          | 米ドル     | 1.8%  |
| FACEBOOK INC-A          | 米ドル     | 1.2%  |
| JPMORGAN CHASE & CO     | 米ドル     | 1.0%  |
| ALPHABET INC-CL C       | 米ドル     | 1.0%  |
| ALPHABET INC-CL A       | 米ドル     | 1.0%  |
| JOHNSON & JOHNSON       | 米ドル     | 0.9%  |
| NESTLE SA               | スイス・フラン | 0.8%  |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 米ドル     | 0.8%  |
| 組入銘柄数                   |         | 1,318 |

### ■ 1万口当たりの費用明細

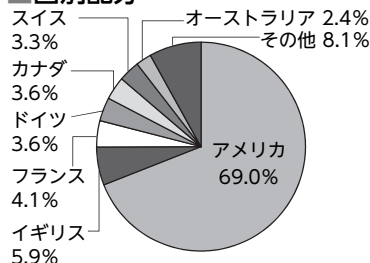
2019.5.21~2019.11.20

| 項目         | 金額  |
|------------|-----|
| 売買委託手数料    | 0円  |
| (株式)       | (0) |
| (先物・オプション) | (0) |
| (投資信託証券)   | (0) |
| 有価証券取引税    | 1   |
| (株式)       | (1) |
| (投資信託証券)   | (0) |
| その他費用      | 4   |
| (保管費用)     | (3) |
| (その他)      | (0) |
| 合計         | 5   |

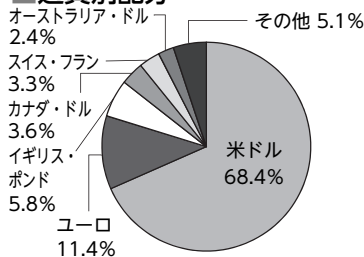
### ■ 資産別配分



### ■ 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<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考)          | ベンチ<br>マーク | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|----------------|------------|-----------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                 |               |            |           | 基準価額+<br>累計分配金 |            |           |            |            |                    |           |
|                 | 円             | 円          | %         | 円              |            | %         | %          | %          | %                  | 百万円       |
| 2期(2015年11月20日) | 12,964        | 0          | 3.5       | 12,964         | 13,046     | 3.6       | 93.7       | 3.6        | 2.4                | 19,029    |
| 3期(2016年11月21日) | 11,931        | 0          | △ 8.0     | 11,931         | 12,033     | △ 7.8     | 94.1       | 3.5        | 2.4                | 35,666    |
| 4期(2017年11月20日) | 14,711        | 0          | 23.3      | 14,711         | 14,834     | 23.3      | 94.3       | 2.1        | 2.4                | 68,498    |
| 5期(2018年11月20日) | 14,973        | 0          | 1.8       | 14,973         | 15,091     | 1.7       | 94.2       | 3.3        | 2.4                | 101,893   |
| 6期(2019年11月20日) | 16,829        | 0          | 12.4      | 16,829         | 16,939     | 12.3      | 94.4       | 2.9        | 2.6                | 143,238   |

(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(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(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」、「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   | ベンチ<br>マーク | 騰落率   | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|-----------------|--------|-------|------------|-------|------------|------------|--------------------|
|                 |        |       |            |       |            |            |                    |
| (期首)2018年11月20日 | 14,973 | -     | 15,091     | -     | 94.2       | 3.3        | 2.4                |
| 11月末            | 15,290 | 2.1   | 15,410     | 2.1   | 95.3       | 1.9        | 2.4                |
| 12月末            | 13,695 | △ 8.5 | 13,802     | △ 8.5 | 94.8       | 2.5        | 2.5                |
| 2019年1月末        | 14,580 | △ 2.6 | 14,697     | △ 2.6 | 95.5       | 1.9        | 2.5                |
| 2月末             | 15,452 | 3.2   | 15,574     | 3.2   | 94.9       | 2.4        | 2.5                |
| 3月末             | 15,558 | 3.9   | 15,678     | 3.9   | 94.6       | 2.6        | 2.6                |
| 4月末             | 16,253 | 8.5   | 16,377     | 8.5   | 94.3       | 3.3        | 2.4                |
| 5月末             | 15,224 | 1.7   | 15,335     | 1.6   | 94.9       | 2.3        | 2.6                |
| 6月末             | 15,770 | 5.3   | 15,884     | 5.3   | 94.8       | 2.3        | 2.6                |
| 7月末             | 16,197 | 8.2   | 16,314     | 8.1   | 94.0       | 3.3        | 2.5                |
| 8月末             | 15,392 | 2.8   | 15,498     | 2.7   | 95.0       | 2.2        | 2.8                |
| 9月末             | 15,886 | 6.1   | 15,993     | 6.0   | 94.0       | 3.2        | 2.7                |
| 10月末            | 16,515 | 10.3  | 16,626     | 10.2  | 94.7       | 2.6        | 2.7                |
| (期末)2019年11月20日 | 16,829 | 12.4  | 16,939     | 12.3  | 94.4       | 2.9        | 2.6                |

(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11月21日～2019年11月20日

|                       | 設定         |            | 解約         |            |
|-----------------------|------------|------------|------------|------------|
|                       | 口数         | 金額         | 口数         | 金額         |
|                       | 千口         | 千円         | 千口         | 千円         |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 30,605,475 | 53,398,602 | 15,575,726 | 27,557,915 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

**株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合**

| 項目                | 当期                    |
|-------------------|-----------------------|
|                   | ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 46,149,416千円          |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 164,761,245千円         |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.28                  |

(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11月21日～2019年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

**親投資信託残高**

2019年11月20日現在

| 種類                    | 期首(前期末)    | 当期末        |             |
|-----------------------|------------|------------|-------------|
|                       | 口数         | 口数         | 評価額         |
|                       | 千口         | 千口         | 千円          |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 60,295,944 | 75,325,693 | 143,239,338 |

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は110,982,930千口です。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド

投資信託財産の構成

2019年11月20日現在

| 項目                    | 当期末         |       |
|-----------------------|-------------|-------|
|                       | 評価額         | 比率    |
|                       | 千円          | %     |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 143,239,338 | 99.5  |
| コール・ローン等、その他          | 686,628     | 0.5   |
| 投資信託財産総額              | 143,925,966 | 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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1ユーロ120.32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（207,877,451千円）の投資信託財産総額（212,007,217千円）に対する比率は98.1%です。
- (注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

| 項目                         | 当期末              |
|----------------------------|------------------|
| (A) 資産                     | 143,925,966,484円 |
| コール・ローン等                   | 69,893,042       |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 143,239,338,038  |
| 未収入金                       | 616,735,404      |
| (B) 負債                     | 687,056,512      |
| 未払解約金                      | 614,573,298      |
| 未払信託報酬                     | 71,776,311       |
| その他未払費用                    | 706,903          |
| (C) 純資産総額(A-B)             | 143,238,909,972  |
| 元本                         | 85,111,936,866   |
| 次期繰越損益金                    | 58,126,973,106   |
| (D) 受益権総口数                 | 85,111,936,866口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 16,829円          |

- (注) 期首元本額 68,051,165,791円  
 期中追加設定元本額 34,562,497,368円  
 期中一部解約元本額 17,501,726,293円

損益の状況

当期(2018年11月21日~2019年11月20日)

| 項目               | 当期                |
|------------------|-------------------|
| (A) 配当等収益        | △ 19,396円         |
| 受取利息             | 2,617             |
| 支払利息             | △ 22,013          |
| (B) 有価証券売買損益     | 14,358,878,617    |
| 売益               | 15,825,121,907    |
| 売損               | △ 1,466,243,290   |
| (C) 信託報酬等        | △ 137,175,846     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 14,221,683,375    |
| (E) 前期繰越損益金      | 5,458,288,676     |
| (分配準備積立金)        | ( 6,820,925,526)  |
| (繰越欠損金)          | (△ 1,362,636,850) |
| (F) 追加信託差損益金*    | 38,447,001,055    |
| (配当等相当額)         | ( 28,437,645,873) |
| (売買損益相当額)        | ( 10,009,355,182) |
| (G) 合計(D+E+F)    | 58,126,973,106    |
| 次期繰越損益金(G)       | 58,126,973,106    |
| 追加信託差損益金         | 38,447,001,055    |
| (配当等相当額)         | ( 28,520,048,093) |
| (売買損益相当額)        | ( 9,926,952,962)  |
| 分配準備積立金          | 19,679,972,051    |

- (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           | 2,633,328,380円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益       | 10,225,718,145円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金         | 38,447,001,055円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金       | 6,820,925,526円  |
| (e) 分配対象額 (a + b + c + d) | 58,126,973,106円 |
| (f) 分配対象額 (1万口当たり)        | 6,829.47円       |
| (g) 分配金                   | 0円              |
| (h) 分配金 (1万口当たり)          | 0円              |

# お知らせ

## ■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。  
(2019年2月21日)
- ・信託報酬率の上限引き下げに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。  
(2019年6月27日)

## ■関連会社の実質保有比率

2019年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の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10.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

## 当ファンドの概要

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

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 24 期

(計算期間：2019年5月21日～2019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）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

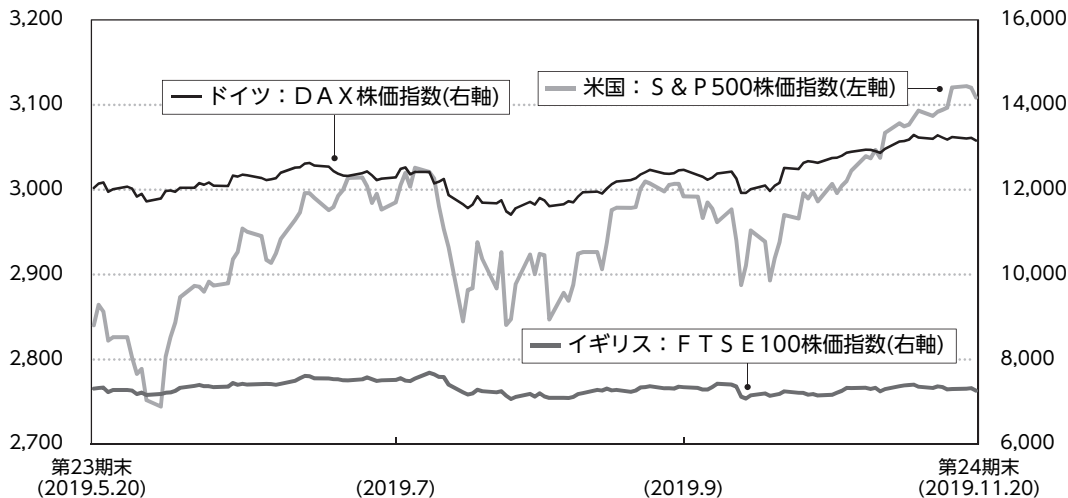


# 運用経過

2019年5月21日～2019年11月20日

## 海外株式市況

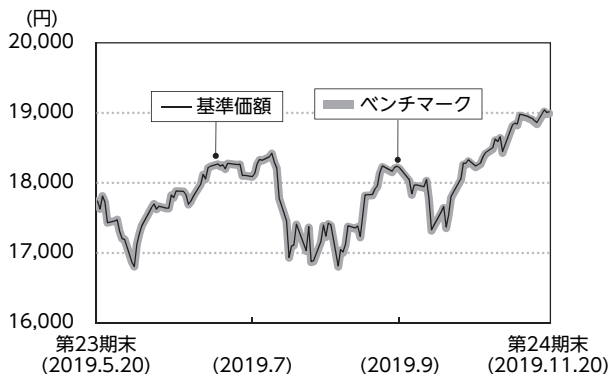
【海外主要株価指数の推移】



(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初以降、米連邦準備制度理事会（FRB）議長ら高官による利下げの可能性を示唆する発言や米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことを背景に、7月にかけて上昇基調で推移しました。8月になると米国による対中追加関税の発表や中国の報復措置等を受けて下落しましたが、10月以降は米中貿易交渉の進展期待や市場予想を上回る決算内容、また、米連邦公開市場委員会（FOMC）における追加利下げ決定および今後の金利据え置き見通しを背景に上昇する展開となり、結局、前期末と比較すると米国、ドイツは上昇、イギリスは若干の下落で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から7月にかけて、F R B高官による利下げの可能性を示唆する発言や米中首脳会談を経た対立緩和を好感したことを受けて海外株式市場が上昇基調となったこと
- ・ 10月以降、F O M Cにおける追加利下げ決定および金利の据え置き見通しなどを受けて海外株式市場が上昇基調となったこと

#### <下落要因>

- ・ 8月の米国による対中追加関税発表や中国の報復措置等を受けて海外株式市場が軟調に推移したこと

## 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+7.2%となり、ベンチマーク騰落率 (+7.1%) 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   |
|------------------|--------|------|--------|------|--------|--------|------------|---------|
|                  | 円      | 騰落率  | 騰落率    | 騰落率  |        |        |            |         |
| 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 |
| 23期(2019年5月20日)  | 17,740 | 5.0  | 17,404 | 4.9  | 94.7   | 2.5    | 2.5        | 172,115 |
| 24期(2019年11月20日) | 19,016 | 7.2  | 18,631 | 7.1  | 94.4   | 2.9    | 2.6        | 211,043 |

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日             | 基準価額   |      | ベンチマーク |      | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|-----------------|--------|------|--------|------|--------|--------|------------|
|                 | 円      | 騰落率  | 騰落率    | 騰落率  |        |        |            |
| (期首)2019年5月20日  | 17,740 | -    | 17,404 | -    | 94.7   | 2.5    | 2.5        |
| 5月末             | 17,193 | △3.1 | 16,867 | △3.1 | 94.9   | 2.3    | 2.6        |
| 6月末             | 17,811 | 0.4  | 17,470 | 0.4  | 94.8   | 2.3    | 2.6        |
| 7月末             | 18,295 | 3.1  | 17,944 | 3.1  | 94.0   | 3.3    | 2.5        |
| 8月末             | 17,388 | △2.0 | 17,046 | △2.1 | 94.9   | 2.2    | 2.8        |
| 9月末             | 17,947 | 1.2  | 17,590 | 1.1  | 94.0   | 3.2    | 2.7        |
| 10月末            | 18,660 | 5.2  | 18,287 | 5.1  | 94.7   | 2.6    | 2.7        |
| (期末)2019年11月20日 | 19,016 | 7.2  | 18,631 | 7.1  | 94.4   | 2.9    | 2.6        |

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2019年5月21日～2019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<br>(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<br>売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料                     |
| (先物・オプション)      | (0) | (0.001) |   |
| (投資信託証券)        | (0) | (0.000) |   |
|                 |     |         |   |
| 有価証券取引税<br>(株式) | 1   | 0.006   | 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<br>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<br>(保管費用) | 4   | 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<br>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)           | (3) | (0.019) |   |
|                 | (0) | (0.001) |   |
|                 |     |         | ・ 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<br>・ 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              | 5   | 0.029   |   |

(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（17,892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

2019年5月21日～2019年11月20日

## (1) 株式

|    | 買付       |                         | 売付                             |             |                       |
|----|----------|-------------------------|--------------------------------|-------------|-----------------------|
|    | 株数       | 金額                      | 株数                             | 金額          |                       |
| 外国 | アメリカ     | 百株<br>21,054<br>(△ 516) | 千米ドル<br>162,926<br>(△ 1,520)   | 百株<br>1,710 | 千米ドル<br>8,896         |
|    | カナダ      | 2,981<br>( 203)         | 千カナダ・ドル<br>13,237              | 939         | 千カナダ・ドル<br>1,109      |
|    | オーストラリア  | 5,376<br>(△ 1)          | 千オーストラリア・ドル<br>8,848<br>(△ 35) | 681         | 千オーストラリア・ドル<br>1,075  |
|    | 香港       | 6,416<br>( 449)         | 千香港ドル<br>23,796                | 860         | 千香港ドル<br>2,032        |
|    | シンガポール   | 2,825                   | 千シンガポール・ドル<br>1,397            | 37          | 千シンガポール・ドル<br>73      |
|    | ニュージーランド | 432                     | 千ニュージーランド・ドル<br>339            | 0.20        | 千ニュージーランド・ドル<br>0.096 |
|    | イギリス     | 20,763<br>( 39,133)     | 千イギリス・ポンド<br>12,804<br>(△ 62)  | 50,223      | 千イギリス・ポンド<br>567      |
|    | イスラエル    | 817                     | 千イスラエル・シェケル<br>1,878           | 899         | 千イスラエル・シェケル<br>225    |
|    | スイス      | 1,124                   | 千スイス・フラン<br>8,075<br>(△ 40)    | 6           | 千スイス・フラン<br>52        |
|    | デンマーク    | 289                     | 千デンマーク・クローネ<br>12,108          | 63          | 千デンマーク・クローネ<br>1,667  |
|    | ノルウェー    | 365                     | 千ノルウェー・クローネ<br>4,993           | 77          | 千ノルウェー・クローネ<br>1,180  |
|    | スウェーデン   | 1,657<br>( 228)         | 千スウェーデン・クローナ<br>21,612         | 193         | 千スウェーデン・クローナ<br>1,107 |

## 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  | 171    | 362    | 22   | 25    |
|        |       | オランダ    | 1,308  | 3,560  | 27   | 146   |
|        |       | ベルギー    | 118    | 754    | 8    | 35    |
|        |       | ルクセンブルグ | 68     | 89     | 0.18 | 0.785 |
|        |       | フランス    | 1,707  | 7,925  | 206  | 319   |
|        |       |         | ( 20)  | (△ 6)  |      |       |
|        |       | ドイツ     | 1,823  | 7,111  | 227  | 644   |
|        |       |         | ( 31)  | (△ 21) |      |       |
|        |       | ポルトガル   | 213    | 120    | —    | —     |
|        |       | スペイン    | 3,367  | 2,553  | 221  | 174   |
|        |       |         | ( 123) | ( 1)   |      |       |
|        |       | イタリア    | 3,423  | 1,683  | 839  | 107   |
|        |       | フィンランド  | 621    | 835    | 19   | 11    |
|        | ( 19) |         |        |        |      |       |
| オーストリア | 54    | 172     | —      | —      |      |       |
|        |       | (△ 17)  |        |        |      |       |
| その他    | 13    | 82      | —      | —      |      |       |

(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           | 0.983 | 127  | —     | —     |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 2     | 367  | —     | —     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT    | 0.952 | 139  | —     | —     |
| PROLOGIS INC                    | 4     | 333  | —     | —     |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT      | 13    | 116  | —     | —     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 0.910 | 189  | —     | —     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST           | 0.747 | 79   | —     | —     |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC  | 1     | 62   | —     | —     |
| DUKE REALTY CORP                | 2     | 75   | —     | —     |
| EQUITY RESIDENTIAL              | 2     | 195  | —     | —     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC        | 0.397 | 122  | —     | —     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 0.501 | 65   | —     | —     |
| HCP INC                         | 3     | 113  | —     | —     |
| WELLTOWER INC                   | 3     | 326  | —     | —     |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC     | 4     | 76   | —     | —     |
| KIMCO REALTY CORP               | 2     | 49   | —     | —     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST          | 0.963 | 49   | —     | —     |
| MACERICH CO/THE                 | 1     | 36   | —     | —     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM      | 0.789 | 96   | —     | —     |
| PUBLIC STORAGE                  | 1     | 251  | —     | —     |
| REGENCY CENTERS CORP            | 1     | 107  | —     | —     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC        | 1     | 304  | —     | —     |
| SL GREEN REALTY CORP            | 0.490 | 39   | 0.009 | 0.795 |
| SUN COMMUNITIES INC             | 4     | 570  | —     | —     |
| UDR INC                         | 2     | 111  | —     | —     |
| VENTAS INC                      | 2     | 166  | —     | —     |
| VORNADO REALTY TRUST            | 1     | 64   | —     | —     |
| WP CAREY INC                    | 1     | 127  | —     | —     |
| REALTY INCOME CORP              | 2     | 207  | —     | —     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES     | 4     | 506  | —     | —     |
|                                 | ( 4)  |      |       |       |
| EXTRA SPACE STORAGE INC         | 0.861 | 98   | —     | —     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC        | 1     | 173  | —     | —     |
| IRON MOUNTAIN INC               | 2     | 74   | —     | —     |
| AGNC INVESTMENT CORP            | 4     | 70   | —     | —     |
| AMERICAN TOWER REIT INC         | 2     | 629  | —     | —     |

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          |
| <b>(アメリカ)</b>                             | 千□    | 千米ドル        | 千□    | 千米ドル        |
| EQUINIX INC                               | 0.693 | 373         | —     | —           |
| VEREIT                                    | 5     | 52          | 0.110 | 0.956       |
| SBA COMMUNICATIONS CORP                   | 0.725 | 176         | —     | —           |
| INVITATION HOMES INC                      | 8     | 238         | —     | —           |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC              | —     | —           | 5     | 100         |
| <b>(カナダ)</b>                              |       | 千カナダ・ドル     |       | 千カナダ・ドル     |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.633 | 20          | 0.008 | 0.253       |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS              | 0.972 | 22          | —     | —           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR               | 0.922 | 24          | 0.052 | 1           |
| <b>(オーストラリア)</b>                          |       | 千オーストラリア・ドル |       | 千オーストラリア・ドル |
| DEXUS                                     | 11    | 149         | —     | —           |
| GPT GROUP                                 | 20    | 124         | —     | —           |
| GOODMAN GROUP                             | 10    | 158         | —     | —           |
| STOCKLAND                                 | 13    | 58          | 0.273 | 1           |
| MIRVAC GROUP                              | 39    | 125         | —     | —           |
| VICINITY CENTRES                          | 24    | 63          | —     | —           |
| SCENTRE GROUP                             | 37    | 145         | —     | —           |
| <b>(香港)</b>                               |       | 千香港ドル       |       | 千香港ドル       |
| LINK REIT                                 | 13    | 1,248       | —     | —           |
| <b>(シンガポール)</b>                           |       | 千シンガポール・ドル  |       | 千シンガポール・ドル  |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT              | 14    | 43          | 3     | 10          |
|   |       | (△ 1)       |       |             |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST               | 17    | 35          | —     | —           |
| CAPITALAND MALL TRUST                     | 17    | 44          | —     | —           |
| SUNTEC REIT                               | 12    | 22          | 8     | 15          |
|   |       | (△0.407)    |       |             |
| ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT              | —     | —           | 19    | 4           |
|   | ( 19) |             |       |             |
| <b>(イギリス)</b>                             |       | 千イギリス・ポンド   |       | 千イギリス・ポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC                       | 5     | 26          | —     | —           |
| HAMMERSON PLC                             | —     | —           | 31    | 85          |
| LAND SECURITIES GROUP PLC                 | 3     | 30          | 1     | 8           |
| SEGRO PLC                                 | 7     | 57          | —     | —           |

外国



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                        | 買付    |      | 売付    |       |
|---------------------------|-------|------|-------|-------|
|                           | 口数    | 金額   | 口数    | 金額    |
| (ユーロ/フランス)                | 千口    | 千ユーロ | 千口    | 千ユーロ  |
| KLEPIERRE                 | 1     | 33   | 0.029 | 0.804 |
| 外国 GECINA SA              | 0.294 | 40   | —     | —     |
| COVIVIO                   | 0.372 | 35   | —     | —     |
| ICADE                     | 0.180 | 14   | 0.123 | 9     |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 0.909 | 117  | —     | —     |

(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 |
|           | 33,343 | 31,677 | —     | —   |

(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

2019年5月21日～2019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      |
| MICROSOFT CORP      | 45 | 665,041 | 14,471  | RED HAT INC                  | 7  | 160,013 | 20,641 |
| APPLE INC           | 26 | 570,630 | 21,912  | WALT DISNEY CO               | 5  | 85,704  | 14,521 |
| AMAZON.COM INC      | 2  | 544,378 | 195,187 | APPLE INC                    | 2  | 58,054  | 22,132 |
| FACEBOOK INC-A      | 15 | 304,894 | 19,873  | AMCOR PLC-CDI                | 52 | 57,165  | 1,091  |
| ALPHABET INC-CL C   | 1  | 244,092 | 123,904 | ORACLE CORP                  | 8  | 46,717  | 5,673  |
| ALPHABET INC-CL A   | 1  | 237,555 | 124,114 | NEWMONT GOLDCORP CORP        | 11 | 39,924  | 3,459  |
| JOHNSON & JOHNSON   | 15 | 228,777 | 14,453  | INNOGY SE                    | 6  | 34,820  | 5,244  |
| NESTLE SA           | 19 | 222,407 | 11,370  | ELI LILLY & CO               | 2  | 29,193  | 12,627 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 16 | 207,174 | 12,398  | PFIZER INC                   | 5  | 26,543  | 4,587  |
| JPMORGAN CHASE & CO | 17 | 206,136 | 11,865  | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 4  | 23,551  | 4,938  |

(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

2019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                        | 239     | 274 | 4,682  | 508,559   | 資本財                    |
| ABBOTT LABORATORIES          | 724     | 840 | 7,085  | 769,538   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                   | 620     | 704 | 6,271  | 681,152   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABIOMED INC                  | 17      | 21  | 395    | 42,925    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ACCENTURE PLC                | 262     | 303 | 6,016  | 653,403   | ソフトウェア・サービス            |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 298     | 364 | 1,943  | 211,117   | メディア・娯楽                |
| ACUITY BRANDS INC            | 16      | 18  | 240    | 26,135    | 資本財                    |
| ADOBE INC                    | 201     | 232 | 6,982  | 758,416   | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 30      | 34  | 552    | 59,973    | 小売                     |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC   | 391     | 489 | 2,021  | 219,592   | 半導体・半導体製造装置            |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 51      | 59  | 351    | 38,224    | 資本財                    |
| AES CORP                     | 273     | 316 | 584    | 63,499    | 公益事業                   |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 20      | 23  | 197    | 21,417    | 各種金融                   |
| AFLAC INC                    | 313     | 355 | 1,920  | 208,549   | 保険                     |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 130     | 149 | 1,187  | 128,968   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 90      | 105 | 2,534  | 275,322   | 素材                     |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 66      | 77  | 688    | 74,770    | ソフトウェア・サービス            |
| ALBEMARLE CORP               | 43      | 50  | 334    | 36,300    | 素材                     |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 91      | 106 | 1,178  | 128,000   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 31      | 36  | 980    | 106,459   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALKERMES PLC                 | 64      | 74  | 149    | 16,183    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLEGHANY CORP               | 6       | 6   | 540    | 58,751    | 保険                     |
| ALLEGION PLC                 | 39      | 44  | 533    | 57,991    | 資本財                    |
| ALLERGAN PLC                 | 139     | 156 | 2,893  | 314,283   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 20      | 20  | 216    | 23,469    | ソフトウェア・サービス            |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 96      | 112 | 590    | 64,114    | 公益事業                   |
| ALLSTATE CORP                | 141     | 158 | 1,756  | 190,821   | 保険                     |
| ALLY FINANCIAL INC           | 168     | 188 | 580    | 63,077    | 各種金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 37      | 52  | 517    | 56,212    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL A            | 123     | 142 | 18,687 | 2,029,632 | メディア・娯楽                |
| ALPHABET INC-CL C            | 129     | 149 | 19,666 | 2,135,938 | メディア・娯楽                |
| ALTICE USA INC- A            | 136     | 71  | 192    | 20,934    | メディア・娯楽                |
| ALTRIA GROUP INC             | 775     | 891 | 4,183  | 454,327   | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC               | 171     | 199 | 34,934 | 3,794,274 | 小売                     |
| AMCOR PLC                    | -       | 780 | 791    | 85,924    | 素材                     |
| AMERCO                       | 4       | 4   | 175    | 19,015    | 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    | 千円ドル   | 千円        |                        |
| AMEREN CORPORATION             | 100     | 116   | 876    | 95,180    | 公益事業                   |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC    | 49      | 52    | 153    | 16,650    | 運輸                     |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | 203     | 235   | 2,132  | 231,607   | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS CO            | 299     | 338   | 4,056  | 440,626   | 各種金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC   | 30      | 36    | 391    | 42,540    | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP   | 364     | 414   | 2,214  | 240,474   | 保険                     |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC    | 74      | 86    | 1,027  | 111,570   | 公益事業                   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC       | 56      | 62    | 1,000  | 108,646   | 各種金融                   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP         | 65      | 75    | 661    | 71,890    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMERITRADE HOLDING CORP        | 116     | 131   | 534    | 58,029    | 各種金融                   |
| AMETEK INC                     | 95      | 107   | 1,070  | 116,315   | 資本財                    |
| AMGEN INC                      | 262     | 290   | 6,523  | 708,470   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A             | 124     | 142   | 1,470  | 159,668   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ANADARKO PETROLEUM CORP        | 208     | -     | -      | -         | エネルギー                  |
| ANALOG DEVICES INC             | 153     | 176   | 1,973  | 214,289   | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                      | 34      | 39    | 960    | 104,290   | ソフトウェア・サービス            |
| ANTHEM INC                     | 106     | 122   | 3,584  | 389,296   | ヘルスケア機器・サービス           |
| AON PLC                        | 99      | 114   | 2,283  | 248,005   | 保険                     |
| APACHE CORP                    | 156     | 179   | 401    | 43,635    | エネルギー                  |
| APPLE INC                      | 1,957   | 2,191 | 58,355 | 6,337,942 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| APPLIED MATERIALS INC          | 404     | 444   | 2,711  | 294,452   | 半導体・半導体製造装置            |
| APTIV PLC                      | 108     | 122   | 1,120  | 121,675   | 自動車・自動車部品              |
| ARAMARK                        | 100     | 117   | 529    | 57,526    | 消費者サービス                |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD         | 165     | 191   | 795    | 86,396    | 保険                     |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO      | 230     | 265   | 1,143  | 124,183   | 食品・飲料・タバコ              |
| ARCONIC INC                    | 178     | 188   | 584    | 63,517    | 資本財                    |
| ARISTA NETWORKS INC            | 21      | 25    | 493    | 53,645    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ARROW ELECTRONICS INC          | 35      | 39    | 314    | 34,145    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO        | 76      | 88    | 818    | 88,903    | 保険                     |
| ASSURANT INC                   | 21      | 29    | 387    | 42,123    | 保険                     |
| AT&T INC                       | 3,005   | 3,480 | 13,224 | 1,436,262 | 電気通信サービス               |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A     | 63      | 74    | 329    | 35,740    | 保険                     |
| ATMOS ENERGY CORP              | 47      | 55    | 601    | 65,286    | 公益事業                   |
| AUTODESK INC                   | 90      | 104   | 1,724  | 187,344   | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOLIV INC                    | 36      | 39    | 320    | 34,785    | 自動車・自動車部品              |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC  | 180     | 207   | 3,549  | 385,559   | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOZONE INC                   | 10      | 11    | 1,378  | 149,692   | 小売                     |
| AVERY DENNISON CORP            | 35      | 40    | 528    | 57,360    | 素材                     |
| AXA EQUITABLE HOLDINGS INC     | 96      | 138   | 328    | 35,713    | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 90      | 101   | 297    | 32,262    | 素材                     |
| BAKER HUGHES COMPANY         | 211     | 245   | 541    | 58,789    | エネルギー                  |
| BALL CORP                    | 133     | 152   | 1,025  | 111,357   | 素材                     |
| BANK OF AMERICA CORP         | 3,843   | 4,299 | 14,162 | 1,538,184 | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 407     | 410   | 1,996  | 216,869   | 各種金融                   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 208     | 230   | 1,885  | 204,741   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BB&T CORPORATION             | 318     | 364   | 1,995  | 216,722   | 銀行                     |
| BECTON DICKINSON & CO        | 110     | 128   | 3,160  | 343,233   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BEIGENE LTD-ADR              | 13      | 17    | 353    | 38,356    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 533     | 619   | 13,559 | 1,472,743 | 各種金融                   |
| BEST BUY CO INC              | 101     | 114   | 860    | 93,462    | 小売                     |
| BIOGEN INC                   | 82      | 92    | 2,627  | 285,422   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 73      | 85    | 663    | 72,088    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 48      | 54    | 2,708  | 294,162   | 各種金融                   |
| BOEING CO                    | 222     | 254   | 9,346  | 1,015,111 | 資本財                    |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 19      | 20    | 3,801  | 412,861   | 小売                     |
| BORGWARNER INC               | 85      | 98    | 426    | 46,372    | 自動車・自動車部品              |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 570     | 662   | 2,824  | 306,763   | ヘルスケア機器・サービス           |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | 42      | 47    | 192    | 20,952    | 保険                     |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 673     | 779   | 4,400  | 477,916   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADCOM INC                 | 170     | 188   | 5,996  | 651,254   | 半導体・半導体製造装置            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 48      | 55    | 677    | 73,622    | ソフトウェア・サービス            |
| BROWN-FORMAN CORP -CL B      | 109     | 146   | 969    | 105,309   | 食品・飲料・タバコ              |
| BUNGE LIMITED                | 58      | 67    | 376    | 40,889    | 食品・飲料・タバコ              |
| BURLINGTON STORES INC        | 27      | 31    | 649    | 70,593    | 小売                     |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 59      | 68    | 522    | 56,723    | 運輸                     |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 178     | 201   | 340    | 36,967    | エネルギー                  |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC   | 115     | 133   | 911    | 99,039    | ソフトウェア・サービス            |
| CAMPBELL SOUP CO             | 75      | 79    | 382    | 41,568    | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 194     | 222   | 2,163  | 234,956   | 各種金融                   |
| CAPRI HOLDINGS LIMITED       | 61      | 71    | 260    | 28,324    | 耐久消費財・アパレル             |
| CARDINAL HEALTH INC          | 123     | 142   | 792    | 86,030    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARMAX INC                   | 72      | 79    | 795    | 86,398    | 小売                     |
| CARNIVAL CORP                | 172     | 199   | 887    | 96,423    | 消費者サービス                |
| CATERPILLAR INC              | 243     | 272   | 3,897  | 423,354   | 資本財                    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 46      | 53    | 655    | 71,140    | 各種金融                   |
| CBRE GROUP INC               | 131     | 150   | 840    | 91,330    | 不動産                    |
| CBS CORP-CL B                | 141     | 160   | 633    | 68,852    | メディア・娯楽                |
| CDK GLOBAL INC               | 50      | 58    | 304    | 33,085    | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                       | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| CDW CORP/DE                         | 62      | 69    | 961    | 104,376   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CELANESE CORP-SERIES A              | 55      | 60    | 758    | 82,338    | 素材                     |
| CELGENE CORP                        | 288     | 335   | 3,630  | 394,293   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTENE CORP                        | 169     | 196   | 1,169  | 126,987   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CENTERPOINT ENERGY INC              | 208     | 240   | 609    | 66,214    | 公益事業                   |
| CENTURYLINK INC                     | 405     | 474   | 715    | 77,744    | 電気通信サービス               |
| CERNER CORP                         | 121     | 154   | 1,052  | 114,347   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC          | 95      | 106   | 486    | 52,811    | 素材                     |
| CHARLES SCHWAB CORP                 | 501     | 571   | 2,538  | 275,743   | 各種金融                   |
| CHARTER COMMUNICATIONS-CL A         | 66      | 75    | 3,610  | 392,185   | メディア・娯楽                |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES   | 51      | 57    | 677    | 73,579    | ソフトウェア・サービス            |
| CHEMOURS CO/THE - W/I               | 70      | -     | -      | -         | 素材                     |
| CHENIERE ENERGY INC                 | 91      | 112   | 670    | 72,859    | エネルギー                  |
| CHEVRON CORP                        | 787     | 907   | 10,563 | 1,147,292 | エネルギー                  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC          | 10      | 12    | 960    | 104,349   | 消費者サービス                |
| CHUBB LTD                           | 190     | 218   | 3,335  | 362,220   | 保険                     |
| CHURCH & DWIGHT CO INC              | 102     | 117   | 810    | 88,070    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CIGNA CORP                          | 156     | 180   | 3,615  | 392,729   | ヘルスケア機器・サービス           |
| CIMAREX ENERGY CO                   | 41      | 47    | 213    | 23,161    | エネルギー                  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP           | 63      | 73    | 795    | 86,392    | 保険                     |
| CINTAS CORP                         | 37      | 42    | 1,090  | 118,400   | 商業・専門サービス              |
| CISCO SYSTEMS INC                   | 1,853   | 2,037 | 9,266  | 1,006,445 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CIT GROUP INC                       | 43      | 44    | 200    | 21,788    | 銀行                     |
| CITIGROUP INC                       | 1,005   | 1,100 | 8,230  | 893,898   | 銀行                     |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP            | 192     | 217   | 826    | 89,729    | 銀行                     |
| CITRIX SYSTEMS INC                  | 55      | 62    | 706    | 76,708    | ソフトウェア・サービス            |
| CLOROX CO                           | 52      | 60    | 892    | 96,906    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CME GROUP INC                       | 147     | 170   | 3,520  | 382,364   | 各種金融                   |
| CMS ENERGY CORP                     | 117     | 136   | 836    | 90,812    | 公益事業                   |
| COCA-COLA CO                        | 1,670   | 1,931 | 10,252 | 1,113,519 | 食品・飲料・タバコ              |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS         | 90      | 113   | 577    | 62,773    | 食品・飲料・タバコ              |
| COGNEX CORP                         | 70      | 81    | 409    | 44,517    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP | 238     | 270   | 1,729  | 187,811   | ソフトウェア・サービス            |
| COLGATE-PALMOLIVE CO                | 340     | 388   | 2,609  | 283,439   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| COMCAST CORP                        | 1,876   | 2,160 | 9,679  | 1,051,309 | メディア・娯楽                |
| COMERICA INC                        | 66      | 72    | 504    | 54,829    | 銀行                     |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC            | 78      | -     | -      | -         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CONAGRA BRANDS INC                  | 200     | 231   | 679    | 73,821    | 食品・飲料・タバコ              |
| CONCHO RESOURCES INC                | 82      | 95    | 675    | 73,367    | エネルギー                  |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末) |     | 当期末   |         | 業種等                |
|------------------------------|---------|-----|-------|---------|--------------------|
|                              | 株数      | 株数  | 評価額   |         |                    |
|                              |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                    |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                    |
| CONOCOPHILLIPS               | 474     | 537 | 3,070 | 333,535 | エネルギー              |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 127     | 155 | 1,353 | 147,041 | 公益事業               |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 68      | 79  | 1,440 | 156,426 | 食品・飲料・タバコ          |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 38      | 43  | 129   | 14,060  | エネルギー              |
| COOPER COS INC/THE           | 20      | 23  | 728   | 79,119  | ヘルスケア機器・サービス       |
| COPART INC                   | 86      | 98  | 847   | 92,025  | 商業・専門サービス          |
| CORNING INC                  | 329     | 372 | 1,079 | 117,246 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CORTEVA INC                  | -       | 359 | 923   | 100,265 | 素材                 |
| COSTAR GROUP INC             | 15      | 17  | 1,027 | 111,631 | 商業・専門サービス          |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 180     | 209 | 6,326 | 687,119 | 食品・生活必需品小売り        |
| COTY INC-CL A                | 203     | 145 | 174   | 18,902  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| CROWN HOLDINGS INC           | 55      | 64  | 481   | 52,288  | 素材                 |
| CSX CORP                     | 333     | 369 | 2,625 | 285,188 | 運輸                 |
| CUMMINS INC                  | 62      | 71  | 1,299 | 141,145 | 資本財                |
| CVS HEALTH CORP              | 533     | 618 | 4,663 | 506,501 | ヘルスケア機器・サービス       |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | -       | 18  | 211   | 22,961  | ソフトウェア・サービス        |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 146     | 168 | 100   | 10,929  | 食品・生活必需品小売り        |
| DANAHER CORP                 | 259     | 306 | 4,404 | 478,419 | ヘルスケア機器・サービス       |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 51      | 58  | 664   | 72,218  | 消費者サービス            |
| DAVITA INC                   | 54      | 49  | 357   | 38,850  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEERE & CO                   | 126     | 143 | 2,492 | 270,737 | 資本財                |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 64      | 74  | 420   | 45,683  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DELTA AIR LINES INC          | 72      | 78  | 446   | 48,483  | 運輸                 |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 93      | 112 | 631   | 68,612  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEVON ENERGY CORPORATION     | 191     | 194 | 418   | 45,501  | エネルギー              |
| DEXCOM INC                   | 36      | 43  | 946   | 102,843 | ヘルスケア機器・サービス       |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 64      | 74  | 552   | 60,006  | エネルギー              |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 138     | 154 | 1,292 | 140,411 | 各種金融               |
| DISCOVERY INC-A              | 64      | 75  | 237   | 25,805  | メディア・娯楽            |
| DISCOVERY INC-C              | 129     | 173 | 508   | 55,226  | メディア・娯楽            |
| DISH NETWORK CORP            | 95      | 110 | 396   | 43,074  | メディア・娯楽            |
| DOCUSIGN INC                 | -       | 49  | 332   | 36,064  | ソフトウェア・サービス        |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 109     | 123 | 1,948 | 211,664 | 小売                 |
| DOLLAR TREE INC              | 98      | 113 | 1,212 | 131,672 | 小売                 |
| DOMINION ENERGY INC          | 311     | 383 | 3,163 | 343,581 | 公益事業               |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 16      | 18  | 532   | 57,785  | 消費者サービス            |
| DOVER CORP                   | 60      | 69  | 753   | 81,796  | 資本財                |
| DOW INC                      | 315     | 357 | 1,910 | 207,500 | 素材                 |
| DR HORTON INC                | 147     | 169 | 916   | 99,533  | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                           | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| DROPBOX INC-CLASS A                     | –       | 91    | 174    | 18,961    | ソフトウェア・サービス            |
| DTE ENERGY COMPANY                      | 75      | 87    | 1,082  | 117,624   | 公益事業                   |
| DUKE ENERGY CORP                        | 294     | 347   | 3,020  | 328,099   | 公益事業                   |
| DUPONT DE NEMOURS INC                   | 946     | 357   | 2,360  | 256,426   | 素材                     |
| DXC TECHNOLOGY CO                       | 115     | 127   | 471    | 51,172    | ソフトウェア・サービス            |
| E*TRADE FINANCIAL                       | 103     | 114   | 515    | 56,005    | 各種金融                   |
| EAST WEST BANCORP INC                   | 58      | 66    | 296    | 32,248    | 銀行                     |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY                | 57      | 65    | 512    | 55,654    | 素材                     |
| EATON CORP PLC                          | 178     | 201   | 1,815  | 197,198   | 資本財                    |
| EATON VANCE CORP                        | 46      | 52    | 251    | 27,298    | 各種金融                   |
| EBAY INC                                | 376     | 393   | 1,379  | 149,862   | 小売                     |
| ECOLAB INC                              | 107     | 123   | 2,343  | 254,479   | 素材                     |
| EDISON INTERNATIONAL                    | 134     | 168   | 1,162  | 126,258   | 公益事業                   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP               | 86      | 99    | 2,417  | 262,599   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC                | –       | 169   | 445    | 48,418    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ELECTRONIC ARTS INC                     | 124     | 141   | 1,367  | 148,543   | メディア・娯楽                |
| ELI LILLY & CO                          | 393     | 416   | 4,792  | 520,529   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EMERSON ELECTRIC CO                     | 257     | 291   | 2,137  | 232,106   | 資本財                    |
| ENTERGY CORP                            | 75      | 91    | 1,061  | 115,240   | 公益事業                   |
| EOG RESOURCES INC                       | 238     | 275   | 1,941  | 210,850   | エネルギー                  |
| EPAM SYSTEMS INC                        | –       | 25    | 542    | 58,874    | ソフトウェア・サービス            |
| EQUIFAX INC                             | 49      | 57    | 815    | 88,544    | 商業・専門サービス              |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A             | –       | 12    | 216    | 23,472    | 保険                     |
| ESTEE LAUDER COS INC                    | 90      | 104   | 2,046  | 222,227   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EVEREST RE GROUP LTD                    | 16      | 19    | 519    | 56,436    | 保険                     |
| EVERGY INC                              | 109     | 117   | 760    | 82,565    | 公益事業                   |
| EVERSOURCE ENERGY                       | 130     | 151   | 1,243  | 135,076   | 公益事業                   |
| EXACT SCIENCES CORP                     | –       | 61    | 516    | 56,110    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP                             | 398     | 461   | 2,095  | 227,582   | 公益事業                   |
| EXPEDIA GROUP INC                       | 50      | 66    | 632    | 68,682    | 小売                     |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC | 73      | 86    | 652    | 70,875    | 運輸                     |
| EXXON MOBIL CORP                        | 1,745   | 2,014 | 13,661 | 1,483,822 | エネルギー                  |
| F5 NETWORKS INC                         | 24      | 27    | 400    | 43,472    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FACEBOOK INC-A                          | 990     | 1,144 | 22,805 | 2,476,959 | メディア・娯楽                |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC            | –       | 18    | 471    | 51,157    | 各種金融                   |
| FASTENAL CO                             | 118     | 271   | 969    | 105,273   | 資本財                    |
| FEDEX CORP                              | 103     | 118   | 1,849  | 200,884   | 運輸                     |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL             | 113     | 130   | 628    | 68,280    | 保険                     |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION           | 135     | 292   | 4,027  | 437,413   | 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      |                        |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 269     | 348   | 1,041 | 113,072 | 銀行                     |
| FIRST DATA CORP- CLASS A           | 222     | -     | -     | -       | ソフトウェア・サービス            |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 68      | 80    | 873   | 94,847  | 銀行                     |
| FIRSTENERGY CORP                   | 212     | 254   | 1,180 | 128,252 | 公益事業                   |
| FISERV INC                         | 164     | 274   | 3,182 | 345,614 | ソフトウェア・サービス            |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 36      | 41    | 1,241 | 134,871 | ソフトウェア・サービス            |
| FLEX LTD                           | 216     | 244   | 292   | 31,739  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FLIR SYSTEMS INC                   | 57      | 64    | 343   | 37,281  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FLOWSERVE CORP                     | 53      | 62    | 299   | 32,517  | 資本財                    |
| FLUOR CORP                         | 57      | 67    | 117   | 12,762  | 資本財                    |
| FMC CORP                           | 55      | 62    | 611   | 66,467  | 素材                     |
| FORD MOTOR CO                      | 1,535   | 1,871 | 1,665 | 180,901 | 自動車・自動車部品              |
| FORTINET INC                       | 60      | 69    | 727   | 79,002  | ソフトウェア・サービス            |
| FORTIVE CORP                       | 123     | 143   | 1,016 | 110,427 | 資本財                    |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 57      | 66    | 410   | 44,622  | 資本財                    |
| FOX CORP - CLASS A                 | 140     | 165   | 600   | 65,228  | メディア・娯楽                |
| FOX CORP- CLASS B                  | 58      | 87    | 309   | 33,585  | メディア・娯楽                |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 124     | 141   | 392   | 42,661  | 各種金融                   |
| FREEPOR-T-MCMORAN INC              | 565     | 687   | 775   | 84,277  | 素材                     |
| GAP INC                            | 93      | 106   | 179   | 19,485  | 小売                     |
| GARMIN LTD                         | 46      | 63    | 613   | 66,579  | 耐久消費財・アパレル             |
| GARTNER INC                        | 37      | 43    | 692   | 75,223  | ソフトウェア・サービス            |
| GENERAL DYNAMICS CORP              | 103     | 116   | 2,161 | 234,721 | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO                | 3,590   | 4,157 | 4,781 | 519,274 | 資本財                    |
| GENERAL MILLS INC                  | 246     | 285   | 1,511 | 164,190 | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL MOTORS CO                  | 524     | 608   | 2,213 | 240,460 | 自動車・自動車部品              |
| GENUINE PARTS CO                   | 60      | 69    | 727   | 79,024  | 小売                     |
| GILEAD SCIENCES INC                | 533     | 605   | 3,934 | 427,377 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 65      | 139   | 2,543 | 276,273 | ソフトウェア・サービス            |
| GLOBE LIFE INC                     | 41      | 48    | 482   | 52,386  | 保険                     |
| GODADDY INC - CLASS A              | 69      | 84    | 574   | 62,420  | ソフトウェア・サービス            |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC            | 137     | 156   | 3,445 | 374,203 | 各種金融                   |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO          | 95      | -     | -     | -       | 自動車・自動車部品              |
| GRUBHUB INC                        | 37      | 43    | 173   | 18,874  | 小売                     |
| H&R BLOCK INC                      | 84      | 96    | 238   | 25,921  | 消費者サービス                |
| HALLIBURTON CO                     | 360     | 413   | 823   | 89,386  | エネルギー                  |
| HANESBRANDS INC                    | 149     | 172   | 258   | 28,103  | 耐久消費財・アパレル             |
| HARLEY-DAVIDSON INC                | 66      | 75    | 279   | 30,369  | 自動車・自動車部品              |
| HARRIS CORP                        | 48      | -     | -     | -       | 資本財                    |



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                     | 期首(前期末) |       | 当期末    |           | 業種等                    |
|--|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|  | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |
|  |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                          | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC  | 147     | 171   | 1,064  | 115,575   | 保険                     |
| HASBRO INC                             | 49      | 57    | 544    | 59,142    | 耐久消費財・アパレル             |
| HCA HEALTHCARE INC                     | 113     | 130   | 1,809  | 196,532   | ヘルスケア機器・サービス           |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC                 | 72      | 80    | 321    | 34,911    | 資本財                    |
| HEICO CORP                             | -       | 20    | 273    | 29,667    | 資本財                    |
| HEICO CORP-CLASS A                     | -       | 36    | 369    | 40,150    | 資本財                    |
| HELMERICH & PAYNE                      | 45      | 51    | 199    | 21,663    | エネルギー                  |
| HENRY SCHEIN INC                       | 62      | 70    | 491    | 53,329    | ヘルスケア機器・サービス           |
| HERSHEY CO/THE                         | 58      | 70    | 1,046  | 113,643   | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                              | 109     | 129   | 859    | 93,369    | エネルギー                  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS              | 605     | 634   | 1,107  | 120,263   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN           | 115     | 131   | 1,318  | 143,165   | 消費者サービス                |
| HOLLYFRONTIER CORP                     | 67      | 76    | 402    | 43,681    | エネルギー                  |
| HOLOGIC INC                            | 119     | 127   | 603    | 65,507    | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOME DEPOT INC                         | 465     | 523   | 11,832 | 1,285,160 | 小売                     |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC            | 305     | 346   | 6,241  | 677,910   | 資本財                    |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD             | 481     | 563   | 305    | 33,203    | 不動産                    |
| HORMEL FOODS CORP                      | 121     | 140   | 598    | 65,001    | 食品・飲料・タバコ              |
| HP INC                                 | 651     | 715   | 1,439  | 156,360   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HUMANA INC                             | 56      | 64    | 2,159  | 234,557   | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC              | 439     | 499   | 738    | 80,178    | 銀行                     |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE           | 17      | 19    | 504    | 54,830    | 資本財                    |
| IAC/INTERACTIVECORP                    | 32      | 37    | 848    | 92,102    | メディア・娯楽                |
| IDEX CORP                              | 31      | 35    | 583    | 63,401    | 資本財                    |
| IDEXX LABORATORIES INC                 | 35      | 40    | 1,083  | 117,711   | ヘルスケア機器・サービス           |
| IHS MARKIT LTD                         | 163     | 181   | 1,308  | 142,061   | 商業・専門サービス              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                | 123     | 155   | 2,705  | 293,885   | 資本財                    |
| ILLUMINA INC                           | 60      | 69    | 2,174  | 236,181   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP                            | 74      | 86    | 764    | 83,056    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGERSOLL-RAND PLC                     | 101     | 115   | 1,498  | 162,739   | 資本財                    |
| INGREDION INC                          | 28      | 31    | 261    | 28,449    | 食品・飲料・タバコ              |
| INTEL CORP                             | 1,882   | 2,131 | 12,440 | 1,351,119 | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC          | 235     | 268   | 2,527  | 274,491   | 各種金融                   |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP   | 374     | 422   | 5,681  | 617,120   | ソフトウェア・サービス            |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 35      | 48    | 666    | 72,340    | 素材                     |
| INTERNATIONAL PAPER CO                 | 158     | 179   | 824    | 89,565    | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC           | 160     | 188   | 422    | 45,877    | メディア・娯楽                |
| INTUIT INC                             | 101     | 123   | 3,353  | 364,215   | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC                 | 46      | 54    | 3,168  | 344,147   | ヘルスケア機器・サービス           |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                  | 期首(前期末) | 当期末   |        |           | 業種等                    |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                                     | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |
|                                     |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| (アメリカ)                              | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| INVESCO LTD                         | 168     | 188   | 330    | 35,887    | 各種金融                   |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC           | -       | 63    | 370    | 40,233    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IPG PHOTONICS CORP                  | 15      | 17    | 241    | 26,203    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| IQVIA HOLDINGS INC                  | 66      | 80    | 1,145  | 124,376   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC         | 31      | 36    | 552    | 59,986    | ソフトウェア・サービス            |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC        | 52      | 64    | 611    | 66,464    | 資本財                    |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD          | 93      | 107   | 599    | 65,102    | 資本財                    |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD         | 93      | 107   | 345    | 37,501    | 資本財                    |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC            | 24      | 26    | 372    | 40,475    | 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      | 38      | 43    | 507    | 55,072    | 運輸                     |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC       | 119     | 116   | 237    | 25,749    | 各種金融                   |
| JM SMUCKER CO                       | 46      | 54    | 564    | 61,343    | 食品・飲料・タバコ              |
| JOHNSON & JOHNSON                   | 1,106   | 1,264 | 17,048 | 1,851,596 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC  | 381     | 379   | 1,629  | 177,008   | 資本財                    |
| JONES LANG LASALLE INC              | 18      | 24    | 396    | 43,102    | 不動産                    |
| JPMORGAN CHASE & CO                 | 1,370   | 1,544 | 20,167 | 2,190,356 | 銀行                     |
| JUNIPER NETWORKS INC                | 141     | 162   | 424    | 46,139    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KANSAS CITY SOUTHERN                | 44      | 50    | 774    | 84,084    | 運輸                     |
| KELLOGG CO                          | 107     | 122   | 797    | 86,665    | 食品・飲料・タバコ              |
| KEYCORP                             | 425     | 479   | 915    | 99,443    | 銀行                     |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN            | 77      | 89    | 969    | 105,331   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KIMBERLY-CLARK CORP                 | 143     | 164   | 2,184  | 237,211   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KINDER MORGAN INC                   | 824     | 975   | 1,952  | 212,014   | エネルギー                  |
| KKR & CO INC -A                     | 199     | 233   | 680    | 73,874    | 各種金融                   |
| KLA CORPORATION                     | 67      | 76    | 1,354  | 147,084   | 半導体・半導体製造装置            |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION         | 57      | 66    | 244    | 26,542    | 運輸                     |
| KOHL'S CORP                         | 68      | 77    | 365    | 39,649    | 小売                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE                  | 252     | 320   | 1,004  | 109,089   | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                           | 327     | 383   | 1,029  | 111,854   | 食品・生活必需品小売り            |
| L BRANDS INC                        | 96      | 111   | 191    | 20,829    | 小売                     |
| L3 TECHNOLOGIES INC                 | 32      | -     | -      | -         | 資本財                    |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC           | -       | 105   | 2,144  | 232,864   | 資本財                    |
| LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 41      | 46    | 803    | 87,244    | ヘルスケア機器・サービス           |
| LAM RESEARCH CORP                   | 63      | 71    | 1,969  | 213,869   | 半導体・半導体製造装置            |
| LAMB WESTON HOLDING INC             | 60      | 69    | 585    | 63,599    | 食品・飲料・タバコ              |
| LAS VEGAS SANDS CORP                | 160     | 164   | 1,020  | 110,818   | 消費者サービス                |
| LEAR CORP                           | 26      | 28    | 338    | 36,792    | 自動車・自動車部品              |
| LEGGETT & PLATT INC                 | 54      | 63    | 332    | 36,135    | 耐久消費財・アパレル             |
| LEIDOS HOLDINGS INC                 | 59      | 65    | 603    | 65,580    | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                               | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| LENNAR CORP-CL A                            | 120     | 136   | 812    | 88,236    | 耐久消費財・アパレル             |
| LENNOX INTERNATIONAL INC                    | 14      | 16    | 427    | 46,432    | 資本財                    |
| LIBERTY BROADBAND-C                         | 45      | 52    | 619    | 67,243    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A                        | 71      | 84    | 191    | 20,846    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C                 | 220     | 242   | 529    | 57,497    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A                | 36      | 30    | 145    | 15,804    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C                | 71      | 91    | 430    | 46,807    | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA GROUP-C                       | 85      | 98    | 443    | 48,133    | メディア・娯楽                |
| LINCOLN NATIONAL CORP                       | 85      | 93    | 539    | 58,567    | 保険                     |
| LINDE PLC                                   | 227     | 258   | 5,369  | 583,230   | 素材                     |
| LIVE NATION INC                             | 61      | 71    | 489    | 53,206    | メディア・娯楽                |
| LKQ CORP                                    | 130     | 147   | 520    | 56,544    | 小売                     |
| LOCKHEED MARTIN CORP                        | 105     | 121   | 4,744  | 515,292   | 資本財                    |
| LOEWS CORP                                  | 109     | 129   | 651    | 70,779    | 保険                     |
| LOWE'S COS INC                              | 332     | 378   | 4,293  | 466,322   | 小売                     |
| LULULEMON ATHLETICA INC                     | 40      | 52    | 1,142  | 124,113   | 耐久消費財・アパレル             |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A                    | 133     | 127   | 1,183  | 128,533   | 素材                     |
| M&T BANK CORP                               | 55      | 61    | 1,006  | 109,291   | 銀行                     |
| MACY'S INC                                  | 126     | 146   | 220    | 23,940    | 小売                     |
| MANPOWER GROUP                              | 24      | 27    | 257    | 27,943    | 商業・専門サービス              |
| MARATHON OIL CORP                           | 340     | 385   | 442    | 48,015    | エネルギー                  |
| MARATHON PETROLEUM CORP                     | 284     | 315   | 1,952  | 212,112   | エネルギー                  |
| MARKEL CORP                                 | 5       | 6     | 739    | 80,348    | 保険                     |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC                    | -       | 17    | 719    | 78,145    | 各種金融                   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC                  | 119     | 134   | 1,827  | 198,439   | 消費者サービス                |
| MARSH & MCLENNAN COS INC                    | 207     | 243   | 2,610  | 283,477   | 保険                     |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS                   | 25      | 29    | 780    | 84,716    | 素材                     |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD                | 258     | 299   | 790    | 85,874    | 半導体・半導体製造装置            |
| MASCO CORP                                  | 125     | 139   | 636    | 69,089    | 資本財                    |
| MASTERCARD INC-CLASS A                      | 378     | 432   | 12,346 | 1,340,984 | ソフトウェア・サービス            |
| MATTEL INC                                  | 143     | -     | -      | -         | 耐久消費財・アパレル             |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS                   | 114     | 129   | 726    | 78,873    | 半導体・半導体製造装置            |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS                 | 50      | 58    | 971    | 105,463   | 食品・飲料・タバコ              |
| MCDONALD'S CORP                             | 318     | 363   | 7,040  | 764,683   | 消費者サービス                |
| MCKESSON CORP                               | 80      | 90    | 1,360  | 147,781   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MEDTRONIC PLC                               | 554     | 638   | 7,095  | 770,652   | ヘルスケア機器・サービス           |
| MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR | 102     | 100   | 219    | 23,803    | 消費者サービス                |
| MERCADOLIBRE INC                            | 17      | 21    | 1,135  | 123,375   | 小売                     |
| MERCK & CO INC                              | 1,072   | 1,226 | 10,382 | 1,127,697 | 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        |                        |
| METLIFE INC                  | 343     | 382   | 1,880  | 204,260   | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 10      | 11    | 861    | 93,617    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MGM MIRAGE                   | 205     | 242   | 770    | 83,653    | 消費者サービス                |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 97      | 113   | 1,054  | 114,531   | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 466     | 526   | 2,451  | 266,278   | 半導体・半導体製造装置            |
| MICROSOFT CORP               | 3,007   | 3,467 | 52,142 | 5,663,177 | ソフトウェア・サービス            |
| MIDDLEBY CORP                | 23      | 26    | 304    | 33,069    | 資本財                    |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 25      | 29    | 405    | 44,012    | 耐久消費財・アパレル             |
| MOLSON COORS BREWING CO -B   | 78      | 90    | 472    | 51,270    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC   | 598     | 685   | 3,611  | 392,225   | 食品・飲料・タバコ              |
| MONGODB INC                  | -       | 20    | 283    | 30,794    | ソフトウェア・サービス            |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 170     | 193   | 1,133  | 123,095   | 食品・飲料・タバコ              |
| MOODY'S CORP                 | 71      | 81    | 1,820  | 197,774   | 各種金融                   |
| MORGAN STANLEY               | 530     | 598   | 2,953  | 320,831   | 各種金融                   |
| MOSAIC CO/THE                | 150     | 174   | 327    | 35,561    | 素材                     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 67      | 78    | 1,307  | 141,962   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MSCI INC                     | 36      | 40    | 1,038  | 112,791   | 各種金融                   |
| MYLAN NV                     | 211     | 244   | 422    | 45,841    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NASDAQ INC                   | 47      | 55    | 581    | 63,117    | 各種金融                   |
| NATIONAL-OILWELL INC         | 157     | 183   | 386    | 42,017    | エネルギー                  |
| NEKTAR THERAPEUTICS          | 71      | 83    | 153    | 16,676    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NETAPP INC                   | 103     | 117   | 738    | 80,257    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NETFLIX INC                  | 179     | 208   | 6,304  | 684,783   | メディア・娯楽                |
| NEWELL BRANDS INC            | 193     | 192   | 376    | 40,933    | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWMONT GOLDCORP CORP        | 218     | 389   | 1,493  | 162,163   | 素材                     |
| NEWS CORP - CLASS A          | 164     | 184   | 238    | 25,855    | メディア・娯楽                |
| NEXTERA ENERGY INC           | 196     | 228   | 5,309  | 576,617   | 公益事業                   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 147     | 171   | 349    | 37,920    | 商業・専門サービス              |
| NIKE INC                     | 524     | 598   | 5,598  | 608,026   | 耐久消費財・アパレル             |
| NISOURCE INC                 | 154     | 178   | 465    | 50,585    | 公益事業                   |
| NOBLE ENERGY INC             | 197     | 227   | 444    | 48,261    | エネルギー                  |
| NORDSTROM INC                | 48      | 51    | 183    | 19,922    | 小売                     |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 114     | 128   | 2,479  | 269,302   | 運輸                     |
| NORTHERN TRUST CORP          | 86      | 98    | 1,051  | 114,173   | 各種金融                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 68      | 76    | 2,720  | 295,434   | 資本財                    |
| NORTONLIFELOCK INC           | 263     | 294   | 726    | 78,937    | ソフトウェア・サービス            |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 90      | 101   | 545    | 59,253    | 消費者サービス                |
| NRG ENERGY INC               | 119     | 126   | 498    | 54,165    | 公益事業                   |
| NUCOR CORP                   | 129     | 143   | 788    | 85,611    | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| NVIDIA CORP                  | 238     | 275   | 5,729  | 622,281   | 半導体・半導体製造装置            |
| NVR INC                      | 1       | 1     | 596    | 64,746    | 耐久消費財・アパレル             |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 142     | 136   | 1,550  | 168,428   | 半導体・半導体製造装置            |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 311     | 426   | 1,625  | 176,598   | エネルギー                  |
| OGE ENERGY CORP              | 82      | 94    | 404    | 43,899    | 公益事業                   |
| OKTA INC                     | -       | 49    | 626    | 68,043    | ソフトウェア・サービス            |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 26      | 32    | 623    | 67,716    | 運輸                     |
| OMNICOM GROUP                | 94      | 106   | 839    | 91,168    | メディア・娯楽                |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 173     | 196   | 414    | 44,973    | 半導体・半導体製造装置            |
| ONEOK INC                    | 170     | 197   | 1,376  | 149,479   | エネルギー                  |
| ORACLE CORP                  | 1,093   | 1,139 | 6,411  | 696,348   | ソフトウェア・サービス            |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 33      | 37    | 1,659  | 180,198   | 小売                     |
| OWENS CORNING                | 44      | 51    | 342    | 37,244    | 資本財                    |
| PACCAR INC                   | 144     | 165   | 1,310  | 142,369   | 資本財                    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 38      | 44    | 508    | 55,177    | 素材                     |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 39      | 45    | 1,140  | 123,857   | ソフトウェア・サービス            |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 54      | 60    | 1,192  | 129,508   | 資本財                    |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 103     | 133   | 200    | 21,828    | エネルギー                  |
| PAYCHEX INC                  | 133     | 154   | 1,321  | 143,501   | ソフトウェア・サービス            |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | -       | 23    | 570    | 61,984    | ソフトウェア・サービス            |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 461     | 531   | 5,580  | 606,121   | ソフトウェア・サービス            |
| PENTAIR PLC                  | 67      | 76    | 332    | 36,089    | 資本財                    |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 156     | 187   | 306    | 33,253    | 銀行                     |
| PEPSICO INC                  | 582     | 667   | 8,984  | 975,828   | 食品・飲料・タバコ              |
| PERKINELMER INC              | -       | 52    | 478    | 51,961    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PERRIGO CO PLC               | 53      | 61    | 300    | 32,590    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PFIZER INC                   | 2,384   | 2,644 | 9,958  | 1,081,614 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 641     | 741   | 6,184  | 671,713   | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILLIPS 66                  | 180     | 215   | 2,534  | 275,273   | エネルギー                  |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 45      | 53    | 460    | 49,992    | 公益事業                   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 70      | 80    | 1,037  | 112,680   | エネルギー                  |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A   | 65      | 76    | 130    | 14,161    | エネルギー                  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 190     | 215   | 3,261  | 354,283   | 銀行                     |
| POLARIS INC                  | 24      | 27    | 281    | 30,566    | 耐久消費財・アパレル             |
| PPG INDUSTRIES INC           | 99      | 112   | 1,448  | 157,279   | 素材                     |
| PPL CORPORATION              | 297     | 343   | 1,153  | 125,328   | 公益事業                   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 116     | 132   | 723    | 78,591    | 保険                     |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 1,028   | 1,195 | 14,511 | 1,576,134 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PROGRESSIVE CORP             | 240     | 277   | 1,987  | 215,824   | 保険                     |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末 |       |         | 業種等                    |
|-------------------------------|---------|-----|-------|---------|------------------------|
|                               | 株数      | 株数  | 評価額   |         |                        |
|                               |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                 | 百株      | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                        |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 169     | 192 | 1,794 | 194,923 | 保険                     |
| PTC INC                       | 46      | 52  | 382   | 41,526  | ソフトウェア・サービス            |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP  | 208     | 240 | 1,455 | 158,063 | 公益事業                   |
| PULTE GROUP INC               | 109     | 125 | 495   | 53,865  | 耐久消費財・アパレル             |
| PVH CORP                      | 31      | 35  | 343   | 37,329  | 耐久消費財・アパレル             |
| QORVO INC                     | 51      | 56  | 585   | 63,598  | 半導体・半導体製造装置            |
| QUALCOMM INC                  | 500     | 579 | 5,096 | 553,510 | 半導体・半導体製造装置            |
| QUEST DIAGNOSTICS             | 56      | 63  | 668   | 72,590  | ヘルスケア機器・サービス           |
| QURATE RETAIL INC             | 172     | 189 | 187   | 20,373  | 小売                     |
| RALPH LAUREN CORP             | 22      | 24  | 273   | 29,671  | 耐久消費財・アパレル             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 52      | 59  | 530   | 57,666  | 各種金融                   |
| RAYTHEON CO                   | 117     | 133 | 2,905 | 315,554 | 資本財                    |
| RED HAT INC                   | 73      | -   | -     | -       | ソフトウェア・サービス            |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 32      | 38  | 1,321 | 143,474 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 422     | 478 | 790   | 85,882  | 銀行                     |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 25      | 29  | 482   | 52,371  | 保険                     |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD    | 16      | 21  | 396   | 43,112  | 保険                     |
| REPUBLIC SERVICES INC         | 94      | 108 | 948   | 102,998 | 商業・専門サービス              |
| RESMED INC                    | 58      | 68  | 1,023 | 111,110 | ヘルスケア機器・サービス           |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 49      | 54  | 321   | 34,944  | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 49      | 56  | 1,104 | 119,959 | 資本財                    |
| ROKU INC                      | -       | 39  | 602   | 65,427  | メディア・娯楽                |
| ROLLINS INC                   | 59      | 69  | 254   | 27,634  | 商業・専門サービス              |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 42      | 49  | 1,731 | 188,107 | 資本財                    |
| ROSS STORES INC               | 153     | 174 | 1,962 | 213,161 | 小売                     |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD   | 68      | 84  | 1,003 | 108,968 | 消費者サービス                |
| S&P GLOBAL INC                | 103     | 117 | 3,142 | 341,294 | 各種金融                   |
| SABRE CORP                    | 114     | 131 | 296   | 32,221  | ソフトウェア・サービス            |
| SALESFORCE.COM INC            | 315     | 396 | 6,492 | 705,184 | ソフトウェア・サービス            |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC      | -       | 35  | 348   | 37,800  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHLUMBERGER LTD              | 571     | 659 | 2,261 | 245,618 | エネルギー                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY            | 112     | 118 | 707   | 76,881  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SEALED AIR CORP               | 65      | 74  | 284   | 30,865  | 素材                     |
| SEATTLE GENETICS INC          | 46      | 53  | 635   | 68,969  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 52      | 59  | 372   | 40,507  | 各種金融                   |
| SEMPRA ENERGY                 | 112     | 130 | 1,926 | 209,225 | 公益事業                   |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING  | 67      | 76  | 400   | 43,527  | 資本財                    |
| SERVICENOW INC                | 74      | 88  | 2,447 | 265,786 | ソフトウェア・サービス            |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE       | 34      | 39  | 2,316 | 251,642 | 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  |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                  | 百株      | 百株  | 千米ドル  | 千円      |                        |
| SIGNATURE BANK                 | 22      | 26  | 329   | 35,773  | 銀行                     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC         | 705     | 783 | 546   | 59,330  | メディア・娯楽                |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC         | 73      | 82  | 793   | 86,135  | 半導体・半導体製造装置            |
| SMITH (A.O.) CORP              | 58      | 66  | 320   | 34,768  | 資本財                    |
| SNAP INC - A                   | -       | 331 | 501   | 54,503  | メディア・娯楽                |
| SNAP-ON INC                    | 23      | 26  | 421   | 45,772  | 資本財                    |
| SOUTHERN CO                    | 426     | 497 | 3,092 | 335,899 | 公益事業                   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO          | 58      | 63  | 368   | 39,984  | 運輸                     |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A   | 43      | 48  | 443   | 48,220  | 資本財                    |
| SPLUNK INC                     | 60      | 71  | 892   | 96,968  | ソフトウェア・サービス            |
| SPRINT CORP                    | 351     | 400 | 230   | 24,984  | 電気通信サービス               |
| SQUARE INC - A                 | 127     | 160 | 1,063 | 115,551 | ソフトウェア・サービス            |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS     | 93      | 109 | 650   | 70,672  | ソフトウェア・サービス            |
| STANLEY BLACK & DECKER INC     | 62      | 71  | 1,125 | 122,208 | 資本財                    |
| STARBUCKS CORP                 | 512     | 577 | 4,828 | 524,398 | 消費者サービス                |
| STATE STREET CORP              | 155     | 176 | 1,296 | 140,789 | 各種金融                   |
| STEEL DYNAMICS INC             | 94      | 105 | 330   | 35,890  | 素材                     |
| STERIS PLC                     | -       | 40  | 612   | 66,564  | ヘルスケア機器・サービス           |
| STRYKER CORP                   | 138     | 160 | 3,319 | 360,554 | ヘルスケア機器・サービス           |
| SUNTRUST BANKS INC             | 184     | 211 | 1,492 | 162,136 | 銀行                     |
| SVB FINANCIAL GROUP            | 21      | 24  | 561   | 60,993  | 銀行                     |
| SYNCHRONY FINANCIAL            | 266     | 295 | 1,090 | 118,475 | 各種金融                   |
| SYNOPSIS INC                   | 60      | 70  | 1,005 | 109,200 | ソフトウェア・サービス            |
| SYSCO CORP                     | 203     | 232 | 1,868 | 202,991 | 食品・生活必需品小売り            |
| T ROWE PRICE GROUP INC         | 97      | 110 | 1,351 | 146,765 | 各種金融                   |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A      | 29      | -   | -     | -       | ソフトウェア・サービス            |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE  | 47      | 53  | 664   | 72,184  | メディア・娯楽                |
| TAPESTRY INC                   | 119     | 138 | 373   | 40,513  | 耐久消費財・アパレル             |
| TARGA RESOURCES CORP           | 96      | 114 | 423   | 46,048  | エネルギー                  |
| TARGET CORP                    | 204     | 244 | 2,706 | 293,954 | 小売                     |
| TE CONNECTIVITY LTD            | 140     | 159 | 1,480 | 160,836 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TECHNIPFMC PLC                 | 176     | 204 | 393   | 42,767  | エネルギー                  |
| TELEFLEX INC                   | 18      | 22  | 780   | 84,775  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TESLA, INC.                    | 53      | 62  | 2,248 | 244,163 | 自動車・自動車部品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 399     | 520 | 535   | 58,187  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 396     | 446 | 5,264 | 571,790 | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXTRON INC                    | 99      | 109 | 509   | 55,322  | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 165     | 190 | 5,835 | 633,756 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TIFFANY & CO                   | 44      | 51  | 637   | 69,199  | 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    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                  | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| TJX COS INC                    | 509     | 576   | 3,496  | 379,774   | 小売                     |
| T-MOBILE US INC                | 141     | 164   | 1,267  | 137,655   | 電気通信サービス               |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC      | 67      | —     | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 50      | 57    | 552    | 60,006    | 小売                     |
| TRANSDIGM GROUP INC            | 19      | 22    | 1,299  | 141,125   | 資本財                    |
| TRANSUNION                     | 76      | 89    | 769    | 83,611    | 商業・専門サービス              |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 108     | 124   | 1,685  | 183,065   | 保険                     |
| TRIMBLE INC                    | 102     | 119   | 468    | 50,931    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRIPADVISOR INC                | 43      | 50    | 143    | 15,575    | メディア・娯楽                |
| TWILIO INC - A                 | —       | 53    | 547    | 59,502    | ソフトウェア・サービス            |
| TWITTER INC                    | 283     | 347   | 1,024  | 111,230   | メディア・娯楽                |
| TYSON FOODS INC-CL A           | 121     | 140   | 1,270  | 138,013   | 食品・飲料・タバコ              |
| UBER TECHNOLOGIES INC          | —       | 92    | 250    | 27,193    | 運輸                     |
| UGI CORP                       | 72      | 99    | 437    | 47,470    | 公益事業                   |
| ULTA BEAUTY INC                | 23      | 26    | 633    | 68,752    | 小売                     |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A       | 78      | 89    | 154    | 16,789    | 耐久消費財・アパレル             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I   | 78      | 93    | 146    | 15,868    | 耐久消費財・アパレル             |
| UNION PACIFIC CORP             | 305     | 339   | 6,009  | 652,741   | 運輸                     |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC. | 28      | 30    | 288    | 31,359    | 運輸                     |
| UNITED PARCEL SERVICE INC      | 287     | 333   | 4,020  | 436,613   | 運輸                     |
| UNITED RENTALS INC             | 33      | 37    | 565    | 61,372    | 資本財                    |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP       | 338     | 390   | 5,789  | 628,754   | 資本財                    |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | 17      | —     | —      | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 396     | 452   | 12,408 | 1,347,731 | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC  | 35      | 39    | 556    | 60,475    | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNUM GROUP                     | 87      | 96    | 282    | 30,715    | 保険                     |
| US BANCORP                     | 632     | 719   | 4,276  | 464,440   | 銀行                     |
| VAIL RESORTS INC               | 16      | 19    | 461    | 50,119    | 消費者サービス                |
| VALERO ENERGY CORP             | 174     | 198   | 1,938  | 210,502   | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC     | 37      | 42    | 552    | 59,961    | ヘルスケア機器・サービス           |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A      | 51      | 60    | 926    | 100,597   | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                   | 44      | 50    | 986    | 107,096   | ソフトウェア・サービス            |
| VERISK ANALYTICS INC           | 64      | 74    | 1,068  | 116,015   | 商業・専門サービス              |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC     | 1,707   | 1,973 | 11,740 | 1,275,178 | 電気通信サービス               |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC     | 105     | 121   | 2,622  | 284,813   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VF CORP                        | 139     | 160   | 1,387  | 150,695   | 耐久消費財・アパレル             |
| VIACOM INC-CLASS B             | 148     | 170   | 401    | 43,607    | メディア・娯楽                |
| VISA INC-CLASS A SHARES        | 725     | 827   | 15,132 | 1,643,574 | ソフトウェア・サービス            |
| VISTRA ENERGY CORP             | 135     | 172   | 456    | 49,570    | 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        |                        |
| VMWARE INC-CLASS A           | 33      | 39    | 680    | 73,953    | ソフトウェア・サービス            |
| VOYA FINANCIAL INC           | 63      | 67    | 388    | 42,212    | 各種金融                   |
| VULCAN MATERIALS CO          | 54      | 62    | 888    | 96,534    | 素材                     |
| WABCO HOLDINGS INC           | 21      | 24    | 329    | 35,781    | 資本財                    |
| WABTEC CORP                  | 56      | 86    | 688    | 74,739    | 資本財                    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 332     | 369   | 2,267  | 246,300   | 食品・生活必需品小売り            |
| WALMART INC                  | 598     | 682   | 8,184  | 888,921   | 食品・生活必需品小売り            |
| WALT DISNEY CO               | 813     | 857   | 12,723 | 1,381,860 | メディア・娯楽                |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 109     | 126   | 1,143  | 124,203   | 商業・専門サービス              |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 176     | 203   | 2,284  | 248,128   | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                  | 31      | 32    | 722    | 78,464    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 24      | 29    | 244    | 26,544    | 小売                     |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 131     | 151   | 1,332  | 144,706   | 公益事業                   |
| WELLCARE HEALTH PLANS INC    | 20      | 23    | 762    | 82,810    | ヘルスケア機器・サービス           |
| WELLS FARGO & CO             | 1,843   | 2,033 | 10,986 | 1,193,210 | 銀行                     |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 119     | 139   | 664    | 72,168    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WESTERN UNION CO             | 185     | 207   | 567    | 61,661    | ソフトウェア・サービス            |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 15      | 18    | 126    | 13,782    | 素材                     |
| WESTROCK CO-WHEN ISSUED      | 104     | 122   | 487    | 52,974    | 素材                     |
| WEYERHAEUSER CO              | 309     | 355   | 1,055  | 114,628   | 不動産                    |
| WHIRLPOOL CORP               | 26      | 30    | 424    | 46,119    | 耐久消費財・アパレル             |
| WILLIAMS COS INC             | 503     | 582   | 1,289  | 140,009   | エネルギー                  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 53      | 61    | 1,171  | 127,230   | 保険                     |
| WIX.COM LTD                  | 18      | 22    | 289    | 31,463    | ソフトウェア・サービス            |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 61      | 77    | 1,290  | 140,149   | ソフトウェア・サービス            |
| WORLDPAY INC                 | 124     | -     | -      | -         | ソフトウェア・サービス            |
| WR BERKLEY CORP              | 60      | 70    | 487    | 52,952    | 保険                     |
| WW GRAINGER INC              | 19      | 22    | 707    | 76,888    | 資本財                    |
| WYNN RESORTS LTD             | 40      | 45    | 552    | 60,025    | 消費者サービス                |
| XCEL ENERGY INC              | 211     | 245   | 1,503  | 163,269   | 公益事業                   |
| XEROX CORP                   | 87      | -     | -      | -         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XEROX HOLDINGS CORP          | -       | 95    | 370    | 40,222    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XILINX INC                   | 104     | 121   | 1,123  | 122,016   | 半導体・半導体製造装置            |
| XPO LOGISTICS INC            | 53      | 45    | 377    | 40,974    | 運輸                     |
| XYLEM INC                    | 73      | 85    | 663    | 72,067    | 資本財                    |
| YUM! BRANDS INC              | 128     | 145   | 1,431  | 155,430   | 消費者サービス                |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 85      | 114   | 394    | 42,824    | 電気通信サービス               |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | -       | 25    | 606    | 65,849    | 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      |                        |
|                                    |         | 百株      | 百株      | 千円ドル      | 千円          |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                      |         |         |         |           |             |                        |
| ZILLOW GROUP INC - C W/I           |         | 52      | 60      | 229       | 24,884      | メディア・娯楽                |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC         |         | 84      | 97      | 1,412     | 153,389     | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZIONS BANCORP, N.A.                |         | 78      | 85      | 420       | 45,684      | 銀行                     |
| ZOETIS INC                         |         | 198     | 228     | 2,746     | 298,327     | 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   | 125,168 | 143,996 | 1,265,667 | 137,464,099 |                        |
|                                    | 銘柄数<比率> | 597     | 610     | -         | <65.1%>     |                        |
| <b>(カナダ)</b>                       |         |         |         | 千カナダ・ドル   |             |                        |
| AGNICO EAGLE MINES LTD             |         | 96      | 112     | 896       | 73,318      | 素材                     |
| AIR CANADA                         |         | -       | 63      | 315       | 25,825      | 運輸                     |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B        |         | 180     | 416     | 1,751     | 143,321     | 食品・生活必需品小売り            |
| ALTAGAS LTD                        |         | 113     | 134     | 267       | 21,895      | 公益事業                   |
| ARC RESOURCES LTD                  |         | 146     | -       | -         | -           | エネルギー                  |
| ATCO LTD -CL 'I'                   |         | 32      | 37      | 186       | 15,252      | 公益事業                   |
| AURORA CANNABIS INC                |         | 289     | 340     | 105       | 8,669       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BANK OF MONTREAL                   |         | 264     | 304     | 3,083     | 252,306     | 銀行                     |
| BANK OF NOVA SCOTIA                |         | 505     | 582     | 4,452     | 364,312     | 銀行                     |
| BARRICK GOLD CORP                  |         | 721     | 834     | 1,889     | 154,616     | 素材                     |
| BAUSCH HEALTH COMPANIES INC        |         | 129     | 150     | 563       | 46,146      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BCE INC                            |         | 69      | 79      | 513       | 42,003      | 電気通信サービス               |
| BLACKBERRY LTD                     |         | 209     | 246     | 174       | 14,289      | ソフトウェア・サービス            |
| BOMBARDIER INC                     |         | 884     | 1,027   | 212       | 17,401      | 資本財                    |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC    |         | 350     | 405     | 3,079     | 251,968     | 各種金融                   |
| CAE INC                            |         | 111     | 128     | 453       | 37,066      | 資本財                    |
| CAMECO CORP                        |         | 163     | 189     | 236       | 19,353      | エネルギー                  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE |         | 182     | 211     | 2,438     | 199,517     | 銀行                     |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO       |         | 303     | 347     | 4,268     | 349,215     | 運輸                     |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD     |         | 496     | 569     | 2,108     | 172,492     | エネルギー                  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD       |         | 60      | 68      | 2,158     | 176,619     | 運輸                     |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A           |         | 25      | 27      | 433       | 35,466      | 小売                     |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A           |         | 56      | 65      | 257       | 21,041      | 公益事業                   |
| CANOPY GROWTH CORP                 |         | 85      | 99      | 201       | 16,519      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B          |         | 62      | 71      | 409       | 33,508      | 素材                     |
| CENOVUS ENERGY INC                 |         | 430     | 496     | 586       | 48,002      | エネルギー                  |
| CGI INC                            |         | 101     | 115     | 1,268     | 103,800     | ソフトウェア・サービス            |
| CI FINANCIAL CORP                  |         | 95      | 108     | 227       | 18,632      | 各種金融                   |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC         |         | 8       | 9       | 1,307     | 106,944     | ソフトウェア・サービス            |
| CRONOS GROUP INC                   |         | -       | 88      | 78        | 6,405       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOLLARAMA INC                      |         | 125     | 143     | 675       | 55,236      | 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  |             |
| <b>(カナダ)</b>                | 百株      | 百株  | 千カナダ・ドル | 千円      |             |
| EMERA INC                   | 27      | 117 | 641     | 52,464  | 公益事業        |
| EMPIRE CO LTD 'A'           | 72      | 83  | 284     | 23,253  | 食品・生活必需品小売り |
| ENBRIDGE INC                | 835     | 966 | 4,825   | 394,855 | エネルギー       |
| ENCANA CORP                 | 609     | 662 | 348     | 28,507  | エネルギー       |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 11      | 13  | 790     | 64,657  | 保険          |
| FINNING INTERNATIONAL INC   | 69      | -   | -       | -       | 資本財         |
| FIRST CAPITAL REALTY INC    | 80      | 90  | 196     | 16,109  | 不動産         |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD  | 283     | 325 | 390     | 31,983  | 素材          |
| FORTIS INC                  | 180     | 209 | 1,121   | 91,738  | 公益事業        |
| FRANCO-NEVADA CORP          | 76      | 88  | 1,163   | 95,207  | 素材          |
| GEORGE WESTON LTD           | 32      | 37  | 390     | 31,974  | 食品・生活必需品小売り |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC       | 86      | 98  | 354     | 29,017  | 耐久消費財・アパレル  |
| GREAT-WEST LIFECO INC       | 124     | 134 | 445     | 36,433  | 保険          |
| HUSKY ENERGY INC            | 144     | 164 | 158     | 12,946  | エネルギー       |
| HYDRO ONE LTD               | 139     | 161 | 401     | 32,825  | 公益事業        |
| IA FINANCIAL CORP INC       | 45      | 50  | 342     | 28,058  | 保険          |
| IGM FINANCIAL INC           | 36      | 42  | 163     | 13,393  | 各種金融        |
| IMPERIAL OIL LTD            | 114     | 127 | 420     | 34,392  | エネルギー       |
| INTACT FINANCIAL CORP       | 58      | 66  | 902     | 73,829  | 保険          |
| INTER PIPELINE LTD          | 169     | 197 | 439     | 35,927  | エネルギー       |
| KEYERA CORP                 | 88      | 102 | 348     | 28,477  | エネルギー       |
| KINROSS GOLD CORP           | 515     | 596 | 338     | 27,721  | 素材          |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD      | -       | 94  | 612     | 50,141  | 素材          |
| LOBLAW COS LTD              | 77      | 88  | 619     | 50,668  | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDIN MINING CORP          | 267     | 310 | 229     | 18,801  | 素材          |
| MAGNA INTERNATIONAL INC     | 130     | 146 | 1,076   | 88,106  | 自動車・自動車部品   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP     | 815     | 934 | 2,437   | 199,458 | 保険          |
| METHANEX CORP               | 25      | 31  | 155     | 12,754  | 素材          |
| METRO INC                   | 100     | 121 | 673     | 55,104  | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA     | 140     | 162 | 1,137   | 93,078  | 銀行          |
| NEWMONT GOLDCORP CORP       | 115     | -   | -       | -       | 素材          |
| NUTRIEN LTD                 | 254     | 279 | 1,764   | 144,368 | 素材          |
| ONEX CORPORATION            | 37      | 41  | 334     | 27,352  | 各種金融        |
| OPEN TEXT CORP              | 111     | 129 | 746     | 61,112  | ソフトウェア・サービス |
| PEMBINA PIPELINE CORP       | 211     | 245 | 1,180   | 96,561  | エネルギー       |
| POWER CORP OF CANADA        | 149     | 146 | 473     | 38,759  | 保険          |
| POWER FINANCIAL CORP        | 106     | 129 | 425     | 34,789  | 保険          |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD      | 87      | 101 | 137     | 11,242  | エネルギー       |
| QUEBECOR INC -CL B          | -       | 92  | 310     | 25,416  | メディア・娯楽     |

## 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      |                     |
| <b>(カナダ)</b>                          | 百株               | 百株           | 千カナダ・ドル      | 千円          |                     |
| RESTAURANT BRANDS INTERN              | 99               | 115          | 1,012        | 82,802      | 消費者サービス             |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC             | 154              | 176          | 1,119        | 91,606      | 電気通信サービス            |
| ROYAL BANK OF CANADA                  | 593              | 683          | 7,442        | 608,948     | 銀行                  |
| SAPUTO INC                            | 96               | 111          | 449          | 36,773      | 食品・飲料・タバコ           |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A          | 111              | -            | -            | -           | エネルギー               |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B             | 200              | 231          | 637          | 52,196      | メディア・娯楽             |
| SHOPIFY INC - CLASS A                 | 37               | 47           | 1,988        | 162,682     | ソフトウェア・サービス         |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                 | 73               | 86           | 215          | 17,637      | 資本財                 |
| STARS GROUP INC/THE                   | 71               | 109          | 333          | 27,255      | 消費者サービス             |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                | 247              | 281          | 1,725        | 141,155     | 保険                  |
| SUNCOR ENERGY INC                     | 660              | 746          | 3,113        | 254,720     | エネルギー               |
| TC ENERGY CORP                        | 379              | 444          | 3,019        | 247,025     | エネルギー               |
| TECK RESOURCES LTD-CL B               | 208              | 235          | 503          | 41,161      | 素材                  |
| THOMSON REUTERS CORP                  | 85               | 96           | 920          | 75,302      | 商業・専門サービス           |
| TORONTO-DOMINION BANK                 | 754              | 871          | 6,705        | 548,624     | 銀行                  |
| TOURMALINE OIL CORP                   | 106              | 122          | 154          | 12,600      | エネルギー               |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD          | 417              | -            | -            | -           | 素材                  |
| VERMILION ENERGY INC                  | 61               | 73           | 140          | 11,517      | エネルギー               |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD             | 22               | 25           | 152          | 12,446      | 素材                  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP          | 183              | 212          | 783          | 64,105      | 素材                  |
| WSP GLOBAL INC                        | 43               | 50           | 430          | 35,250      | 資本財                 |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 17,346<br>87 | 19,592<br>86 | 92,232<br>- | 7,546,455<br><3.6%> |
| <b>(オーストラリア)</b>                      |                  |              | 千オーストラリア・ドル  |             |                     |
| AGL ENERGY LTD                        | 283              | 332          | 674          | 49,979      | 公益事業                |
| ALUMINA LTD                           | 1,080            | 1,281        | 316          | 23,473      | 素材                  |
| AMCOR LTD                             | 512              | -            | -            | -           | 素材                  |
| AMP LTD                               | 1,272            | 1,719        | 347          | 25,758      | 各種金融                |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD                | 244              | 282          | 899          | 66,653      | 消費者サービス             |
| ASX LTD                               | 90               | 103          | 842          | 62,431      | 各種金融                |
| AURIZON HOLDINGS LTD                  | 940              | 1,103        | 637          | 47,280      | 運輸                  |
| AUSNET SERVICES                       | 1,056            | 1,291        | 227          | 16,894      | 公益事業                |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP | 1,197            | 1,373        | 3,492        | 258,939     | 銀行                  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD                | 196              | 240          | 207          | 15,380      | 銀行                  |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED     | 227              | 275          | 295          | 21,934      | 銀行                  |
| BHP GROUP LIMITED                     | 1,228            | 1,424        | 5,336        | 395,663     | 素材                  |
| BLUESCOPE STEEL LTD                   | 227              | 259          | 364          | 27,053      | 素材                  |
| BORAL LTD                             | 521              | 612          | 308          | 22,850      | 素材                  |
| BRAMBLES LTD                          | 688              | 798          | 992          | 73,566      | 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  |                        |
| (オーストラリア)                      | 百株      | 百株    | 千円    | 千円      |                        |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED       | 117     | 133   | 379   | 28,103  | エネルギー                  |
| CHALLENGER LTD                 | 240     | 281   | 235   | 17,426  | 各種金融                   |
| CIMIC GROUP LIMITED            | 45      | 53    | 179   | 13,301  | 資本財                    |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED       | 246     | 282   | 324   | 24,073  | 食品・飲料・タバコ              |
| COCHLEAR LTD                   | 24      | 28    | 653   | 48,451  | ヘルスケア機器・サービス           |
| COLES GROUP LTD                | 473     | 556   | 875   | 64,874  | 食品・生活必需品小売り            |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 738     | 854   | 6,894 | 511,167 | 銀行                     |
| COMPUTERSHARE LIMITED          | 206     | 259   | 435   | 32,308  | ソフトウェア・サービス            |
| CROWN RESORTS LTD              | 183     | 214   | 274   | 20,359  | 消費者サービス                |
| CSL LIMITED                    | 188     | 217   | 5,977 | 443,187 | 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   | 27      | -     | -     | -       | 消費者サービス                |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 25      | 29    | 125   | 9,322   | 消費者サービス                |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 663     | 686   | 637   | 47,297  | 素材                     |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     | 283     | 299   | 129   | 9,600   | 小売                     |
| INCITEC PIVOT LTD              | 745     | 875   | 291   | 21,606  | 素材                     |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 998     | 1,153 | 909   | 67,404  | 保険                     |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | 193     | 222   | 633   | 46,956  | 素材                     |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 137     | 159   | 2,203 | 163,383 | 各種金融                   |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD   | -       | 62    | 320   | 23,777  | 各種金融                   |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           | 1,206   | 1,395 | 446   | 33,100  | 保険                     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 1,160   | 1,374 | 3,747 | 277,810 | 銀行                     |
| NEWCREST MINING LIMITED        | 325     | 375   | 1,176 | 87,232  | 素材                     |
| OIL SEARCH LTD                 | 604     | 713   | 525   | 38,941  | エネルギー                  |
| ORICA LTD                      | 173     | 201   | 479   | 35,551  | 素材                     |
| ORIGIN ENERGY LIMITED          | 740     | 869   | 720   | 53,421  | エネルギー                  |
| QBE INSURANCE GROUP LTD        | 576     | 659   | 838   | 62,191  | 保険                     |
| RAMSAY HEALTH CARE LIMITED     | 63      | 74    | 548   | 40,685  | ヘルスケア機器・サービス           |
| REA GROUP LTD                  | 24      | 27    | 287   | 21,285  | メディア・娯楽                |
| RIO TINTO LTD                  | 156     | 181   | 1,727 | 128,090 | 素材                     |
| SANTOS LTD                     | 752     | 882   | 718   | 53,264  | エネルギー                  |
| SEEK LTD                       | 153     | 175   | 406   | 30,142  | 商業・専門サービス              |
| SONIC HEALTHCARE LTD           | 197     | 237   | 706   | 52,397  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SOUTH32 LTD                    | 2,120   | 2,453 | 659   | 48,930  | 素材                     |
| SUNCORP GROUP LTD              | 575     | 647   | 864   | 64,076  | 保険                     |
| TABCORP HOLDINGS LTD           | 855     | 1,066 | 519   | 38,519  | 消費者サービス                |
| TELSTRA CORP LTD               | 1,804   | 2,115 | 761   | 56,456  | 電気通信サービス               |
| TPG TELECOM LTD                | 175     | 212   | 140   | 10,416  | 電気通信サービス               |
| TREASURY WINE ESTATES LTD      | 304     | 352   | 656   | 48,648  | 食品・飲料・タバコ              |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON   | 52      | 71    | 154   | 11,431  | 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    |             |
| <b>(オーストラリア)</b>                   |         | 百株      | 百株     | 千円     | 千円        |             |
| WESFARMERS LIMITED                 |         | 483     | 558    | 2,379  | 176,434   | 小売          |
| WESTPAC BANKING CORP               |         | 1,437   | 1,671  | 4,438  | 329,034   | 銀行          |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD             |         | 397     | 465    | 1,601  | 118,725   | エネルギー       |
| WOOLWORTHS GROUP LTD               |         | 562     | 617    | 2,432  | 180,378   | 食品・生活必需品小売り |
| WORLEY LIMITED                     |         | 138     | 172    | 238    | 17,703    | エネルギー       |
| 小計                                 | 株数・金額   | 30,353  | 35,046 | 63,600 | 4,715,336 |             |
|                                    | 銘柄数<比率> | 58      | 57     | -      | <2.2%>    |             |
| <b>(香港)</b>                        |         |         |        | 千香港ドル  |           |             |
| AIA GROUP LTD                      |         | 4,986   | 5,766  | 45,845 | 636,337   | 保険          |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY             |         | 128     | 147    | 1,556  | 21,607    | 半導体・半導体製造装置 |
| BANK OF EAST ASIA                  |         | 546     | 644    | 1,163  | 16,143    | 銀行          |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         |         | 1,540   | 1,780  | 4,824  | 66,969    | 銀行          |
| CK ASSET HOLDINGS LTD              |         | 1,074   | 1,229  | 6,624  | 91,952    | 不動産         |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          |         | 1,129   | 1,304  | 9,539  | 132,407   | 資本財         |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED |         | 285     | 325    | 1,797  | 24,945    | 公益事業        |
| CLP HOLDINGS LTD                   |         | 686     | 791    | 6,438  | 89,363    | 公益事業        |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD     |         | 978     | 1,028  | 5,515  | 76,558    | 消費者サービス     |
| HANG LUNG GROUP LTD                |         | 370     | -      | -      | -         | 不動産         |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD           |         | 851     | 991    | 1,640  | 22,763    | 不動産         |
| HANG SENG BANK LTD                 |         | 319     | 369    | 6,046  | 83,921    | 銀行          |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT         |         | 550     | 716    | 2,740  | 38,034    | 不動産         |
| HONG KONG & CHINA GAS              |         | 3,886   | 4,900  | 7,438  | 103,252   | 公益事業        |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR        |         | 493     | 572    | 14,405 | 199,951   | 各種金融        |
| HYSAN DEVELOPMENT CO               |         | 270     | 300    | 924    | 12,825    | 不動産         |
| KERRY PROPERTIES LTD               |         | 270     | 320    | 830    | 11,525    | 不動産         |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD             |         | 400     | 464    | 553    | 7,676     | 消費者サービス     |
| MINTH GROUP LTD                    |         | 300     | -      | -      | -         | 自動車・自動車部品   |
| MTR CORP                           |         | 677     | 772    | 3,387  | 47,020    | 運輸          |
| NEW WORLD DEVELOPMENT              |         | 2,536   | 2,946  | 3,176  | 44,090    | 不動産         |
| NWS HOLDINGS LTD                   |         | 670     | 780    | 912    | 12,666    | 資本財         |
| PCCW LTD                           |         | 2,160   | 2,490  | 1,152  | 16,001    | 電気通信サービス    |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD          |         | 580     | 670    | 3,719  | 51,633    | 公益事業        |
| SANDS CHINA LTD                    |         | 1,001   | 1,161  | 4,449  | 61,761    | 消費者サービス     |
| SHANGRI-LA ASIA LTD                |         | 540     | 620    | 515    | 7,151     | 消費者サービス     |
| SINO LAND CO                       |         | 1,360   | 1,480  | 1,725  | 23,952    | 不動産         |
| SJM HOLDINGS LTD                   |         | 830     | 960    | 802    | 11,139    | 消費者サービス     |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD        |         | 660     | 760    | 8,423  | 116,916   | 不動産         |
| SWIRE PACIFIC LTD                  |         | 208     | 238    | 1,674  | 23,237    | 不動産         |
| SWIRE PROPERTIES LTD               |         | 484     | 560    | 1,338  | 18,576    | 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    |                    |
| <b>(香港)</b>       |  | 百株      | 百株     | 千香港ドル       | 千円        |                    |
|                   | TECHTRONIC INDUSTRIES CO               | 565     | 655    | 4,031       | 55,957    | 資本財                |
|                   | VITASOY INTL HOLDINGS LTD              | -       | 340    | 1,108       | 15,384    | 食品・飲料・タバコ          |
|                   | WH GROUP LTD                           | 3,665   | 4,560  | 3,912       | 54,305    | 食品・飲料・タバコ          |
|                   | WHARF HOLDINGS LTD                     | 507     | 597    | 1,103       | 15,321    | 不動産                |
|                   | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT           | 507     | 577    | 2,572       | 35,699    | 不動産                |
|                   | WHEELOCK & CO LTD                      | 340     | 390    | 1,922       | 26,687    | 不動産                |
|                   | WYNN MACAU LTD                         | 649     | 749    | 1,300       | 18,048    | 消費者サービス            |
|                   | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG               | 310     | 365    | 852         | 11,829    | 耐久消費財・アパレル         |
| 小計                | 株数・金額                                  | 37,318  | 43,324 | 165,966     | 2,303,618 |                    |
|                   | 銘柄数<比率>                                | 38      | 37     | -           | <1.1%>    |                    |
| <b>(シンガポール)</b>   |  |         |        | 千シンガポールドル   |           |                    |
|                   | CAPITALAND LTD                         | 1,052   | 1,218  | 448         | 35,768    | 不動産                |
|                   | CITY DEVELOPMENTS LTD                  | 159     | 206    | 223         | 17,836    | 不動産                |
|                   | COMFORTDELGRO CORP LTD                 | 922     | 1,076  | 253         | 20,264    | 運輸                 |
|                   | DBS GROUP HOLDINGS LTD                 | 739     | 853    | 2,255       | 179,975   | 銀行                 |
|                   | GENTING SINGAPORE LTD                  | 2,453   | 2,812  | 265         | 21,205    | 消費者サービス            |
|                   | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD              | 2,704   | 3,090  | 74          | 5,917     | 食品・飲料・タバコ          |
|                   | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD           | 41      | 47     | 149         | 11,904    | 小売                 |
|                   | KEPPEL CORP LTD                        | 603     | 692    | 474         | 37,826    | 資本財                |
|                   | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP           | 1,312   | 1,514  | 1,683       | 134,348   | 銀行                 |
|                   | SATS LTD                               | 315     | 360    | 181         | 14,507    | 運輸                 |
|                   | SEMBCORP INDUSTRIES LTD                | 415     | 476    | 107         | 8,584     | 資本財                |
|                   | SINGAPORE AIRLINES LTD                 | 233     | 265    | 242         | 19,349    | 運輸                 |
|                   | SINGAPORE EXCHANGE LTD                 | 333     | 384    | 340         | 27,149    | 各種金融               |
|                   | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD           | 701     | 799    | 177         | 14,154    | メディア・娯楽            |
|                   | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 673     | 770    | 321         | 25,684    | 資本財                |
|                   | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS           | 3,432   | 3,953  | 1,261       | 100,628   | 電気通信サービス           |
|                   | UNITED OVERSEAS BANK LTD               | 552     | 598    | 1,594       | 127,270   | 銀行                 |
|                   | UOL Group Limited                      | 191     | 209    | 166         | 13,325    | 不動産                |
|                   | VENTURE CORP LTD                       | 112     | 131    | 208         | 16,600    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
|                   | WILMAR INTERNATIONAL LTD               | 804     | 927    | 383         | 30,625    | 食品・飲料・タバコ          |
|                   | YANGZIJIAN SHIPBUILDING                | 978     | 1,132  | 119         | 9,575     | 資本財                |
| 小計                | 株数・金額                                  | 18,724  | 21,512 | 10,933      | 872,504   |                    |
|                   | 銘柄数<比率>                                | 21      | 21     | -           | <0.4%>    |                    |
| <b>(ニュージーランド)</b> |  |         |        | 千ニュージーランドドル |           |                    |
|                   | A2 MILK CO LTD                         | 301     | 350    | 494         | 34,535    | 食品・飲料・タバコ          |
|                   | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD              | 428     | 494    | 444         | 30,996    | 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  |                        |
| <b>(ニュージーランド)</b>            |         | 百株      | 百株    | 千ニュージーランドドル | 千円      |                        |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |         | 235     | 273   | 560         | 39,109  | ヘルスケア機器・サービス           |
| FLETCHER BUILDING LTD        |         | 358     | 415   | 216         | 15,128  | 素材                     |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |         | 555     | 631   | 281         | 19,624  | 公益事業                   |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         |         | 169     | 195   | 276         | 19,315  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        |         | 799     | 921   | 410         | 28,630  | 電気通信サービス               |
| 小計                           | 株数・金額   | 2,850   | 3,283 | 2,683       | 187,339 |                        |
|                              | 銘柄数<比率> | 7       | 7     | -           | <0.1%>  |                        |
| <b>(イギリス)</b>                |         |         |       | 千イギリス・ポンド   |         |                        |
| 3I GROUP PLC                 |         | 395     | 458   | 484         | 67,946  | 各種金融                   |
| ADMIRAL GROUP PLC            |         | 85      | 91    | 188         | 26,412  | 保険                     |
| ANGLO AMERICAN PLC           |         | 431     | 495   | 1,014       | 142,365 | 素材                     |
| ANTOFAGASTA PLC              |         | 158     | 180   | 162         | 22,741  | 素材                     |
| ASHTREAD GROUP PLC           |         | 196     | 221   | 520         | 73,101  | 資本財                    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |         | 146     | 168   | 410         | 57,535  | 食品・飲料・タバコ              |
| ASTRAZENECA PLC              |         | 523     | 625   | 4,572       | 641,708 | 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     |         | 388     | 442   | 237         | 33,289  | メディア・娯楽                |
| AVIVA PLC                    |         | 1,610   | 1,855 | 776         | 108,898 | 保険                     |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       |         | 101     | -     | -           | -       | 商業・専門サービス              |
| BAE SYSTEMS PLC              |         | 1,321   | 1,526 | 883         | 123,978 | 資本財                    |
| BARCLAYS PLC                 |         | 7,056   | 8,197 | 1,396       | 196,026 | 銀行                     |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |         | 420     | 486   | 317         | 44,493  | 耐久消費財・アパレル             |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT |         | 50      | 58    | 263         | 36,963  | 耐久消費財・アパレル             |
| BHP GROUP PLC                |         | 868     | 1,002 | 1,708       | 239,810 | 素材                     |
| BP PLC                       |         | 8,280   | 9,699 | 4,868       | 683,138 | エネルギー                  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |         | 945     | 1,092 | 3,157       | 443,116 | 食品・飲料・タバコ              |
| BT GROUP PLC                 |         | 3,514   | 4,058 | 771         | 108,260 | 電気通信サービス               |
| BUNZL PLC                    |         | 140     | 161   | 331         | 46,492  | 資本財                    |
| BURBERRY GROUP PLC           |         | 168     | 195   | 405         | 56,886  | 耐久消費財・アパレル             |
| CARNIVAL PLC                 |         | 68      | 76    | 247         | 34,684  | 消費者サービス                |
| CENTRICA PLC                 |         | 2,373   | 2,772 | 203         | 28,598  | 公益事業                   |
| COCA-COLA HBC AG-CDI         |         | 83      | 94    | 229         | 32,160  | 食品・飲料・タバコ              |
| COMPASS GROUP PLC            |         | 655     | 756   | 1,530       | 214,834 | 消費者サービス                |
| CONVATEC GROUP PLC           |         | 579     | -     | -           | -       | ヘルスケア機器・サービス           |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      |         | 52      | 60    | 292         | 41,081  | 素材                     |
| DCC PLC                      |         | 40      | 46    | 309         | 43,442  | 資本財                    |
| DIAGEO PLC                   |         | 1,000   | 1,132 | 3,530       | 495,389 | 食品・飲料・タバコ              |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  |         | 570     | 648   | 179         | 25,140  | 保険                     |
| EASYJET PLC                  |         | 69      | 77    | 103         | 14,565  | 運輸                     |
| EVRAZ PLC                    |         | -       | 246   | 89          | 12,489  | 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  |                        |
| (イギリス)                            | 百株      | 百株     | 千イギリスポンド | 千円      |                        |
| EXPERIAN PLC                      | 374     | 433    | 1,074    | 150,751 | 商業・専門サービス              |
| FERGUSON PLC                      | 95      | 110    | 742      | 104,191 | 資本財                    |
| FRESNILLO PLC                     | 91      | 106    | 66       | 9,331   | 素材                     |
| G4S PLC                           | 641     | 748    | 155      | 21,835  | 商業・専門サービス              |
| GLAXOSMITHKLINE PLC               | 2,050   | 2,379  | 4,083    | 573,098 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLENCORE PLC                      | 4,632   | 5,221  | 1,257    | 176,524 | 素材                     |
| GVC HOLDINGS PLC                  | 228     | 277    | 237      | 33,330  | 消費者サービス                |
| HALMA PLC                         | -       | 180    | 371      | 52,124  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           | 115     | 134    | 244      | 34,299  | 各種金融                   |
| HSBC HOLDINGS PLC                 | 8,272   | 9,653  | 5,606    | 786,696 | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 394     | 456    | 810      | 113,745 | 食品・飲料・タバコ              |
| INFORMA PLC                       | 524     | 604    | 476      | 66,799  | メディア・娯楽                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 70      | 82     | 395      | 55,550  | 消費者サービス                |
| INTERTEK GROUP PLC                | 66      | 76     | 423      | 59,435  | 商業・専門サービス              |
| INVESTEC PLC                      | 280     | 321    | 140      | 19,710  | 各種金融                   |
| ITV PLC                           | 1,533   | 1,752  | 239      | 33,573  | メディア・娯楽                |
| JOHNSON MATTHEY PLC               | 79      | 90     | 290      | 40,801  | 素材                     |
| KINGFISHER PLC                    | 869     | 987    | 206      | 28,924  | 小売                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC         | 2,457   | 2,839  | 792      | 111,258 | 保険                     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC          | 29,375  | 33,828 | 2,009    | 281,983 | 銀行                     |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP       | 129     | 150    | 1,037    | 145,641 | 各種金融                   |
| M&G PLC                           | -       | 1,213  | 283      | 39,753  | 各種金融                   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC         | 673     | 923    | 171      | 24,097  | 小売                     |
| MEGGITT PLC                       | 319     | 368    | 235      | 33,009  | 資本財                    |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 2,008   | 2,332  | 522      | 73,322  | 資本財                    |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI      | 292     | -      | -        | -       | 消費者サービス                |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL         | 145     | 164    | 170      | 23,987  | ソフトウェア・サービス            |
| MONDI PLC/WI                      | 149     | 227    | 380      | 53,429  | 素材                     |
| MORRISON WM SUPERMARKETS          | 924     | 1,123  | 224      | 31,520  | 食品・生活必需品小売り            |
| NATIONAL GRID PLC                 | 1,401   | 1,626  | 1,461    | 205,111 | 公益事業                   |
| NEXT PLC                          | 57      | 64     | 427      | 60,007  | 小売                     |
| NMC HEALTH PLC                    | 43      | 44     | 116      | 16,358  | ヘルスケア機器・サービス           |
| OCADO GROUP PLC                   | -       | 217    | 253      | 35,575  | 小売                     |
| PEARSON PLC                       | 323     | 372    | 248      | 34,863  | メディア・娯楽                |
| PERSIMMON PLC                     | 130     | 151    | 373      | 52,475  | 耐久消費財・アパレル             |
| PRUDENTIAL PLC                    | 1,064   | 1,213  | 1,600    | 224,570 | 保険                     |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 277     | 337    | 1,999    | 280,554 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RELX PLC                          | 813     | 931    | 1,743    | 244,637 | 商業・専門サービス              |
| RENTOKIL INITIAL PLC              | -       | 889    | 396      | 55,593  | 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      |                      |  |
| <b>(イギリス)</b>                    | 百株               | 百株            | 千イリス・ポンド      | 千円          |                      |  |
| RIO TINTO PLC                    | 474              | 539           | 2,271         | 318,793     | 素材                   |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC         | 699              | 821           | 598           | 84,051      | 資本財                  |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT         | 48,600           | —             | —             | —           | 資本財                  |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT      | —                | 37,783        | 3             | 530         | 資本財                  |  |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC | 1,976            | 2,295         | 511           | 71,750      | 銀行                   |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS      | 1,861            | 2,068         | 4,729         | 663,662     | エネルギー                |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS      | 1,542            | 1,787         | 4,053         | 568,862     | エネルギー                |  |
| ROYAL MAIL PLC                   | 381              | —             | —             | —           | 運輸                   |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC          | 425              | 489           | 265           | 37,190      | 保険                   |  |
| SAGE GROUP PLC                   | 446              | 517           | 383           | 53,862      | ソフトウェア・サービス          |  |
| SAINSBURY (J) PLC                | 726              | 834           | 177           | 24,869      | 食品・生活必需品小売り          |  |
| SCHRODERS PLC                    | 50               | 58            | 190           | 26,719      | 各種金融                 |  |
| SEVERN TRENT PLC                 | 98               | 113           | 267           | 37,583      | 公益事業                 |  |
| SMITH & NEPHEW PLC               | 361              | 417           | 694           | 97,440      | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| SMITHS GROUP PLC                 | 163              | 188           | 311           | 43,761      | 資本財                  |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC     | —                | 35            | 300           | 42,233      | 資本財                  |  |
| SSE PLC                          | 426              | 494           | 651           | 91,398      | 公益事業                 |  |
| ST JAMES'S PLACE PLC             | 224              | 257           | 273           | 38,401      | 各種金融                 |  |
| STANDARD CHARTERED PLC           | 1,160            | 1,331         | 927           | 130,121     | 銀行                   |  |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC       | 1,044            | 1,157         | 364           | 51,102      | 各種金融                 |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC                | 1,361            | 1,564         | 271           | 38,167      | 耐久消費財・アパレル           |  |
| TESCO PLC                        | 4,041            | 4,663         | 1,096         | 153,840     | 食品・生活必需品小売り          |  |
| TUI AG-DI                        | 182              | 210           | 223           | 31,431      | 消費者サービス              |  |
| UNILEVER PLC                     | 458              | 529           | 2,411         | 338,419     | 家庭用品・パーソナル用品         |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC       | 283              | 326           | 286           | 40,156      | 公益事業                 |  |
| VODAFONE GROUP PLC               | 11,106           | 12,785        | 1,958         | 274,866     | 電気通信サービス             |  |
| WEIR GROUP PLC/THE               | 101              | 122           | 173           | 24,349      | 資本財                  |  |
| WHITBREAD PLC                    | 75               | 62            | 278           | 39,052      | 消費者サービス              |  |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC            | 281              | 326           | 114           | 16,088      | エネルギー                |  |
| WPP PLC                          | 524              | 605           | 592           | 83,133      | メディア・娯楽              |  |
| 小計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 172,285<br>93 | 181,958<br>95 | 84,841<br>— | 11,905,873<br><5.6%> |  |
| <b>(イスラエル)</b>                   |                  |               | 千イスラエル・シケル    |             |                      |  |
| AZRIELI GROUP                    | 17               | 20            | 544           | 17,056      | 不動産                  |  |
| BANK HAPOLIM BM                  | 441              | 542           | 1,543         | 48,389      | 銀行                   |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL             | 617              | 714           | 1,788         | 56,060      | 銀行                   |  |
| BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP       | 899              | —             | —             | —           | 電気通信サービス             |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD                | 9                | 11            | 647           | 20,301      | 資本財                  |  |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED         | 292              | 337           | 525           | 16,469      | 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            |                        |
| <b>(イスラエル)</b>                    |                  | 百株         | 百株         | 千イスラエル・シケル | 千円                |                        |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A            |                  | –          | 555        | 859        | 26,957            | 銀行                     |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD          |                  | 59         | 68         | 610        | 19,131            | 銀行                     |
| NICE LTD                          |                  | 25         | 29         | 1,535      | 48,142            | ソフトウェア・サービス            |
| 小計                                | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,362<br>8 | 2,281<br>8 | 8,054<br>– | 252,509<br><0.1%> |                        |
| <b>(スイス)</b>                      |                  |            |            | 千スイス・フラン   |                   |                        |
| ABB LTD                           |                  | 759        | 878        | 1,907      | 209,100           | 資本財                    |
| ADECCO GROUP AG-REG               |                  | 63         | 74         | 455        | 49,898            | 商業・専門サービス              |
| ALCON INC                         |                  | 178        | 197        | 1,151      | 126,189           | ヘルスケア機器・サービス           |
| BALOISE HOLDING AG                |                  | 19         | 23         | 410        | 44,986            | 保険                     |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG            |                  | 0.91       | 1          | 205        | 22,502            | 食品・飲料・タバコ              |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC        |                  | 0.44       | 0.51       | 376        | 41,282            | 食品・飲料・タバコ              |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       |                  | 0.04       | 0.05       | 414        | 45,378            | 食品・飲料・タバコ              |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG       |                  | 214        | 248        | 1,864      | 204,371           | 耐久消費財・アパレル             |
| CLARIANT AG                       |                  | 81         | 95         | 196        | 21,552            | 素材                     |
| CREDIT SUISSE GROUP AG            |                  | 1,053      | 1,215      | 1,575      | 172,657           | 各種金融                   |
| DUFREY AG-REG                     |                  | 13         | 20         | 199        | 21,852            | 小売                     |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG         |                  | 3          | 3          | 238        | 26,104            | 素材                     |
| GEBERIT AG-REG                    |                  | 15         | 17         | 924        | 101,297           | 資本財                    |
| GIVAUDAN-REG                      |                  | 3          | 4          | 1,281      | 140,498           | 素材                     |
| JULIUS BAER GROUP LTD             |                  | 92         | 106        | 494        | 54,148            | 各種金融                   |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        |                  | 23         | 27         | 439        | 48,216            | 運輸                     |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG             |                  | 200        | 230        | 1,190      | 130,531           | 素材                     |
| LONZA GROUP AG                    |                  | 30         | 35         | 1,179      | 129,271           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NESTLE SA                         |                  | 1,263      | 1,459      | 15,185     | 1,664,457         | 食品・飲料・タバコ              |
| NOVARTIS AG                       |                  | 894        | 1,023      | 9,130      | 1,000,770         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PARGESA HOLDING SA-BR             |                  | 15         | 18         | 145        | 15,973            | 各種金融                   |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG         |                  | 7          | 8          | 720        | 78,973            | 各種金融                   |
| ROCHE HOLDING AG                  |                  | 289        | 334        | 10,100     | 1,107,101         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG          |                  | 9          | 10         | 244        | 26,782            | 資本財                    |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT       |                  | 15         | 18         | 455        | 49,948            | 資本財                    |
| SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE |                  | 2          | 2          | 646        | 70,877            | 商業・専門サービス              |
| SIKA AG-BEARER                    |                  | 52         | 60         | 1,047      | 114,795           | 素材                     |
| SONOVA HOLDING AG-REG             |                  | 22         | 26         | 575        | 63,036            | ヘルスケア機器・サービス           |
| STRAUMANN HOLDING AG              |                  | 4          | 4          | 443        | 48,650            | ヘルスケア機器・サービス           |
| SWATCH GROUP AG                   |                  | 12         | 13         | 365        | 40,083            | 耐久消費財・アパレル             |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG         |                  | 14         | 16         | 811        | 88,942            | 保険                     |
| SWISS PRIME SITE-REG              |                  | 32         | 37         | 398        | 43,635            | 不動産                    |
| SWISS RE AG                       |                  | 126        | 146        | 1,557      | 170,721           | 保険                     |

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                        |                  | 期首(前期末)     |             | 当期末         |                     | 業種等                    |
|---------------------------|------------------|-------------|-------------|-------------|---------------------|------------------------|
|                           |                  | 株数          | 株数          | 評価額         |                     |                        |
|                           |                  |             |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額              |                        |
|                           |                  | 百株          | 百株          | 千スイス・フラン    | 千円                  |                        |
| <b>(スイス)</b>              |                  |             |             |             |                     |                        |
| SWISSCOM AG               |                  | 11          | 12          | 659         | 72,339              | 電気通信サービス               |
| TEMENOS GROUP AG-REG      |                  | 24          | 30          | 449         | 49,322              | ソフトウェア・サービス            |
| THE SWATCH GROUP AG-REG   |                  | 23          | 29          | 156         | 17,113              | 耐久消費財・アパレル             |
| UBS GROUP AG              |                  | 1,590       | 1,840       | 2,207       | 241,946             | 各種金融                   |
| VIFOR PHARMA AG           |                  | 18          | 21          | 349         | 38,301              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG |                  | 62          | 72          | 2,833       | 310,530             | 保険                     |
| 小計                        | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,251<br>39 | 8,369<br>39 | 62,988<br>- | 6,904,145<br><3.3%> |                        |
| <b>(デンマーク)</b>            |                  |             |             | 千デンマーク・クローネ |                     |                        |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   |                  | 2           | 3           | 2,881       | 46,396              | 運輸                     |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   |                  | 1           | 2           | 1,839       | 29,608              | 運輸                     |
| CARLSBERG AS-B            |                  | 44          | 50          | 4,936       | 79,470              | 食品・飲料・タバコ              |
| CHR HANSEN HOLDING A/S    |                  | 40          | 50          | 2,577       | 41,504              | 素材                     |
| COLOPLAST-B               |                  | 48          | 56          | 4,542       | 73,138              | ヘルスケア機器・サービス           |
| DANSKE BANK A/S           |                  | 295         | 308         | 2,812       | 45,282              | 銀行                     |
| DEMANT A/S                |                  | 41          | 51          | 1,027       | 16,543              | ヘルスケア機器・サービス           |
| DSV PANALPINA A/S         |                  | 78          | 105         | 7,755       | 124,856             | 運輸                     |
| GENMAB A/S                |                  | 25          | 30          | 4,662       | 75,070              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| H LUNDBECK A/S            |                  | 28          | 33          | 797         | 12,846              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ISS A/S                   |                  | 69          | 75          | 1,142       | 18,391              | 商業・専門サービス              |
| NOVO-NORDISK A/S          |                  | 748         | 841         | 32,356      | 520,938             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVOZYMES A/S             |                  | 89          | 100         | 3,154       | 50,794              | 素材                     |
| ORSTED A/S                |                  | 78          | 90          | 5,519       | 88,869              | 公益事業                   |
| PANDORA A/S               |                  | 45          | 47          | 1,316       | 21,203              | 耐久消費財・アパレル             |
| TRYGVESTA AS              |                  | 52          | 59          | 1,081       | 17,418              | 保険                     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S   |                  | 80          | 90          | 5,759       | 92,729              | 資本財                    |
| 小計                        | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,771<br>17 | 1,998<br>17 | 84,165<br>- | 1,355,063<br><0.6%> |                        |
| <b>(ノルウェー)</b>            |                  |             |             | 千ノルウェー・クローネ |                     |                        |
| AKER BP ASA               |                  | 44          | 52          | 1,380       | 16,415              | エネルギー                  |
| DNB ASA                   |                  | 398         | 462         | 7,665       | 91,146              | 銀行                     |
| EQUINOR ASA               |                  | 479         | 475         | 8,263       | 98,254              | エネルギー                  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA |                  | 84          | 98          | 1,678       | 19,959              | 保険                     |
| MOWI ASA                  |                  | 182         | 210         | 4,706       | 55,961              | 食品・飲料・タバコ              |
| NORSK HYDRO ASA           |                  | 552         | 636         | 2,112       | 25,115              | 素材                     |
| ORKLA ASA                 |                  | 340         | 368         | 3,238       | 38,505              | 食品・飲料・タバコ              |
| SCHIBSTED ASA-B SHS       |                  | 41          | 47          | 1,183       | 14,075              | メディア・娯楽                |
| TELENOR ASA               |                  | 311         | 360         | 6,042       | 71,844              | 電気通信サービス               |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                              |         | 期首(前期末) |        | 当期末         |           | 業種等                |
|---------------------------------|---------|---------|--------|-------------|-----------|--------------------|
|                                 |         | 株数      | 株数     | 評価額         |           |                    |
|                                 |         |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                    |
| <b>(ノルウェー)</b>                  |         | 百株      | 百株     | 千ノルウェークローネ  | 千円        |                    |
| YARA INTERNATIONAL ASA          |         | 73      | 85     | 2,907       | 34,566    | 素材                 |
| 小計                              | 株数・金額   | 2,510   | 2,798  | 39,179      | 465,845   |                    |
|                                 | 銘柄数<比率> | 10      | 10     | -           | <0.2%>    |                    |
| <b>(スウェーデン)</b>                 |         |         |        | 千スウェーデンクローナ |           |                    |
| ALFA LAVAL AB                   |         | 122     | 150    | 3,481       | 39,207    | 資本財                |
| ASSA ABLOY AB                   |         | 415     | 479    | 10,973      | 123,561   | 資本財                |
| ATLAS COPCO AB                  |         | 159     | 184    | 5,828       | 65,623    | 資本財                |
| ATLAS COPCO AB-A SHS            |         | 277     | 319    | 11,502      | 129,519   | 資本財                |
| BOLIDEN AB                      |         | 111     | 127    | 3,324       | 37,430    | 素材                 |
| ELECTROLUX AB                   |         | 99      | 108    | 2,654       | 29,885    | 耐久消費財・アパレル         |
| EPIROC AB-A                     |         | 274     | 317    | 3,509       | 39,516    | 資本財                |
| EPIROC AB-B                     |         | 160     | 185    | 1,982       | 22,319    | 資本財                |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B             |         | 252     | 291    | 8,898       | 100,195   | 家庭用品・パーソナル用品       |
| HENNES & MAURITZ AB             |         | 362     | 383    | 7,029       | 79,150    | 小売                 |
| HEXAGON AB-B SHS                |         | 107     | 124    | 6,518       | 73,403    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HUSQVARNA AB-B SHS              |         | 175     | 201    | 1,537       | 17,306    | 耐久消費財・アパレル         |
| ICA GRUPPEN AB                  |         | 35      | 45     | 1,881       | 21,186    | 食品・生活必需品小売り        |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS         |         | 73      | 77     | 1,766       | 19,893    | 各種金融               |
| INVESTOR AB                     |         | 187     | 217    | 10,977      | 123,607   | 各種金融               |
| KINNEVIK AB - B                 |         | 101     | 117    | 2,571       | 28,952    | 各種金融               |
| KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE    |         | -       | 117    | 657         | 7,403     | 各種金融               |
| LUNDBERGS AB-B SHS              |         | 29      | 35     | 1,386       | 15,613    | 各種金融               |
| LUNDIN PETROLEUM AB             |         | 78      | 90     | 2,701       | 30,423    | エネルギー              |
| NORDEA BANK ABP                 |         | 1,263   | 1,554  | 10,918      | 122,947   | 銀行                 |
| SANDVIK AB                      |         | 465     | 535    | 9,342       | 105,199   | 資本財                |
| SECURITAS AB                    |         | 133     | 152    | 2,438       | 27,462    | 商業・専門サービス          |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A    |         | 684     | 790    | 6,482       | 72,997    | 銀行                 |
| SKANSKA AB-B SHS                |         | 143     | 163    | 3,485       | 39,249    | 資本財                |
| SKF AB                          |         | 157     | 181    | 3,281       | 36,948    | 資本財                |
| SVENSKA HANDELSBANKEN           |         | 639     | 742    | 7,113       | 80,102    | 銀行                 |
| SWEDBANK AB - A SHARES          |         | 379     | 436    | 5,684       | 64,011    | 銀行                 |
| SWEDISH MATCH AB                |         | 73      | 81     | 3,710       | 41,774    | 食品・飲料・タバコ          |
| TELE2 AB                        |         | 217     | 250    | 3,521       | 39,653    | 電気通信サービス           |
| TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON |         | 1,273   | 1,469  | 12,941      | 145,718   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELIA CO AB                     |         | 1,215   | 1,367  | 5,779       | 65,081    | 電気通信サービス           |
| VOLVO AB                        |         | 647     | 708    | 10,494      | 118,173   | 資本財                |
| 小計                              | 株数・金額   | 10,318  | 12,010 | 174,380     | 1,963,520 |                    |
|                                 | 銘柄数<比率> | 31      | 32     | -           | <0.9%>    |                    |

## 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         |             |             | 業種等                    |        |
|-------------------------------|------------------|-------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
|                               |                  | 株数          | 株数          | 評価額         |                        |        |
|                               |                  |             |             | 外貨建金額       |                        | 邦貨換算金額 |
| <b>(ユーロ/アイルランド)</b>           | 百株               | 百株          | 千ユーロ        | 千円          |                        |        |
| AIB GROUP PLC                 | 347              | 383         | 107         | 12,961      | 銀行                     |        |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC     | 415              | 454         | 195         | 23,529      | 銀行                     |        |
| CRH PLC                       | 340              | 381         | 1,282       | 154,332     | 素材                     |        |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.    | 33               | 36          | 365         | 44,013      | 消費者サービス                |        |
| KERRY GROUP PLC-A             | 66               | 75          | 874         | 105,178     | 食品・飲料・タバコ              |        |
| KINGSPAN GROUP PLC            | 65               | 73          | 363         | 43,730      | 資本財                    |        |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC       | 94               | 107         | 339         | 40,884      | 素材                     |        |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,363<br>7  | 1,512<br>7  | 3,529<br>-  | 424,629<br><0.2%>      |        |
| <b>(ユーロ/オランダ)</b>             |                  |             |             |             |                        |        |
| ABN AMRO BANK NV              | 176              | 203         | 329         | 39,635      | 銀行                     |        |
| ADYEN NV                      | 3                | 4           | 323         | 38,970      | ソフトウェア・サービス            |        |
| AEGON NV                      | 729              | 841         | 350         | 42,176      | 保険                     |        |
| AIRBUS SE                     | 240              | 278         | 3,763       | 452,857     | 資本財                    |        |
| AKZO NOBEL NV                 | 93               | 108         | 957         | 115,204     | 素材                     |        |
| ASML HOLDING NV               | 168              | 202         | 4,961       | 596,933     | 半導体・半導体製造装置            |        |
| CNH INDUSTRIAL NV             | 419              | 485         | 479         | 57,679      | 資本財                    |        |
| EXOR NV                       | 44               | 51          | 362         | 43,662      | 各種金融                   |        |
| FERRARI NV                    | 50               | 58          | 861         | 103,657     | 自動車・自動車部品              |        |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV  | 445              | 515         | 728         | 87,611      | 自動車・自動車部品              |        |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 47               | 54          | 481         | 57,887      | 食品・飲料・タバコ              |        |
| HEINEKEN NV                   | 106              | 123         | 1,156       | 139,183     | 食品・飲料・タバコ              |        |
| ING GROEP NV-CVA              | 1,600            | 1,849       | 1,948       | 234,432     | 銀行                     |        |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 489              | 564         | 1,355       | 163,038     | 食品・生活必需品小売り            |        |
| KONINKLIJKE DSM NV            | 74               | 86          | 1,006       | 121,102     | 素材                     |        |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 381              | 440         | 1,812       | 218,063     | ヘルスケア機器・サービス           |        |
| NN GROUP NV                   | 126              | 143         | 505         | 60,823      | 保険                     |        |
| QIAGEN NV                     | 95               | 107         | 400         | 48,243      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| RANDSTAD NV                   | 48               | 55          | 284         | 34,251      | 商業・専門サービス              |        |
| ROYAL KPN NV                  | 1,430            | 1,754       | 487         | 58,656      | 電気通信サービス               |        |
| STMICROELECTRONICS NV         | 282              | 324         | 710         | 85,428      | 半導体・半導体製造装置            |        |
| UNILEVER NV                   | 637              | -           | -           | -           | 家庭用品・パーソナル用品           |        |
| UNILEVER NV                   | -                | 695         | 3,721       | 447,830     | 家庭用品・パーソナル用品           |        |
| VOPAK                         | 29               | 33          | 168         | 20,309      | エネルギー                  |        |
| WOLTERS KLUWER NV             | 115              | 133         | 866         | 104,296     | 商業・専門サービス              |        |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,836<br>24 | 9,116<br>24 | 28,024<br>- | 3,371,936<br><1.6%>    |        |

## 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     |                        |
| <b>(ユーロ／ベルギー)</b>           | 百株               | 百株        | 千ユーロ      | 千円         |                        |
| AGEAS                       | 74               | 84        | 451       | 54,380     | 保険                     |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  | 314              | 362       | 2,602     | 313,167    | 食品・飲料・タバコ              |
| COLRUYT NV                  | 24               | 26        | 124       | 15,038     | 食品・生活必需品小売り            |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 33               | 37        | 352       | 42,437     | 各種金融                   |
| KBC GROEP NV                | 102              | 118       | 798       | 96,082     | 銀行                     |
| PROXIMUS                    | 67               | 77        | 213       | 25,643     | 電気通信サービス               |
| SOLVAY SA                   | 30               | 35        | 358       | 43,122     | 素材                     |
| TELENET GROUP HOLDING NV    | 23               | 23        | 101       | 12,160     | メディア・娯楽                |
| UCB SA                      | 52               | 59        | 435       | 52,355     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UMICORE                     | 86               | 93        | 372       | 44,799     | 素材                     |
| 小計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 809<br>10 | 919<br>10 | 5,811<br>- | 699,189<br><0.3%>      |
| <b>(ユーロ／ルクセンブルグ)</b>        |                  |           |           |            |                        |
| ARCELORMITTAL               | 271              | 312       | 461       | 55,508     | 素材                     |
| RTL GROUP                   | 17               | 19        | 84        | 10,149     | メディア・娯楽                |
| TENARIS SA                  | 193              | 219       | 210       | 25,384     | エネルギー                  |
| 小計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 482<br>3  | 551<br>3  | 756<br>-   | 91,042<br><0.0%>       |
| <b>(ユーロ／フランス)</b>           |                  |           |           |            |                        |
| ACCOR                       | 79               | 87        | 349       | 42,021     | 消費者サービス                |
| ADP                         | 13               | 14        | 262       | 31,556     | 運輸                     |
| AIR LIQUIDE                 | 177              | 225       | 2,739     | 329,657    | 素材                     |
| ALSTOM RGPT                 | 65               | 75        | 293       | 35,309     | 資本財                    |
| AMUNDI SA                   | 25               | 29        | 199       | 23,971     | 各種金融                   |
| ARKEMA                      | 27               | 32        | 308       | 37,068     | 素材                     |
| ATOS SE                     | 39               | 46        | 338       | 40,746     | ソフトウェア・サービス            |
| AXA                         | 797              | 923       | 2,321     | 279,375    | 保険                     |
| BIOMERIEUX                  | 17               | 19        | 156       | 18,794     | ヘルスケア機器・サービス           |
| BNP PARIBAS                 | 462              | 534       | 2,714     | 326,573    | 銀行                     |
| BOLLORE                     | 391              | 453       | 179       | 21,557     | 運輸                     |
| BOUYGUES                    | 91               | 106       | 396       | 47,708     | 資本財                    |
| BUREAU VERITAS SA           | 111              | 138       | 322       | 38,820     | 商業・専門サービス              |
| CAPGEMINI SA                | 65               | 75        | 816       | 98,199     | ソフトウェア・サービス            |
| CARREFOUR SA                | 245              | 282       | 430       | 51,832     | 食品・生活必需品小売り            |
| CASINO GUICHARD PERRACHON   | 23               | 26        | 118       | 14,228     | 食品・生活必需品小売り            |
| CIE DE SAINT-GOBAIN         | 203              | 233       | 863       | 103,906    | 資本財                    |
| CNP ASSURANCES              | 73               | 83        | 147       | 17,759     | 保険                     |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                  | 期首(前期末) |     | 当期末   |         | 業種等                    |
|-------------------------------------|---------|-----|-------|---------|------------------------|
|                                     | 株数      | 株数  | 評価額   |         |                        |
|                                     |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (ユーロ/フランス)                          | 百株      | 百株  | 千ユーロ  | 千円      |                        |
| CREDIT AGRICOLE SA                  | 474     | 547 | 687   | 82,687  | 銀行                     |
| DANONE                              | 254     | 294 | 2,198 | 264,499 | 食品・飲料・タバコ              |
| DASSAULT AVIATION SA                | 1       | 1   | 150   | 18,140  | 資本財                    |
| DASSAULT SYSTEMES SA                | 54      | 62  | 875   | 105,289 | ソフトウェア・サービス            |
| EDENRED                             | 99      | 115 | 549   | 66,101  | 商業・専門サービス              |
| EDF                                 | 249     | 288 | 266   | 32,114  | 公益事業                   |
| EIFFAGE                             | 32      | 37  | 381   | 45,943  | 資本財                    |
| ENGIE                               | 753     | 869 | 1,235 | 148,598 | 公益事業                   |
| ESSILORLUXOTTICA                    | 119     | 135 | 1,897 | 228,328 | 耐久消費財・アパレル             |
| EURAZEO                             | 20      | 19  | 121   | 14,643  | 各種金融                   |
| EUROFINS SCIENTIFIC                 | 4       | 5   | 255   | 30,724  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS             | 75      | 86  | 140   | 16,850  | メディア・娯楽                |
| FAURECIA                            | 31      | 36  | 170   | 20,570  | 自動車・自動車部品              |
| GETLINK SE - REGR                   | 207     | 227 | 354   | 42,658  | 運輸                     |
| HERMES INTERNATIONAL                | 13      | 15  | 998   | 120,122 | 耐久消費財・アパレル             |
| ILIAD SA                            | 11      | 13  | 149   | 17,988  | 電気通信サービス               |
| IMERYS SA                           | 15      | 17  | 63    | 7,636   | 素材                     |
| INGENICO GROUP                      | 24      | 28  | 281   | 33,844  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| IPSEN                               | 15      | 17  | 174   | 20,979  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JC DECAUX SA                        | 32      | 37  | 98    | 11,827  | メディア・娯楽                |
| KERING                              | 31      | 36  | 1,983 | 238,612 | 耐久消費財・アパレル             |
| LEGRAND SA                          | 110     | 127 | 915   | 110,113 | 資本財                    |
| L'OREAL SA                          | 103     | 120 | 3,133 | 377,055 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 114     | 132 | 5,268 | 633,868 | 耐久消費財・アパレル             |
| MICHELIN (C.G.D.E.)                 | 70      | 81  | 916   | 110,228 | 自動車・自動車部品              |
| NATIXIS                             | 402     | 462 | 184   | 22,204  | 各種金融                   |
| ORANGE S.A.                         | 842     | 968 | 1,417 | 170,559 | 電気通信サービス               |
| PERNOD-RICARD                       | 87      | 101 | 1,724 | 207,546 | 食品・飲料・タバコ              |
| PEUGEOT SA                          | 244     | 280 | 636   | 76,538  | 自動車・自動車部品              |
| PUBLICIS GROUPE                     | 89      | 102 | 406   | 48,912  | メディア・娯楽                |
| REMY COINTREAU                      | 9       | 10  | 131   | 15,809  | 食品・飲料・タバコ              |
| RENAULT SA                          | 79      | 91  | 404   | 48,650  | 自動車・自動車部品              |
| REXEL SA                            | 127     | -   | -     | -       | 資本財                    |
| SAFRAN SA                           | 137     | 156 | 2,320 | 279,193 | 資本財                    |
| SANOFI                              | 465     | 536 | 4,455 | 536,119 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH            | 11      | 13  | 179   | 21,618  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 226     | 261 | 2,284 | 274,867 | 資本財                    |
| SCOR REGROUPE                       | 68      | 75  | 284   | 34,269  | 保険                     |
| SEB SA                              | 9       | 10  | 151   | 18,261  | 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  |                        |  |
| <b>(ユーロ/フランス)</b>            | 百株               | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |                        |  |
| SOCIETE BIC SA               | 10               | 12     | 75     | 9,027   | 商業・専門サービス              |  |
| SOCIETE GENERALE             | 316              | 365    | 1,038  | 124,904 | 銀行                     |  |
| SODEXO                       | 36               | 42     | 449    | 54,051  | 消費者サービス                |  |
| SUEZ                         | 157              | 165    | 214    | 25,859  | 公益事業                   |  |
| TELEPERFORMANCE              | 24               | 28     | 599    | 72,143  | 商業・専門サービス              |  |
| THALES SA                    | 44               | 50     | 461    | 55,582  | 資本財                    |  |
| TOTAL SA                     | 995              | 1,137  | 5,559  | 668,958 | エネルギー                  |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 32               | 39     | 199    | 24,050  | メディア・娯楽                |  |
| VALEO SA                     | 99               | 115    | 414    | 49,836  | 自動車・自動車部品              |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 223              | 257    | 588    | 70,770  | 公益事業                   |  |
| VINCI SA                     | 210              | 243    | 2,469  | 297,140 | 資本財                    |  |
| VIVENDI SA                   | 433              | 439    | 1,089  | 131,115 | メディア・娯楽                |  |
| WENDEL                       | 12               | 13     | 167    | 20,190  | 各種金融                   |  |
| WORLDFINE SA                 | 15               | 39     | 217    | 26,189  | ソフトウェア・サービス            |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 11,248 | 12,769 | 64,352  | 7,742,886              |  |
|                              |                  | 71     | 70     | -       | <3.7%>                 |  |
| <b>(ユーロ/ドイツ)</b>             |                  |        |        |         |                        |  |
| 1 AND 1 DRILLISCH AG         | 23               | 26     | 66     | 8,010   | 電気通信サービス               |  |
| ADIDAS AG                    | 74               | 85     | 2,339  | 281,444 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ALLIANZ SE                   | 174              | 201    | 4,408  | 530,437 | 保険                     |  |
| AROUNDTOWN SA                | 329              | 443    | 345    | 41,599  | 不動産                    |  |
| AXEL SPRINGER SE             | 21               | 23     | 147    | 17,710  | メディア・娯楽                |  |
| BASF SE                      | 377              | 436    | 3,042  | 366,096 | 素材                     |  |
| BAYER AG                     | 384              | 444    | 3,117  | 375,062 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 135              | 156    | 1,148  | 138,235 | 自動車・自動車部品              |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 24               | 28     | 157    | 18,892  | 自動車・自動車部品              |  |
| BEIERSDORF AG                | 41               | 47     | 507    | 61,078  | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| BRENNTAG AG                  | 63               | 72     | 344    | 41,508  | 資本財                    |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | -                | 19     | 201    | 24,191  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| COMMERZBANK AG               | 404              | 464    | 238    | 28,662  | 銀行                     |  |
| CONTINENTAL AG               | 45               | 52     | 641    | 77,206  | 自動車・自動車部品              |  |
| COVESTRO AG                  | 78               | 81     | 355    | 42,793  | 素材                     |  |
| DAIMLER AG                   | 375              | 433    | 2,173  | 261,549 | 自動車・自動車部品              |  |
| DELIVERY HERO SE             | 38               | 54     | 239    | 28,799  | 小売                     |  |
| DEUTSCHE BANK AG             | 808              | 934    | 615    | 74,092  | 各種金融                   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 78               | 90     | 1,254  | 150,924 | 各種金融                   |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG        | 98               | 112    | 199    | 23,959  | 運輸                     |  |
| DEUTSCHE POST AG             | 408              | 473    | 1,629  | 196,044 | 運輸                     |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG          | 1,392            | 1,606  | 2,434  | 292,887 | 電気通信サービス               |  |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                | 期首(前期末) |       | 当期末   |         | 業種等                    |
|-----------------------------------|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                                   | 株数      | 株数    | 評価額   |         |                        |
|                                   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (ユーロ/ドイツ)                         | 百株      | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |                        |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 148     | 171   | 606   | 73,031  | 不動産                    |
| E.ON SE                           | 904     | 1,048 | 956   | 115,026 | 公益事業                   |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 66      | 87    | 226   | 27,233  | 素材                     |
| FRAPORT AG                        | 18      | 21    | 166   | 20,076  | 運輸                     |
| FRESENIUS SE & CO KGAA            | 172     | 198   | 966   | 116,229 | ヘルスケア機器・サービス           |
| FUCHS PETROLUB AG -PFD            | 28      | 31    | 125   | 15,135  | 素材                     |
| GEA GROUP AG                      | 66      | 73    | 211   | 25,395  | 資本財                    |
| HANNOVER RUECK SE                 | 24      | 28    | 475   | 57,169  | 保険                     |
| HEIDELBERGCEMENT AG               | 60      | 69    | 467   | 56,252  | 素材                     |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 43      | 50    | 439   | 52,825  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HENKEL KGAA-VORZUG                | 72      | 83    | 796   | 95,826  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HOCHTIEF AG                       | 8       | 11    | 130   | 15,696  | 資本財                    |
| HUGO BOSS AG                      | 25      | 29    | 122   | 14,683  | 耐久消費財・アパレル             |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 466     | 592   | 1,142 | 137,515 | 半導体・半導体製造装置            |
| INNOGY SE                         | 58      | -     | -     | -       | 公益事業                   |
| KION GROUP AG                     | 29      | 30    | 185   | 22,340  | 資本財                    |
| KNORR-BREMSE AG                   | -       | 23    | 200   | 24,093  | 資本財                    |
| LANXESS                           | 35      | 40    | 253   | 30,496  | 素材                     |
| MERCK KGAA                        | 53      | 61    | 664   | 79,921  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METRO AG                          | 75      | 86    | 128   | 15,430  | 食品・生活必需品小売り            |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG       | 21      | 24    | 611   | 73,584  | 資本財                    |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG  | 61      | 68    | 1,759 | 211,662 | 保険                     |
| OSRAM LICHT AG                    | 39      | -     | -     | -       | 資本財                    |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF | 61      | 71    | 483   | 58,128  | 自動車・自動車部品              |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG      | 98      | -     | -     | -       | メディア・娯楽                |
| PUMA AG                           | 3       | 39    | 268   | 32,252  | 耐久消費財・アパレル             |
| RWE AG                            | 213     | 260   | 688   | 82,796  | 公益事業                   |
| SAP SE                            | 404     | 467   | 5,738 | 690,429 | ソフトウェア・サービス            |
| SARTORIUS AG-VORZUG               | 14      | 16    | 308   | 37,158  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SIEMENS AG                        | 315     | 363   | 4,164 | 501,055 | 資本財                    |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG           | 61      | 71    | 309   | 37,236  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYMRISE AG                        | 51      | 61    | 524   | 63,082  | 素材                     |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI      | 358     | 487   | 133   | 16,085  | 電気通信サービス               |
| THYSSENKRUPP AG                   | 181     | 194   | 259   | 31,239  | 素材                     |
| UNIPER SE                         | 83      | 95    | 275   | 33,164  | 公益事業                   |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 51      | 59    | 177   | 21,389  | 電気通信サービス               |
| VOLKSWAGEN AG                     | 13      | 16    | 292   | 35,228  | 自動車・自動車部品              |
| VOLKSWAGEN AG                     | 75      | 87    | 1,547 | 186,149 | 自動車・自動車部品              |
| VONOVIA SE                        | 204     | 243   | 1,166 | 140,405 | 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    |                        |
| <b>(ユーロ/ドイツ)</b>                   |                  | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| WIRECARD AG                        |                  | 48      | 56     | 679    | 81,711    | ソフトウェア・サービス            |
| ZALANDO SE                         |                  | 46      | 59     | 229    | 27,667    | 小売                     |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 10,147  | 11,775 | 53,490 | 6,435,996 |                        |
|                                    |                  | 61      | 60     | -      | <3.0%>    |                        |
| <b>(ユーロ/ポルトガル)</b>                 |                  |         |        |        |           |                        |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA            |                  | 1,058   | 1,223  | 456    | 54,877    | 公益事業                   |
| GALP ENERGIA SGPS SA               |                  | 204     | 237    | 361    | 43,490    | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS                   |                  | 103     | 119    | 177    | 21,310    | 食品・生活必需品小売り            |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,366   | 1,579  | 994    | 119,678   |                        |
|                                    |                  | 3       | 3      | -      | <0.1%>    |                        |
| <b>(ユーロ/スペイン)</b>                  |                  |         |        |        |           |                        |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV        |                  | 104     | 124    | 433    | 52,211    | 資本財                    |
| AENA SME SA                        |                  | 28      | 33     | 560    | 67,411    | 運輸                     |
| AMADEUS IT GROUP SA                |                  | 180     | 208    | 1,500  | 180,496   | ソフトウェア・サービス            |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA |                  | 2,735   | 3,150  | 1,500  | 180,504   | 銀行                     |
| BANCO DE SABADELL SA               |                  | 2,300   | 2,645  | 261    | 31,486    | 銀行                     |
| BANCO SANTANDER SA                 |                  | 6,673   | 7,696  | 2,734  | 329,006   | 銀行                     |
| BANKIA SA                          |                  | 505     | 580    | 99     | 12,029    | 銀行                     |
| BANKINTER SA                       |                  | 277     | 321    | 197    | 23,814    | 銀行                     |
| CAIXABANK                          |                  | 1,471   | 1,702  | 453    | 54,557    | 銀行                     |
| CELLNEX TELECOM SAU                |                  | -       | 95     | 352    | 42,414    | 電気通信サービス               |
| ENAGAS SA                          |                  | 95      | 109    | 250    | 30,146    | 公益事業                   |
| ENDESA SA                          |                  | 130     | 151    | 369    | 44,512    | 公益事業                   |
| FERROVIAL S.A.                     |                  | 206     | 234    | 619    | 74,497    | 資本財                    |
| FERROVIAL SA-RTS                   |                  | 206     | -      | -      | -         | 資本財                    |
| FERROVIAL SA-RTS                   |                  | -       | 234    | 9      | 1,176     | 資本財                    |
| GRIFOLS SA                         |                  | 123     | 142    | 422    | 50,825    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IBERDROLA SA                       |                  | 2,560   | 2,859  | 2,549  | 306,715   | 公益事業                   |
| INDITEX SA                         |                  | 449     | 518    | 1,433  | 172,484   | 小売                     |
| MAPFRE SA                          |                  | 442     | 496    | 125    | 15,059    | 保険                     |
| NATURGY ENERGY GROUP SA            |                  | 147     | 145    | 345    | 41,620    | 公益事業                   |
| RED ELECTRICA DE ESPANA            |                  | 178     | 205    | 353    | 42,528    | 公益事業                   |
| REPSOL SA                          |                  | 572     | 689    | 1,007  | 121,188   | エネルギー                  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY    |                  | 98      | 114    | 155    | 18,679    | 資本財                    |
| TELEFONICA SA                      |                  | 1,945   | 2,246  | 1,511  | 181,853   | 電気通信サービス               |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,436  | 24,706 | 17,247 | 2,075,219 |                        |
|                                    |                  | 22      | 23     | -      | <1.0%>    |                        |
| <b>(ユーロ/イタリア)</b>                  |                  |         |        |        |           |                        |
| ASSICURAZIONI GENERALI SPA         |                  | 483     | 521    | 974    | 117,311   | 保険                     |

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                 | 期首(前期末)          | 当期末          |              |             | 業種等                    |
|------------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|
|                                    | 株数               | 株数           | 評価額          |             |                        |
|                                    |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額      |                        |
| <b>(ユーロ/イタリア)</b>                  | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円          |                        |
| ATLANTIA SPA                       | 208              | 241          | 543          | 65,435      | 運輸                     |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA          | 240              | 276          | 228          | 27,474      | 食品・飲料・タバコ              |
| ENEL SPA                           | 3,352            | 3,874        | 2,646        | 318,430     | 公益事業                   |
| ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA | 1,048            | 1,207        | 1,687        | 203,013     | エネルギー                  |
| FINECOBANK SPA                     | -                | 288          | 323          | 38,933      | 銀行                     |
| INTESA SANPAOLO                    | 6,148            | 7,095        | 1,665        | 200,382     | 銀行                     |
| LEONARDO SPA                       | 165              | 190          | 212          | 25,576      | 資本財                    |
| MEDIOBANCA SPA                     | 256              | 295          | 303          | 36,547      | 銀行                     |
| MONCLER SPA                        | 73               | 85           | 316          | 38,112      | 耐久消費財・アパレル             |
| PIRELLI & C SPA                    | 171              | 196          | 102          | 12,311      | 自動車・自動車部品              |
| POSTE ITALIANE SPA                 | 221              | 253          | 276          | 33,215      | 保険                     |
| PRYSMIAN SPA                       | 99               | 115          | 229          | 27,664      | 資本財                    |
| RECORDATI SPA                      | 43               | 50           | 185          | 22,272      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SNAM SPA                           | 951              | 988          | 449          | 54,075      | 公益事業                   |
| TELECOM ITALIA SPA                 | 6,980            | 7,132        | 392          | 47,283      | 電気通信サービス               |
| TERNA SPA                          | 585              | 674          | 391          | 47,102      | 公益事業                   |
| UNICREDIT SPA                      | 825              | 950          | 1,175        | 141,481     | 銀行                     |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,855<br>17 | 24,439<br>18 | 12,106<br>- | 1,456,627<br><0.7%>    |
| <b>(ユーロ/フィンランド)</b>                |                  |              |              |             |                        |
| ELISA OYJ                          | 60               | 69           | 341          | 41,042      | 電気通信サービス               |
| FORTUM OYJ                         | 182              | 211          | 447          | 53,897      | 公益事業                   |
| KONE OYJ                           | 139              | 161          | 917          | 110,453     | 資本財                    |
| METSO OYJ                          | 42               | 49           | 167          | 20,204      | 資本財                    |
| NESTE OYJ                          | 158              | 201          | 631          | 76,009      | エネルギー                  |
| NOKIA OYJ                          | 2,330            | 2,688        | 835          | 100,522     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                 | 48               | 58           | 153          | 18,474      | 自動車・自動車部品              |
| ORION OYJ-CLASS B                  | 42               | 49           | 195          | 23,582      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAMPO OYJ                          | 183              | 212          | 780          | 93,907      | 保険                     |
| STORA ENSO OYJ                     | 221              | 270          | 335          | 40,395      | 素材                     |
| UPM-KYMMENE OYJ                    | 217              | 250          | 766          | 92,170      | 素材                     |
| WARTSILA OYJ                       | 181              | 209          | 190          | 22,935      | 資本財                    |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,810<br>12  | 4,432<br>12  | 5,764<br>-  | 693,595<br><0.3%>      |
| <b>(ユーロ/オーストリア)</b>                |                  |              |              |             |                        |
| ANDRITZ AG                         | 30               | 35           | 136          | 16,423      | 資本財                    |
| ERSTE GROUP BANK AG                | 124              | 143          | 468          | 56,328      | 銀行                     |
| OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A          | 27               | 32           | 142          | 17,156      | 公益事業                   |
| OMV AG                             | 60               | 69           | 368          | 44,292      | 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      |              |
| <b>(ユーロ/オーストリア)</b>                   |         | 百株      | 百株      | 千ユーロ    | 千円          |              |
| RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING          |         | 60      | 69      | 152     | 18,395      | 銀行           |
| VOESTALPINE AG                        |         | 46      | 53      | 126     | 15,256      | 素材           |
| 小計                                    | 株数・金額   | 349     | 403     | 1,395   | 167,852     |              |
|                                       | 銘柄数<比率> | 6       | 6       | -       | <0.1%>      |              |
| <b>(ユーロ/その他)</b>                      |         |         |         |         |             |              |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA |         | 89      | 102     | 685     | 82,495      | ヘルスケア機器・サービス |
| 小計                                    | 株数・金額   | 89      | 102     | 685     | 82,495      |              |
|                                       | 銘柄数<比率> | 1       | 1       | -       | <0.0%>      |              |
| ユーロ計                                  | 株数・金額   | 80,796  | 92,308  | 194,158 | 23,361,149  |              |
|                                       | 銘柄数<比率> | 237     | 237     | -       | <11.1%>     |              |
| 合計                                    | 株数・金額   | 509,058 | 568,479 | -       | 199,297,460 |              |
|                                       | 銘柄数<比率> | 1,243   | 1,256   | -       | <94.4%>     |              |

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。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G I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国 (外貨建) 投資信託証券

| 銘柄                              | 期首(前期末) |     | 当期末   |        |           |
|---------------------------------|---------|-----|-------|--------|-----------|
|                                 | □数      | □数  | 評価額   |        |           |
|                                 |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |           |
| (アメリカ)                          | 千□      | 千□  | 千米ドル  | 千円     |           |
| BOSTON PROPERTIES INC           | 6       | 7   | 1,006 |        | 109,312   |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 17      | 19  | 2,665 |        | 289,537   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT    | 4       | 5   | 853   |        | 92,655    |
| PROLOGIS INC                    | 25      | 29  | 2,722 |        | 295,723   |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT      | 58      | 72  | 661   |        | 71,848    |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 5       | 6   | 1,432 |        | 155,570   |
| CAMDEN PROPERTY TRUST           | 3       | 4   | 513   |        | 55,750    |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC  | 6       | 7   | 437   |        | 47,521    |
| DUKE REALTY CORP                | 14      | 16  | 593   |        | 64,441    |
| EQUITY RESIDENTIAL              | 15      | 17  | 1,532 |        | 166,465   |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC        | 2       | 3   | 1,016 |        | 110,435   |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 3       | 3   | 461   |        | 50,151    |
| HCP INC                         | 19      | 22  | 793   |        | 86,142    |
| WELLTOWER INC                   | 15      | 19  | 1,640 |        | 178,227   |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC     | 30      | 34  | 597   |        | 64,928    |
| KIMCO REALTY CORP               | 17      | 19  | 430   |        | 46,753    |
| LIBERTY PROPERTY TRUST          | 5       | 6   | 424   |        | 46,158    |
| MACERICH CO/THE                 | 4       | 5   | 148   |        | 16,088    |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM      | 4       | 5   | 757   |        | 82,249    |
| PUBLIC STORAGE                  | 6       | 7   | 1,597 |        | 173,550   |
| REGENCY CENTERS CORP            | 6       | 7   | 512   |        | 55,709    |
| SIMON PROPERTY GROUP INC        | 12      | 14  | 2,217 |        | 240,891   |
| SL GREEN REALTY CORP            | 3       | 3   | 331   |        | 36,041    |
| SUN COMMUNITIES INC             | —       | 4   | 723   |        | 78,535    |
| UDR INC                         | 11      | 13  | 666   |        | 72,380    |
| VENTAS INC                      | 14      | 17  | 1,000 |        | 108,703   |
| VORNADO REALTY TRUST            | 6       | 8   | 516   |        | 56,131    |
| WP CAREY INC                    | 6       | 8   | 711   |        | 77,263    |
| REALTY INCOME CORP              | 12      | 15  | 1,167 |        | 126,790   |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES     | —       | 8   | 594   |        | 64,520    |
| EXTRA SPACE STORAGE INC         | 5       | 6   | 652   |        | 70,861    |
| DIGITAL REALTY TRUST INC        | 8       | 9   | 1,211 |        | 131,632   |
| IRON MOUNTAIN INC               | 11      | 13  | 468   |        | 50,910    |
| AGNC INVESTMENT CORP            | 22      | 26  | 463   |        | 50,297    |
| AMERICAN TOWER REIT INC         | 18      | 21  | 4,545 |        | 493,734   |
| EQUINIX INC                     | 3       | 4   | 2,266 |        | 246,116   |
| VEREIT                          | 40      | 46  | 446   |        | 48,467    |
| SBA COMMUNICATIONS CORP         | 4       | 5   | 1,298 |        | 141,065   |
| INVITATION HOMES INC            | 13      | 21  | 645   |        | 70,085    |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC    | 5       | —   | —     |        | —         |
| 小計                              | □数・金額   | 475 | 572   | 40,729 | 4,423,654 |
|                                 | 銘柄数<比率> | 38  | 39    | —      | <2.1%>    |

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   |             |         |
|----------------------------------|------------------|---------|-----|-------|-------------|---------|
|                                  |                  | □数      | □数  | 評価額   |             |         |
|                                  |                  |         |     | 外貨建金額 | 邦貨換算金額      |         |
| <b>(カナダ)</b>                     |                  |         | 千□  | 千□    | 千カナダ・ドル     | 千円      |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM |                  |         | 2   | 3     | 112         | 9,237   |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS     |                  |         | 6   | 7     | 153         | 12,522  |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR      |                  |         | 6   | 7     | 197         | 16,178  |
| 小計                               | □数・金額<br>銘柄数<比率> |         | 15  | 17    | 463         | 37,938  |
|                                  |                  |         | 3   | 3     | —           | <0.0%>  |
| <b>(オーストラリア)</b>                 |                  |         |     |       | 千オーストラリア・ドル |         |
| DEXUS                            |                  |         | 45  | 56    | 684         | 50,724  |
| GPT GROUP                        |                  |         | 83  | 103   | 629         | 46,678  |
| GOODMAN GROUP                    |                  |         | 70  | 81    | 1,203       | 89,243  |
| STOCKLAND                        |                  |         | 109 | 122   | 609         | 45,174  |
| MIRVAC GROUP                     |                  |         | 163 | 202   | 667         | 49,515  |
| VICINITY CENTRES                 |                  |         | 151 | 176   | 474         | 35,210  |
| SCENTRE GROUP                    |                  |         | 231 | 268   | 1,071       | 79,437  |
| 小計                               | □数・金額<br>銘柄数<比率> |         | 854 | 1,012 | 5,341       | 395,984 |
|                                  |                  |         | 7   | 7     | —           | <0.2%>  |
| <b>(香港)</b>                      |                  |         |     |       | 千香港ドル       |         |
| LINK REIT                        |                  |         | 87  | 100   | 8,231       | 114,247 |
| 小計                               | □数・金額<br>銘柄数<比率> |         | 87  | 100   | 8,231       | 114,247 |
|                                  |                  |         | 1   | 1     | —           | <0.1%>  |
| <b>(シンガポール)</b>                  |                  |         |     |       | 千シンガポール・ドル  |         |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT     |                  |         | 110 | 120   | 354         | 28,268  |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST      |                  |         | 107 | 124   | 249         | 19,937  |
| CAPITALAND MALL TRUST            |                  |         | 106 | 123   | 314         | 25,113  |
| SUNTEC REIT                      |                  |         | 88  | 91    | 168         | 13,420  |
| 小計                               | □数・金額<br>銘柄数<比率> |         | 412 | 461   | 1,086       | 86,739  |
|                                  |                  |         | 4   | 4     | —           | <0.0%>  |
| <b>(イギリス)</b>                    |                  |         |     |       | 千イギリス・ポンド   |         |
| BRITISH LAND CO PLC              |                  |         | 37  | 42    | 239         | 33,547  |
| HAMMERSON PLC                    |                  |         | 31  | —     | —           | —       |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        |                  |         | 30  | 33    | 305         | 42,876  |
| SEGRO PLC                        |                  |         | 43  | 51    | 443         | 62,303  |
| 小計                               | □数・金額<br>銘柄数<比率> |         | 142 | 126   | 988         | 138,727 |
|                                  |                  |         | 4   | 3     | —           | <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      |           |
| KLEPIERRE                 | 8       | 9     | 317   | 38,234  |           |
| GECINA SA                 | 1       | 2     | 335   | 40,352  |           |
| COVIVIO                   | 1       | 2     | 236   | 28,442  |           |
| ICADE                     | 1       | 1     | 133   | 16,045  |           |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 5       | 6     | 947   | 113,997 |           |
| 小計                        | 口数・金額   | 19    | 22    | 1,970   | 237,072   |
|                           | 銘柄数<比率> | 5     | 5     | -       | <0.1%>    |
| 合計                        | 口数・金額   | 2,006 | 2,313 | -       | 5,434,364 |
|                           | 銘柄数<比率> | 62    | 62    | -       | <2.6%>    |

(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 | 4,470 | -   |
| 国 FTSE 100             | 441   | -   |
| DJ EURO STOXX 50       | 1,114 | -   |

(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

2019年11月20日現在

| 項目           | 当期末         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評価額         | 比率    |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 199,297,460 | 94.0  |
| 投資信託証券       | 5,434,364   | 2.6   |
| コール・ローン等、その他 | 7,275,391   | 3.4   |
| 投資信託財産総額     | 212,007,217 | 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108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シェケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産(207,877,451千円)の投資信託財産総額(212,007,217千円)に対する比率は98.1%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

(2019年11月20日現在)

| 項目                | 当期末              |
|-------------------|------------------|
| (A)資産             | 215,497,433,277円 |
| コール・ローン等          | 4,865,378,505    |
| 株 式(評価額)          | 199,297,460,924  |
| 投資信託証券(評価額)       | 5,434,364,911    |
| 未 収 入 金           | 3,751,415,239    |
| 未 収 配 当 金         | 290,269,135      |
| 差 入 委 託 証 拠 金     | 1,858,544,563    |
| (B)負債             | 4,454,247,012    |
| 未 払 金             | 3,502,277,259    |
| 未 払 解 約 金         | 951,945,848      |
| そ の 他 未 払 費 用     | 23,905           |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 211,043,186,265  |
| 元 本               | 110,982,930,759  |
| 次 期 繰 越 損 益 金     | 100,060,255,506  |
| (D)受 益 権 総 口 数    | 110,982,930,759口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)   | 19,016円          |

(注1) 期首元本額 97,019,551,907円  
 期中追加設定元本額 24,466,652,299円  
 期中一部解約元本額 10,503,273,447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)               | 705,419,292円    |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)                 | 3,284,755,401円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)               | 2,471,314,789円  |
| ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)            | 1,485,332,737円  |
| ニッセイ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)                          | 4,090,937円      |
| ニッセイインデックスバランス(標準型)                     |                 |
| S A(適格機関投資家限定)                          | 23,976,047円     |
| ニッセイインデックスバランス(成長型)                     |                 |
| S A(適格機関投資家限定)                          | 32,048,288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)          | 11,371,888,952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          | 75,325,693,121円 |
| DCニッセイ外国株式インデックス                        | 15,291,138,731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) | 605,358,530円    |
| DCニッセイターゲットデートファンド2055                  | 59,931,201円     |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)                 | 72,703,499円     |
| DCニッセイターゲットデートファンド2045                  | 39,305,684円     |
| DCニッセイターゲットデートファンド2035                  | 79,667,845円     |
| DCニッセイターゲットデートファンド2025                  | 22,747,558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) | 40,031,114円     |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)                 | 24,696,756円     |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)             | 3,481,454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)          | 995,057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) | 16,196,854円     |
| DCニッセイターゲットデートファンド2060                  | 4,212,091円      |
| DCニッセイターゲットデートファンド2050                  | 3,974,678円      |
| DCニッセイターゲットデートファンド2040                  | 6,685,873円      |
| DCニッセイターゲットデートファンド2030                  | 7,284,270円      |

## 損益の状況

当期(2019年5月21日~2019年11月20日)

| 項目                 | 当期              |
|--------------------|-----------------|
| (A)配 当 等 収 益       | 1,925,753,117円  |
| 受 取 配 当 金          | 1,913,810,907   |
| 受 取 利 息            | 4,764,663       |
| そ の 他 収 益          | 8,275,117       |
| 支 払 利 息            | △ 1,097,570     |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 12,263,335,719  |
| 売 買 損 益            | 18,903,752,207  |
| 売 買 損 益            | △ 6,640,416,488 |
| (C)先 物 取 引 等 損 益   | 193,374,215     |
| 取 引 損 益            | 596,390,171     |
| 取 引 損 益            | △ 403,015,956   |
| (D)信 託 報 酬 等       | △ 38,758,151    |
| (E)当期損益金(A+B+C+D)  | 14,343,704,900  |
| (F)前期繰越損益金         | 75,095,869,816  |
| (G)追加信託差損益金        | 19,154,801,612  |
| (H)解約差損益金          | △ 8,534,120,822 |
| (I)合 計(E+F+G+H)    | 100,060,255,506 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)   | 100,060,255,506 |

(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。

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。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。