

## 第2期末 (2019年11月20日)

基準価額	11,229円
純資産総額	32百万円
騰落率	12.6%
分配金	0円

# ニッセイ・ インデックスパッケージ (内外・株式／リート)

【愛称】 ファンドパック5

追加型投信／内外／資産複合／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2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「ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート)」は、このたび第2期の決算を行いました。

当ファンドは、投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート(不動産投資信託)市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



**ニッセイアセットマネジメント株式会社**

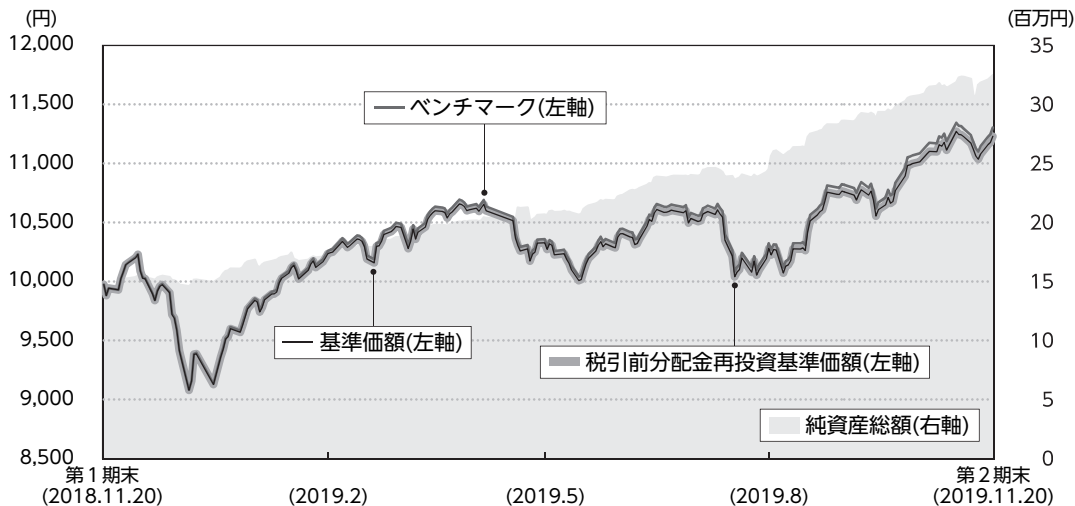
NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2018年11月21日～2019年11月20日

## 基準価額等の推移



第2期首	9,974円	既払分配金	0円
第2期末	11,229円	騰落率 (分配金再投資ベース)	12.6%

- (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、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を5分の1ずつ組み合わせて合成したもので、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

当期の基準価額は為替市場において米ドルが対円で下落したことが下落要因となり、2018年末にかけて世界的な景気減速懸念を受けた国内株式市場の下落などから下落しましたが、期を通じて見ると国内株式市場や国内リート市場、主要な海外株式市場が上昇したことなどが上昇要因となり、上昇して当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5分の1	20.1%	6.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5分の1	20.4	12.5
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	5分の1	20.2	5.1
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	5分の1	19.6	28.5
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	5分の1	19.7	12.2

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.351%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,352円です。
(投信会社)	(17)	(0.162)	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)	(17)	(0.162)	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)	(0.026)	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	2	0.021	
(株式)	(1)	(0.010)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(1)	(0.008)	
有価証券取引税	1	0.006	
(株式)	(0)	(0.005)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.002)	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	12	0.114	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(9)	(0.088)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.010)	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)	(2)	(0.016)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	51	0.492	

(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。

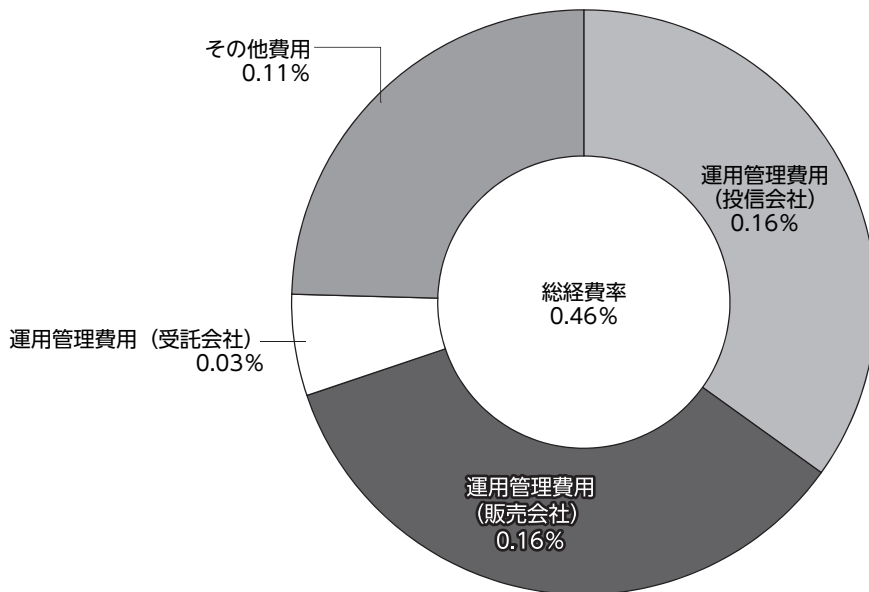
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.46%**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。

## 投資環境

### ■国内株式市況

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初より2018年末にかけて、米中貿易摩擦の深刻化や世界的な景気減速懸念、さらに米政権運営を巡る不透明感などを受けて国内株式市場は大幅に下落しました。2019年1月以降は、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを急がないとの見方が広がったことや中国が景気対策を表明したことなどから、4月末にかけて底堅く推移しました。

5月に入ると米国が中国に対し制裁関税の引き上げを発表したことで、米中貿易摩擦再燃への懸念が高まり国内株式市場は下落に転じました。さらに米国による中国通信機器最大手の華為技術（ファーウェイ）への制裁措置やメキシコに追加関税を課す方針が示され、貿易摩擦の長期化や拡大が世界の景気減速につながるなどの懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が高まったことから、国内株式市場は弱含みしました。しかし、6月末の20カ国・地域首脳会議（G20サミット）で米中貿易摩擦の解決が期待されたことや金融緩和観測などから国内株式市場は上昇傾向となり、米中貿易摩擦再燃への懸念から下落する場面もありましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

### ■先進国株式市況

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。

### ■新興国株式市況

当期の新興国株式市場は上昇しました。

期初以降、米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まりなどを背景に下落しましたが、2019年1月に入ると、FRBのハト派姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に上昇基調が継続しました。5月になると中国経済に予想以上の悪化兆候が見られたことを受けて、世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことから新興国株式市場は一時下落しましたが、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上昇しました。8月は米中貿易摩擦を巡る緊張の高まりから下落しましたが、10月以降は米中貿易摩擦の緩和期待などを背景に上昇する流れとなり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

### ■ Jリート市況

当期のJリート市場は、魅力的な配当利回り水準にあることや良好な不動産賃貸市況を背景とした着実な配当金成長を実現していることに加えて、活発な不動産売買市況を活用した物件入れ替えによる資産価値の顕在化やこれまで以上に収益性に連動した運用報酬体系への移行などのJリート各社による投資主価値向上を目的とした取り組みが評価され、上昇基調で推移しました。期末付近に米中貿易協議の進展に対する期待の高まりを受けて金利が上昇するとともに株式市場で投資家のリスク選好姿勢が強まったことを背景に、これまで上昇基調を続けていたJリート市場からの資金流出が生じたため一時的に下落する場面がありましたが、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

### ■ 先進国リート市況

当期の先進国REIT市場は米中通商協議の進展期待から上昇して始まりました。

12月に入ると米国における経済指標の後退や政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理が悪化したため2019年1月初めにかけて下落しましたが、その後、4月中旬にかけては米長期金利が低下基調であったことや米企業の1-3月期業績が良好であったことを好感して上昇しました。

期末にかけては米中貿易摩擦の動向により下落する場面もありましたが、欧州中央銀行（ECB）による景気刺激策への期待感や良好な米主要株価指標を受けて株式市場が上昇したことから先進国REIT市場もつられて堅調推移となり、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

投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リート（不動産投資信託）市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

### ■各マザーファンド

#### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるT O P I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I 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。

#### <ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークであるM S C I エマージング・マーケット・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。

#### <ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド>

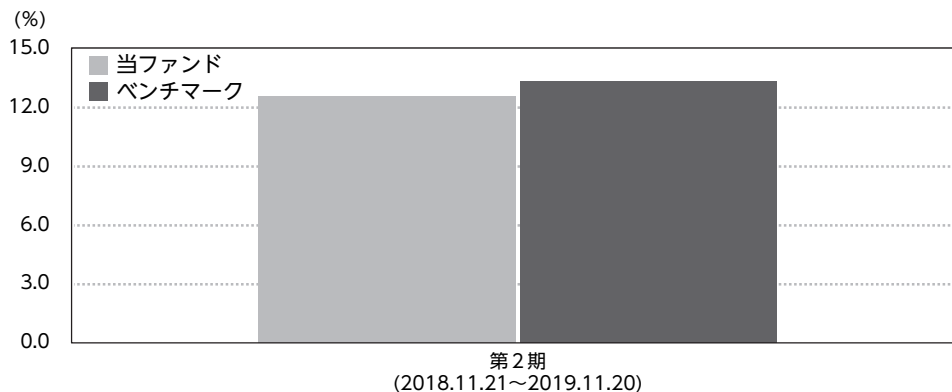
国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークであるS & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

\*ベンチマーク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+12.6%となり、ベンチマーク騰落率(+13.3%)を下回りました。

(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 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	1,228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

投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リート（不動産投資信託）市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

## ■各マザーファンド

### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### <ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### <ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート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2期末 2019年11月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	20.1%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	20.4
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	20.2
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	19.6
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	19.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

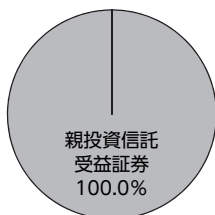
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

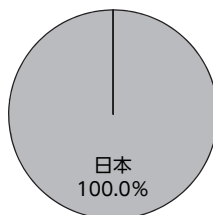
項目	第2期末 2019年11月20日
純資産総額	32,467,014円
受益権総口数	28,914,069口
1万口当たり基準価額	11,229円

(注) 当期間中における追加設定元本額は19,997,893円、同解約元本額は5,514,009円です。

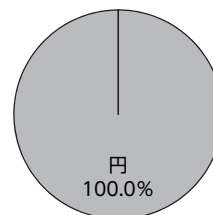
### ■資産別配分



### ■国別配分



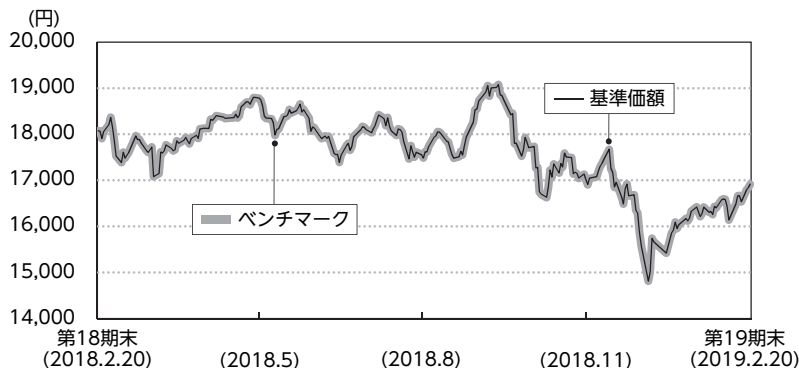
### ■通貨別配分



(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。

## ニッセイ国内株式インデクスマザーファンドの概要

### ■ 基準価額の推移



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

### ■ 上位銘柄

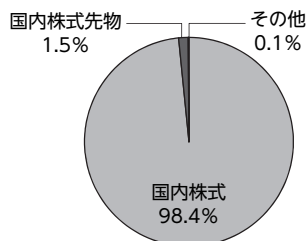
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.2%
ソフトバンクグループ	円	1.8
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
ソニー	円	1.5
日本電信電話	円	1.3
キーエンス	円	1.3
武田薬品工業	円	1.2
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.2
本田技研工業	円	1.1
みずほフィナンシャルグループ	円	1.0
組入銘柄数		1,840

### ■ 1万口当たりの費用明細

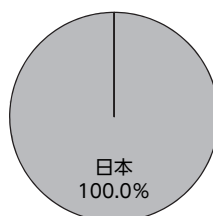
2018.2.21~2019.2.20

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

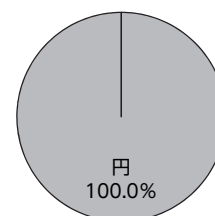
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



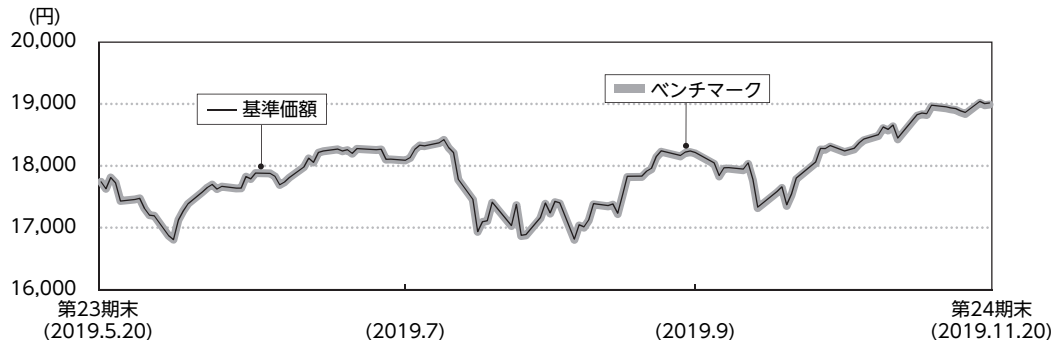
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

## ニッセイ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

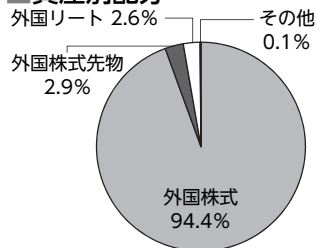
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	3.0%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.7%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.8%
FACEBOOK INC-A	米ドル	1.2%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.0%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9%
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8%
VISA INC-CLASS A SHARES	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,318

### ■ 1万口当たりの費用明細

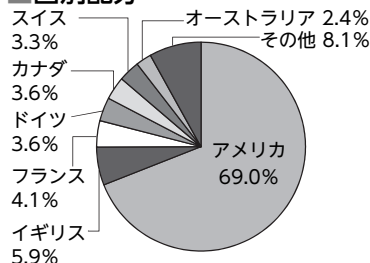
2019.5.21~2019.11.20

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

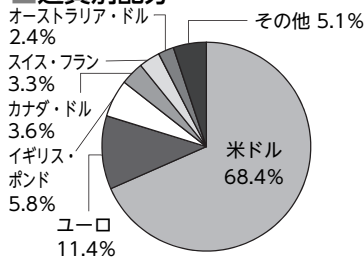
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



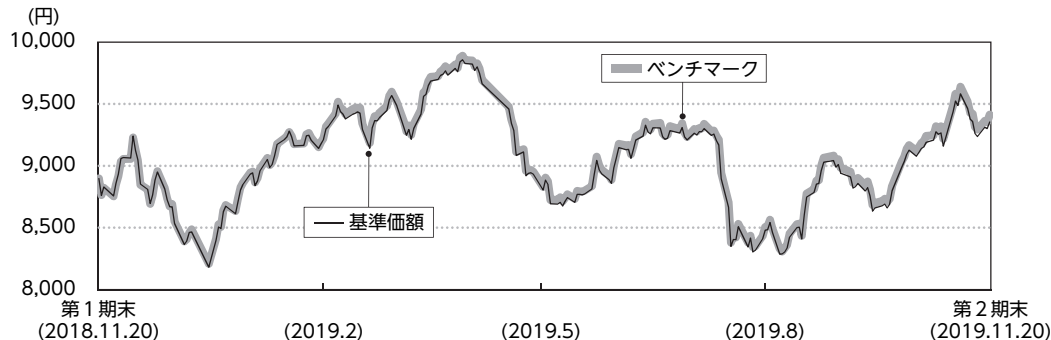
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

## ニッセイ新興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

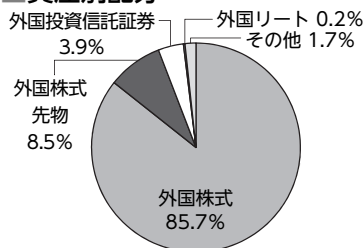
銘柄名	通貨	比率
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	米ドル	4.2%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	4.0%
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	3.9%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.5%
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	2.3%
NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ・ランド	1.5%
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	香港ドル	1.3%
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	香港ドル	1.0%
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	インド・ルピー	1.0%
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	米ドル	1.0%
組入銘柄数		927

### ■ 1万口当たりの費用明細

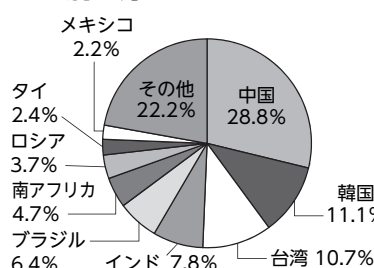
2018.11.21~2019.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	6円 (4)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	1 (1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	37 (31)
(その他)	(6)
合計	44

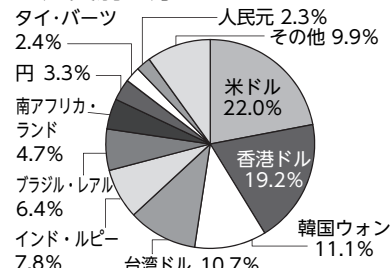
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



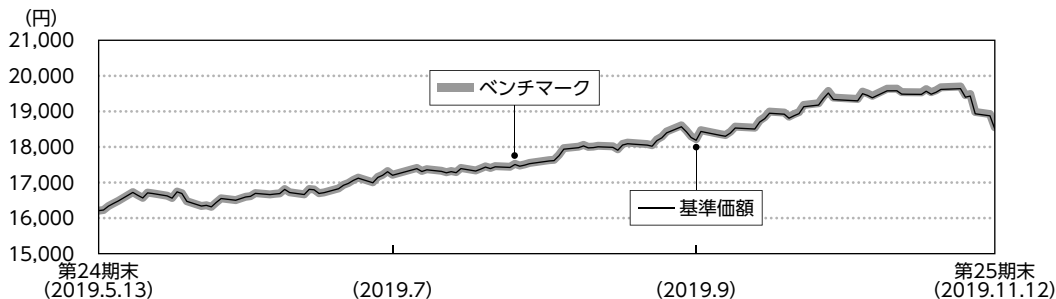
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

## ニッセイJ-REIT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

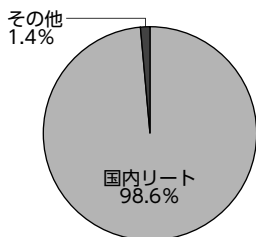
銘柄名	通貨	比率
日本ビルファンド投資法人	円	6.9%
ジャパンリアルエステイト投資法人	円	6.4
野村不動産マスターファンド投資法人	円	5.4
ユナイテッド・アーバン投資法人	円	4.3
オリックス不動産投資法人	円	4.2
日本リテールファンド投資法人	円	4.2
日本プロロジスリート投資法人	円	3.8
大和ハウスリート投資法人	円	3.6
G L P 投資法人	円	3.0
アドバンス・レジデンス投資法人	円	2.9
組入銘柄数		63

### ■ 1万口当たりの費用明細

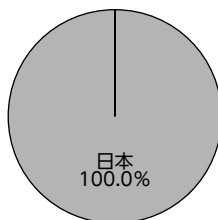
2019.5.14~2019.11.12

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

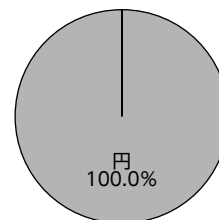
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



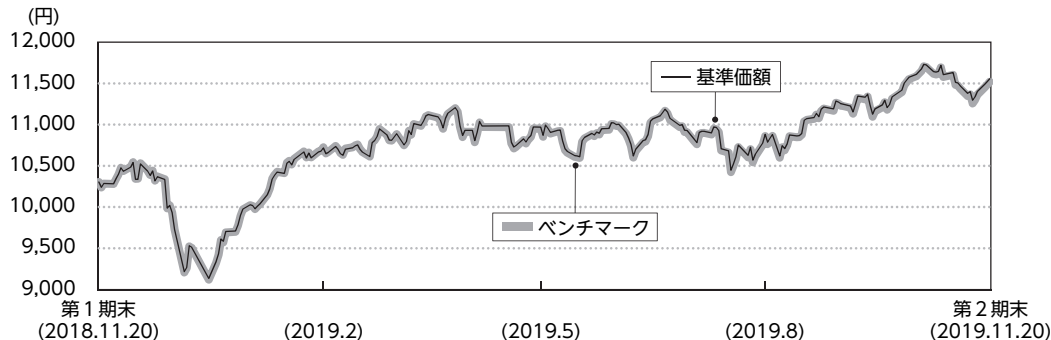
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2019年11月12日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

## ニッセイ先進国リート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

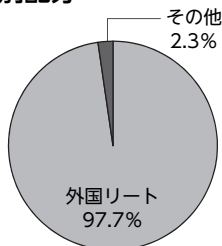
銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	米ドル	4.3%
EQUINIX INC	米ドル	3.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	3.4
WELLTOWER INC	米ドル	2.6
PUBLIC STORAGE	米ドル	2.3
EQUITY RESIDENTIAL	米ドル	2.3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	米ドル	2.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	米ドル	1.9
REALTY INCOME CORP	米ドル	1.8
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	ユーロ	1.7
組入銘柄数		284

### ■ 1万口当たりの費用明細

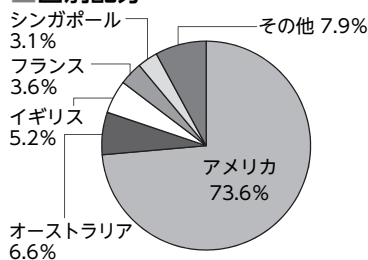
2018.11.21~2019.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	4円 ( 0)
(投資信託証券)	( 4)
有価証券取引税 (株式)	1 ( 0)
(投資信託証券)	( 1)
その他費用 (保管費用)	8 ( 7)
(その他)	( 1)
合計	13

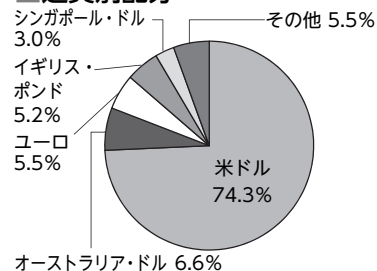
### ■ 資産別配分



### ■ 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。

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金						
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
2017年11月17日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	1
1期(2018年11月20日)	9,974	0	△ 0.3	9,974	10,047	0.5	55.3	2.9	41.0	14
2期(2019年11月20日)	11,229	0	12.6	11,229	11,386	13.3	56.2	2.8	40.0	32

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注6) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注7) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチ マーク	騰落率		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
			%			%			
(期首) 2018年11月20日	円		%			%	%	%	%
11月末	9,974	-		10,047	-		55.3	2.9	41.0
12月末	10,157	1.8		10,233	1.9		55.5	3.0	40.7
2019年1月末	9,386	△ 5.9		9,464	△ 5.8		55.4	2.6	41.2
2月末	9,988	0.1		10,080	0.3		55.8	3.1	40.4
3月末	10,288	3.1		10,393	3.4		55.8	3.6	39.8
4月末	10,417	4.4		10,526	4.8		55.3	2.8	41.1
5月末	10,599	6.3		10,713	6.6		56.2	3.0	39.9
6月末	10,098	1.2		10,204	1.6		54.1	2.9	42.2
7月末	10,362	3.9		10,479	4.3		56.2	3.2	39.8
8月末	10,572	6.0		10,701	6.5		55.1	3.3	40.8
9月末	10,276	3.0		10,399	3.5		54.8	2.5	41.9
10月末	10,731	7.6		10,873	8.2		55.6	3.1	40.5
(期末) 2019年11月20日	11,177	12.1		11,334	12.8		56.3	3.0	39.9
	11,229	12.6		11,386	13.3		56.2	2.8	40.0

(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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	2,746	4,594	811	1,388
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,686	4,716	873	1,563
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	5,252	4,725	1,494	1,377
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	2,691	4,568	1,354	2,318
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	4,169	4,509	1,464	1,601

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期			
	ニッセイ 国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 新興国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 先進国リート インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	16,099,583千円	46,149,416千円	394,911千円	16千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	57,945,432千円	164,761,245千円	1,653,956千円	16千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.27	0.28	0.23	0.99

(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。

## ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)

### 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	口数	評価額
		千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	1,655		3,591	6,518
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,668		3,481	6,620
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	3,257		7,015	6,561
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	1,945		3,282	6,366
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	2,834		5,538	6,400

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが37,206,074千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが110,982,930千口、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドが2,309,692千口、ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンドが16,398,065千口、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドが2,138,126千口です。

### 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	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	6,518	20.0
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	6,620	20.4
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	6,561	20.2
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	6,366	19.6
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	6,400	19.7
コール・ローン等、その他	48	0.1
投資信託財産総額	32,515	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台湾ドル3.56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トルコ・リラ19.03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メキシコ・ペソ5.61円、1フィリピン・ペソ2.13円、100チリ・ペソ13.79円、100コロンビア・ペソ3.16円、1インド・ルピー1.52円、100インドネシア・ルピア0.77円、1ブラジル・レアル25.86円、1チェコ・コルナ4.71円、100韓国ウォン9.29円、1人民元15.44円、1マレーシア・リンギット26.10円、1南アフリカ・ランド7.35円、1タイ・バート3.58円、1ポーランド・ズロチ28.01円、100ハンガリー・フォリント36.15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。

ニッセイ新興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 (2,088,262千円) の投資信託財産総額 (2,175,258千円) に対する比率は96.0%です。

ニッセイ先進国リート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 (2,428,992千円) の投資信託財産総額 (2,527,803千円) に対する比率は96.1%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
<b>(A)資産</b>	<b>32,515,838円</b>
コール・ローン等	45,060
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド (評価額)	6,518,145
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド (評価額)	6,620,332
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド (評価額)	6,561,871
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド (評価額)	6,366,226
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド (評価額)	6,400,764
未収入金	3,440
<b>(B)負債</b>	<b>48,824</b>
未払解約金	1,227
未払信託報酬	46,243
その他未払費用	1,354
<b>(C)純資産総額 (A-B)</b>	<b>32,467,014</b>
元本	28,914,069
次期繰越損益金	3,552,945
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>28,914,069口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	11,229円

(注) 期首元本額	14,430,185円
期中追加設定元本額	19,997,893円
期中一部解約元本額	5,514,009円

## 損益の状況

当期 (2018年11月21日~2019年11月20日)

項目	当期
<b>(A)有価証券売買損益</b>	<b>2,931,838円</b>
売    買    益	3,220,885
売    買    損	△ 289,047
<b>(B)信託報酬等</b>	<b>△ 78,778</b>
<b>(C)当期損益金 (A+B)</b>	<b>2,853,060</b>
<b>(D)前期繰越損益金</b>	<b>△ 163,893</b>
(繰越欠損金)	(△ 163,893)
<b>(E)追加信託差損益金*</b>	<b>863,778</b>
(売買損益相当額)	( 863,778)
<b>(F)合計 (C+D+E)</b>	<b>3,552,945</b>
<b>次期繰越損益金 (F)</b>	<b>3,552,945</b>
追加信託差損益金	863,778
(売買損益相当額)	( 863,778)
分配準備積立金	2,689,167

- (注1) (A)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) (B)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) (D)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) (E)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

## 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,689,167円
(c) 信託約款に定める収益調整金	863,778円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	3,552,945円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,228.79円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■ 自社による当ファンドの設定解約状況

当期における自社による当ファンドの設定解約はありません。なお当期末現在、自社による当ファンドの保有残高は1百万円（元本1百万円、ファンド全体の3.5%）です。当社は当該保有分を解約することがあります。

## ■ 自社および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、当社は、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以下（※1）の通り保有しています。

また、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以下（※2）の通り保有しています。

当該実質保有分は、当社および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。

（※1）当社による他のベビーファンドを通じた主要投資対象マザーファンド受益証券の実質保有比率

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた 実質保有比率（%）
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	35.1

（注）実質保有比率が5%超のマザーファンドを記載しています。

（※2）日本生命保険相互会社による他のベビーファンドを通じた主要投資対象マザーファンド受益証券の実質保有比率

主要投資対象マザーファンド	他のベビーファンドを通じた 実質保有比率（%）
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10.4
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	87.9

## 当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート（不動産投資信託）市場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	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイJ－REITインデックスマザーファンド」「ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド」受益証券
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	日本を除く主要先進国の株式
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）
	ニッセイJ－REITインデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所に上場しているJリート
	ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート
運 用 方 法	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の5分の1ずつとします。
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

運用方法	ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
	ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
	ニッセイ先進国リート インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・ 株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
分 配 方 針		<p>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。</p>

# ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 19 期

(計算期間：2018年2月21日～2019年2月20日)

#### 運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

#### 運用方法

- 以下の様な投資制限のもと運用を行います。
- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
  - ・ 外貨建資産への投資は行いません。



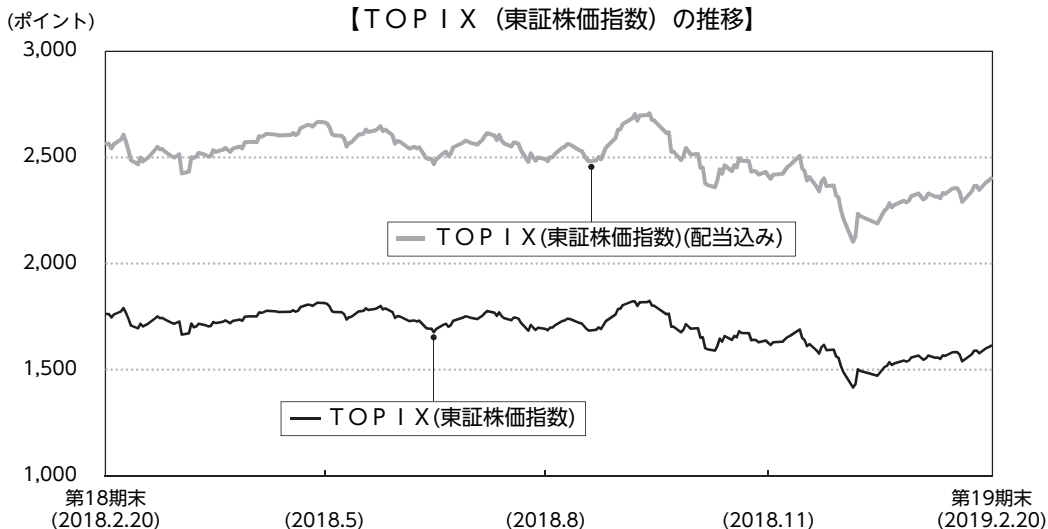
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2018年2月21日～2019年2月20日

## 国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

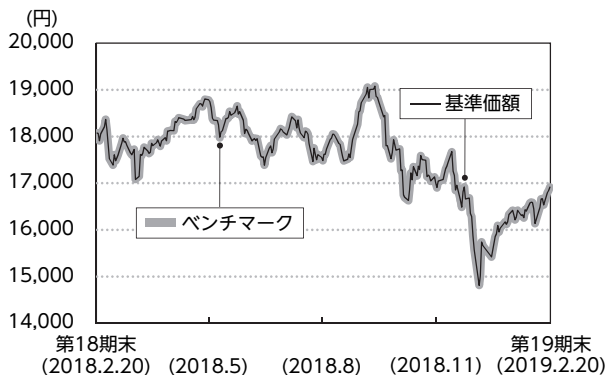
当期の国内株式市場は下落しました。

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

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

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

## 基準価額等の推移



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

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

### ■ 基準価額の主な変動要因

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

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

## ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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

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

## ベンチマークとの差異

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

## 今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年2月21日～2019年2月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2018年2月21日～2019年2月20日

(1) 株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

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

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年2月21日～2019年2月20日

株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

組入有価証券明細表

2019年2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニテッドアローズ	2	2	10,010
ハイデイ日高	2	3	7,427
京都きもの友禅	1	2	924
コロワイド	6	8	19,140
ピーシーデポコーポレーション	2	3	1,511
壱番屋	1	1	8,228
トップカルチャー	2	5	1,495
P L A N T	1	1	1,408
スギホールディングス	4	5	25,704
ヴィア・ホールディングス	-	3	1,998
スクロール	3	3	1,501
ヨンドシーホールディングス	2	2	5,826
エニ・ファミリーマートホールディングス	6	6	88,113
木曽路	2	3	7,740
S R Sホールディングス	2	2	2,946
千趣会	3	-	-
タカキュー	6	-	-
ケーヨー	3	4	2,448
上新電機	2	2	6,730
日本瓦斯	3	4	16,140
ロイヤルホールディングス	3	4	11,567
東天紅	0.700	-	-
いなげや	2	2	3,653
島忠	4	5	16,749
チヨダ	2	2	4,916
ライフコーポレーション	1	1	4,647
リンガーハット	2	3	7,140
MrMa xHD	2	3	1,727
テンアライド	2	3	1,531
AOKIホールディングス	3	4	6,203
オークワ	3	3	3,944
コメリ	3	3	10,590
青山商事	3	4	11,932
しまむら	2	2	26,593
はせがわ	2	3	1,446
高島屋	31	19	28,627
松屋	3	4	5,331
エイチ・ツー・オー リテイリング	9	12	19,656
近鉄百貨店	0.700	0.900	3,105
パルコ	1	2	2,757
丸井グループ	18	20	41,772

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

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

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2019年2月20日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年2月20日現在)

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

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

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

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

### 損益の状況

当期(2018年2月21日~2019年2月20日)

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

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

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

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

# ニッセイ外国株式インデックス 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

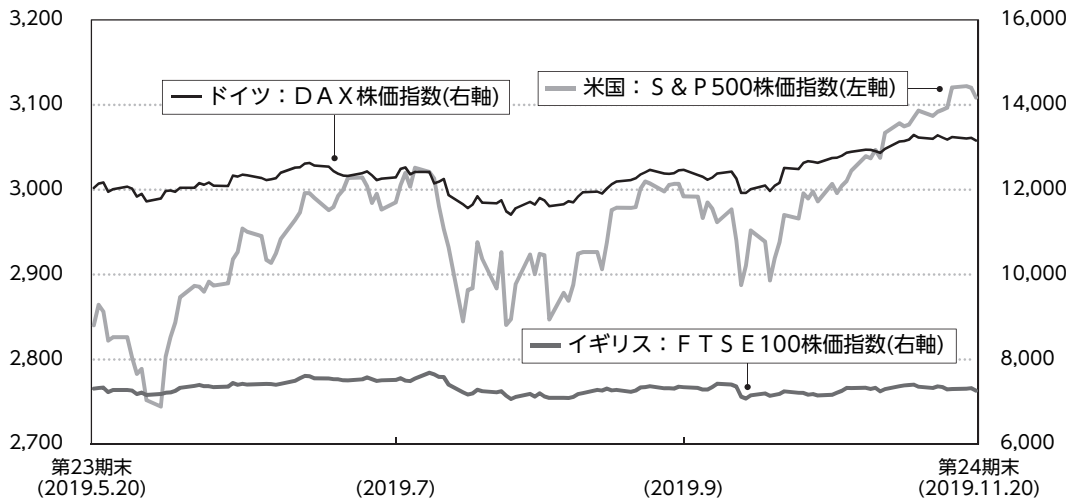
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2019年5月21日～2019年11月20日

## 海外株式市況

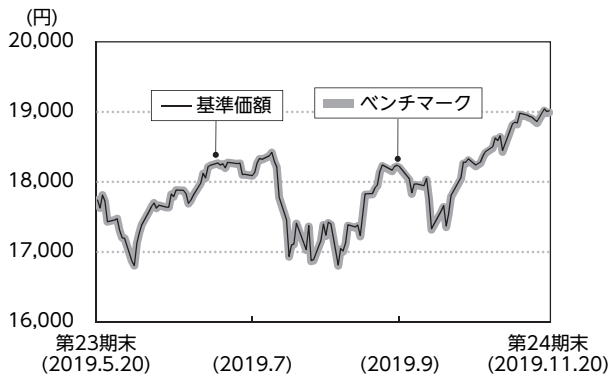
【海外主要株価指数の推移】



(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	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	%	百万円
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	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(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 (株式)	0円	0.002%	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (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 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	4	0.021	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(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 ・ 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 21,054 (△ 516)	千米ドル 162,926 (△ 1,520)	百株 1,710	千米ドル 8,896
	カナダ	2,981 ( 203)	千カナダ・ドル 13,237	939	千カナダ・ドル 1,109
	オーストラリア	5,376 (△ 1)	千オーストラリア・ドル 8,848 (△ 35)	681	千オーストラリア・ドル 1,075
	香港	6,416 ( 449)	千香港ドル 23,796	860	千香港ドル 2,032
	シンガポール	2,825	千シンガポール・ドル 1,397	37	千シンガポール・ドル 73
	ニュージーランド	432	千ニュージーランド・ドル 339	0.20	千ニュージーランド・ドル 0.096
	イギリス	20,763 ( 39,133)	千イギリス・ポンド 12,804 (△ 62)	50,223	千イギリス・ポンド 567
	イスラエル	817	千イスラエル・シェケル 1,878	899	千イスラエル・シェケル 225
	スイス	1,124	千スイス・フラン 8,075 (△ 40)	6	千スイス・フラン 52
	デンマーク	289	千デンマーク・クローネ 12,108	63	千デンマーク・クローネ 1,667
	ノルウェー	365	千ノルウェー・クローネ 4,993	77	千ノルウェー・クローネ 1,180
	スウェーデン	1,657 ( 228)	千スウェーデン・クローナ 21,612	193	千スウェーデン・クローナ 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	—	—

## 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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	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	千米ドル	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-TMCMORAN 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	
(アメリカ)	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	
<b>(アメリカ)</b>		百株	百株	千米ドル	千円	
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 銘柄数<比率>	125,168	143,996	1,265,667	137,464,099	
		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 銘柄数<比率>	17,346 87	19,592 86	92,232 -	7,546,455 <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 銘柄数<比率>	2,850 7	3,283 7	2,683 -	187,339 <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
ASHTAD 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 銘柄数<比率>	172,285 93	181,958 95	84,841 —	11,905,873 <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 銘柄数<比率>	2,362 8	2,281 8	8,054 –	252,509 <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 銘柄数<比率>	7,251 39	8,369 39	62,988 -	6,904,145 <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 銘柄数<比率>	1,771 17	1,998 17	84,165 -	1,355,063 <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 銘柄数<比率>	1,363 7	1,512 7	3,529 -	424,629 <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 銘柄数<比率>	7,836 24	9,116 24	28,024 -	3,371,936 <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 銘柄数<比率>	809 10	919 10	5,811 -	699,189 <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 銘柄数<比率>	482 3	551 3	756 -	91,042 <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	
WORLDLINE SA	15	39	217	26,189	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 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 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 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 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 銘柄数<比率>	21,855 17	24,439 18	12,106 -	1,456,627 <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 銘柄数<比率>	3,810 12	4,432 12	5,764 -	693,595 <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 銘柄数<比率>	349 6	403 6	1,395 -	167,852 <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 銘柄数<比率>	89 1	102 1	685 -	82,495 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	80,796 237	92,308 237	194,158 -	23,361,149 <11.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	509,058 1,243	568,479 1,256	- -	199,297,460 <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		
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	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	口数・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		15	17	463	37,938
	銘柄数<比率>		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		854	1,012	5,341	395,984
	銘柄数<比率>		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		87	100	8,231	114,247
	銘柄数<比率>		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		412	461	1,086	86,739
	銘柄数<比率>		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		142	126	988	138,727
	銘柄数<比率>		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
<b>(A)資産</b>	<b>215,497,433,277円</b>
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>(B)負債</b>	<b>4,454,247,012</b>
未 払 金	3,502,277,259
未 払 解 約 金	951,945,848
そ の 他 未 払 費 用	23,905
<b>(C)純 資 産 総 額 (A - B)</b>	<b>211,043,186,265</b>
元 本	110,982,930,759
次 期 繰 越 損 益 金	100,060,255,506
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>110,982,930,759口</b>
<b>1万口当たり基準価額 (C / D)</b>	<b>19,016円</b>

(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ットファンド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ットファンド2045	39,305,684円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	79,667,845円
DCニッセイターゲットデットファンド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ットファンド2060	4,212,091円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	3,974,678円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	6,685,873円
DCニッセイターゲットデットファンド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
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>1,925,753,117円</b>
受 取 配 当 金	1,913,810,907
受 取 そ の 他 収 益	4,764,663
支 払 利 息	8,275,117
支 払 利 息	△ 1,097,570
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>12,263,335,719</b>
売 買 損 益	18,903,752,207
売 買 損 益	△ 6,640,416,488
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>193,374,215</b>
取 引 損 益	596,390,171
取 引 損 益	△ 403,015,956
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 38,758,151</b>
<b>(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)</b>	<b>14,343,704,900</b>
<b>(F)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>75,095,869,816</b>
<b>(G)追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>19,154,801,612</b>
<b>(H)解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 8,534,120,822</b>
<b>(I)合 計 (E + F + G + H)</b>	<b>100,060,255,506</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (I)</b>	<b>100,060,255,506</b>

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

# ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 2 期

(計算期間：2018年11月21日～2019年11月20日)

#### 運用方針

主に新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCI エマージング・マーケット・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

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

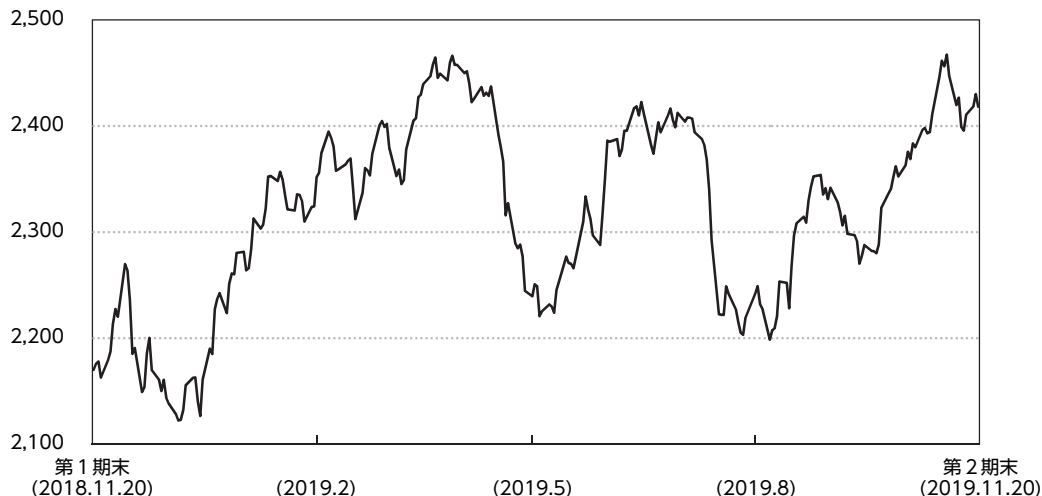
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2018年11月21日～2019年11月20日

## 海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

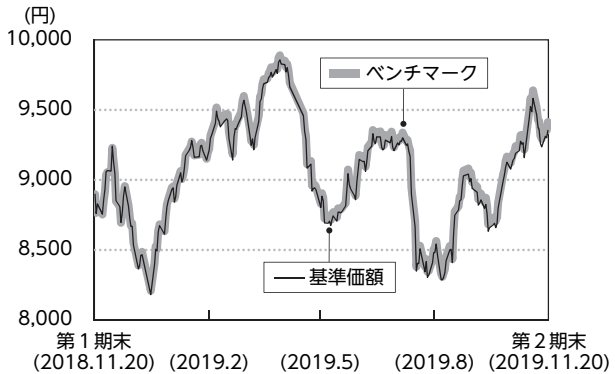


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の新興国株式市場は上昇しました。

期初以降、米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まりなどを背景に下落しましたが、2019年1月に入ると、FRBのハト派姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に上昇基調が継続しました。5月になると中国経済に予想以上の悪化兆候が見られたことを受けて、世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことから新興国株式市場は一時下落しましたが、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上昇しました。8月は米中貿易摩擦を巡る緊張の高まりから下落しましたが、10月以降は米中貿易摩擦の緩和期待などを背景に上昇する流れとなり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## 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>

- ・米連邦準備制度理事会（FRB）のハト派（金融緩和推進派）姿勢への転換や米中貿易摩擦懸念の後退、米中首脳会談における貿易戦争の休止や米国の利下げ期待などを受けて新興国株式市場が上昇したこと

#### <下落要因>

- ・米中貿易摩擦懸念や中国の景気減速懸念の高まり、それらに伴う世界経済の成長見通しに対する懸念が一段と強まったことを受けて新興国株式市場が下落したこと

## ポートフォリオ

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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+5.1%となり、ベンチマーク騰落率（+5.8%）を下回りました。

## 今後の運用方針

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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。

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	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
(設定日)	円	%		%	%	%	%	百万円
2017年8月7日	10,000	－	10,000	－	－	－	－	1,000
1期(2018年11月20日)	8,898	△11.0	9,691	△3.1	88.6	8.8	2.2	1,641
2期(2019年11月20日)	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	4.1	2,160

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 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3) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注4) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注5) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年11月20日	8,898	－	9,691	－	88.6	8.8	2.2
11月末	9,067	1.9	9,862	1.8	87.9	9.8	2.2
12月末	8,465	△4.9	9,243	△4.6	89.2	8.3	2.3
2019年1月末	9,081	2.1	9,895	2.1	85.9	11.9	2.1
2月末	9,419	5.9	10,298	6.3	84.0	13.9	2.0
3月末	9,302	4.5	10,171	5.0	89.1	8.5	2.1
4月末	9,664	8.6	10,559	9.0	88.6	9.1	2.1
5月末	8,743	△1.7	9,551	△1.4	88.4	7.9	3.5
6月末	9,208	3.5	10,059	3.8	86.9	9.4	3.2
7月末	9,204	3.4	10,066	3.9	85.6	10.9	3.2
8月末	8,423	△5.3	9,204	△5.0	87.0	8.2	4.6
9月末	8,797	△1.1	9,631	△0.6	85.9	9.6	4.5
10月末	9,266	4.1	10,151	4.7	85.4	10.4	4.1
(期末)2019年11月20日	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	4.1

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2018年11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	6円	0.063%	
(株式)	( 4)	(0.049)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	( 1)	(0.011)	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)	(0.004)	
有価証券取引税	1	0.012	
(株式)	( 1)	(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	37	0.408	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)	(31)	(0.346)	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)	( 6)	(0.061)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	44	0.483	

(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（9,042円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2018年11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 183 ( 3)	千米ドル 414	百株 64	千米ドル 105
	香港	5,949 ( 17)	千香港ドル 4,901 (△ 11)	1,208	千香港ドル 479
	台湾	1,630 ( 73)	千台湾ドル 7,416 (△ 35)	140	千台湾ドル 1,070
	イギリス	7	千イギリス・ポンド 6	－	千イギリス・ポンド －
	トルコ	201 ( 74)	千トルコ・リラ 219	131	千トルコ・リラ 41
	メキシコ	318	千メキシコ・ペソ 1,233 (△ 9)	59	千メキシコ・ペソ 141
	フィリピン	289 ( 6)	千フィリピン・ペソ 3,310	－	千フィリピン・ペソ －
	チリ	10,067 ( 274)	千チリ・ペソ 44,762	274	千チリ・ペソ 159
	コロンビア	21	千コロンビア・ペソ 64,039	－	千コロンビア・ペソ －
	インド	639 ( 128)	千インド・ルピー 20,184	110	千インド・ルピー 1,032
	インドネシア	1,808 ( 708)	千インドネシア・ルピア 941,105	242	千インドネシア・ルピア 83,570

ニッセイ新興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	ブラジル	百株 316 ( 127)	千ブラジル・レアル 893 (△ 35)	百株 11	千ブラジル・レアル 15
	チェコ	1	千チェコ・コルナ 100	1	千チェコ・コルナ 41
	韓国	93 ( 0.23)	千韓国ウォン 354,059 (△ 41)	12	千韓国ウォン 40,552
	中国	2,832	千人民元 2,863	－	千人民元 －
	マレーシア	469	千マレーシア・リンギット 361	103	千マレーシア・リンギット 15
	南アフリカ	170 ( 22)	千南アフリカ・ランド 1,727	18	千南アフリカ・ランド 210
	タイ	2,039 ( 187)	千タイ・バーツ 6,085 (△ 1)	238	千タイ・バーツ 524
	ポーランド	60	千ポーランド・ズロチ 143	3	千ポーランド・ズロチ 10
	ハンガリー	7	千ハンガリー・フォリント 2,821	－	千ハンガリー・フォリント －
	ユーロ ギリシャ	16	千ユーロ 19	－	千ユーロ －

(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。以下同じです。

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

(2) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	タイ	証券 1,588	千タイ・バーツ 1	証券 1,588	千タイ・バーツ 2

(注) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
<b>(アメリカ)</b>	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	2	36	—	—
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	1	33	0.200	3
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	15	481	—	—
<b>(トルコ)</b>		千トルコ・リラ		千トルコ・リラ
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	—	—	3	6
<b>(メキシコ)</b>		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
外 国 FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	—	—	—	—
		(△ 8)		
<b>(南アフリカ)</b>		千南アフリカ・ランド		千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	2	56	—	—
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	—	—	0.485	32
RESILIENT REIT LTD	—	—	0.631	35
REDEFINE PROPERTIES LTD	14	117	—	—
FORTRESS REIT LTD-A	1	35	—	—
FORTRESS REIT LTD-B	—	—	1	19

(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。

(4) 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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	1,162	1,125	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2018年11月21日～2019年11月20日

## (1) 株式

銘柄	買付			売付			
	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	0.900	16,287	18,096	NETEASE.COM INC -ADR	0.200	5,262	26,314
TENCENT HOLDINGS LTD	0.900	4,284	4,760	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	0.900	1,949	2,166
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2	4,219	2,109	LUKOIL PJSC-SPON ADR	0.231	1,917	8,298
XIAOMI CORP-CLASS B	27	3,788	138	CHINA RESOURCES LAND LTD	4	1,727	431
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	4	3,449	862	TENCENT HOLDINGS LTD	0.300	1,358	4,529
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.658	2,916	4,433	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	3	1,352	436
MEITUAN DIANPING-CLASS B	3	2,741	856	IND & COMM BK OF CHINA - H	16	1,233	77
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	1	2,554	1,596	MONDI LTD	0.368	879	2,389
NETEASE.COM INC -ADR	0.100	2,477	24,778	SK HYNIX INC	0.139	836	6,019
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	22	2,024	91	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.214	831	3,886

(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。

## (2) 新株予約権証券

銘柄	買付			売付			
	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
MINOR INTERNATIONAL PCL	355	4	11	MINOR INTERNATIONAL PCL	355	5	14
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW	1,233	1	1	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW	1,233	2	2

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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	
51JOB INC-ADR	1	1	7	825	商業・専門サービス
58.COM INC-ADR	3	3	19	2,106	メディア・娯楽
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	35	44	827	89,876	小売
AUTOHOME INC-ADR	1	2	16	1,805	メディア・娯楽
BAIDU INC-SPON ADR	8	8	99	10,843	メディア・娯楽

ニッセイ新興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	
BAOZUN INC-SPN ADR	1	1	4	475	小売
BBVA ARGENTINA SA-ADR	—	11	3	391	銀行
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	5	7	860	素材
CREDICORP LTD	1	1	37	4,115	銀行
GDS HOLDINGS LTD-ADR	1	2	9	982	ソフトウェア・サービス
GLOBANT SA	—	1	9	1,041	ソフトウェア・サービス
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	—	3	3	385	銀行
HUAZHU GROUP LIMITED ADR	3	4	14	1,581	消費者サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	—	2	4	518	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	21	21	1	200	エネルギー
IQIYI INC-ADR	—	4	7	779	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	22	22	72	7,927	小売
LUKOIL PJSC-SPON ADR	13	12	122	13,333	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	9	12	14	1,592	食品・生活必需品小売り
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	4	8	6	734	素材
MOBILE TELESYSTEMS PJSC	10	16	15	1,731	電気通信サービス
MOMO INC-SPON ADR	3	4	17	1,920	メディア・娯楽
NETEASE.COM INC -ADR	2	1	57	6,204	メディア・娯楽
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	3	4	52	5,736	消費者サービス
NIO INC-ADR	—	21	3	417	自動車・自動車部品
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	1	1	2	307	各種金融
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	2	3	63	6,924	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3	4	8	977	素材
PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	—	5	6	723	公益事業
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	3	5	7	760	素材
PINDUODUO INC-ADR	—	6	24	2,653	小売
PJSC GAZPROM ADR	167	166	129	14,062	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	19	21	58	6,378	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	1	1	8	884	素材
ROSNEFT OJSC-GDR	38	38	27	2,980	エネルギー
RUSHYDRO PJSC-ADR	28	—	—	—	公益事業
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	87	82	123	13,372	銀行
SEVERSTAL PAO-GDR REG S	5	7	11	1,215	素材
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	19	22	2	256	不動産
SINA CORP	1	2	7	828	メディア・娯楽
SOUTHERN COPPER CORP	2	2	8	955	素材
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	35	48	35	3,833	エネルギー

ニッセイ新興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		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	10	11	49	5,417	消費者サービス	
TATNEFT-SPONSORED ADR	8	8	58	6,367	エネルギー	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	—	3	2	292	電気通信サービス	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	—	3	3	394	メディア・娯楽	
TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	—	2	1	139	エネルギー	
TRIP.COM GROUP LTD	12	14	45	4,899	小売	
VIPSHOP HOLDINGS LTD-ADR	8	14	17	1,884	小売	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	42	66	9	1,036	銀行	
WEIBO CORP-SPON ADR	1	1	5	606	メディア・娯楽	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2	4	14	1,564	食品・生活必需品小売り	
YUM CHINA HOLDINGS INC	10	10	47	5,127	消費者サービス	
YY INC-ADR	1	1	8	908	メディア・娯楽	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	—	11	23	2,512	運輸	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	668 43	791 54	2,252 —	244,652 <11.3%>	
<b>(香港)</b>			千香港ドル			
3SBIO INC	25	40	49	689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	20	20	113	1,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	40	40	44	621	不動産	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	900	900	293	4,072	銀行	
AIR CHINA LIMITED-H	40	100	72	1,002	運輸	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100	100	81	1,132	ヘルスケア機器・サービス	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200	400	52	727	メディア・娯楽	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	60	240	56	779	素材	
ANGANG STEEL CO LTD-H	20	26	6	94	素材	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	40	40	197	2,739	素材	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30	40	307	4,269	耐久消費財・アパレル	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	40	14	195	資本財	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	40	40	19	263	自動車・自動車部品	
BANK OF CHINA LTD-H	2,420	2,560	832	11,548	銀行	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	240	290	153	2,125	銀行	
BBMG CORPORATION-H	—	270	57	801	素材	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	40	30	428	運輸	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10	15	53	742	公益事業	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	160	62	868	公益事業	
BOC AVIATION LTD	5	5	38	536	資本財	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	—	160	61	855	耐久消費財・アパレル	

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	80	80	67	942	自動車・自動車部品
BYD CO LTD	15	20	76	1,054	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10	10	15	213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CGN POWER CO LTD-H	200	340	68	943	公益事業
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	-	230	70	980	食品・飲料・タバコ
CHINA AOYUAN GROUP LTD	-	40	44	612	不動産
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	180	280	46	645	各種金融
CHINA CITIC BANK	240	290	131	1,827	銀行
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	100	140	84	1,175	資本財
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	40	80	42	590	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	45	60	184	2,560	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,930	3,050	1,958	27,178	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	55	55	16	226	運輸
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	-	40	16	222	運輸
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	-	20	21	295	消費者サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	50	120	43	599	銀行
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	90	90	54	752	商業・専門サービス
CHINA EVERBRIGHT LTD	20	80	104	1,454	各種金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	70	60	119	1,655	不動産
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	80	80	17	236	自動車・自動車部品
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	65	115	47	665	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	52	52	173	2,414	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	-	65	28	395	素材
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	210	210	24	341	各種金融
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	24	40	57	795	各種金融
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	120	180	100	1,391	不動産
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	230	230	481	6,688	保険
CHINA LITERATURE LTD	4	4	13	181	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	60	100	42	582	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	30	30	37	516	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80	90	270	3,747	食品・飲料・タバコ
CHINA MERCHANTS BANK-H	120	120	469	6,512	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	40	40	49	692	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	144	229	127	1,764	銀行
CHINA MOBILE LTD/HK	185	195	1,212	16,835	電気通信サービス
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	60	60	15	211	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	80	120	86	1,195	素材

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	40	40	43	599	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	120	120	318	4,413	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	76	86	253	3,521	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	780	780	347	4,817	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	140	140	298	4,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	100	100	16	227	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	90	90	42	588	資本財
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	-	40	17	241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	40	65	54	763	資本財
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	130	130	16	227	保険
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	40	60	271	3,764	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	60	60	54	749	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	20	40	178	2,476	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	100	100	342	4,753	不動産
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	40	40	28	391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	40	60	60	844	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	100	100	152	2,118	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40	40	20	279	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40	40	27	378	資本財
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	44	66	126	1,758	保険
CHINA TELECOM CORP LTD-H	420	420	132	1,836	電気通信サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	900	1,340	222	3,087	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	60	22	313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	180	180	132	1,843	電気通信サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	26	47	135	1,885	不動産
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	400	-	-	-	各種金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	50	50	20	282	銀行
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	80	80	47	652	不動産
CITIC LTD	160	190	194	2,705	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	50	70	106	1,478	各種金融
CNOOC LTD	540	570	685	9,509	エネルギー
COSCO PACIFIC LTD	20	60	39	547	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	230	280	313	4,344	不動産
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	30	30	82	1,145	商業・専門サービス
CRRC CORP LTD H	90	130	66	929	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	45	45	23	330	食品・飲料・タバコ
DATANG INTL POWER GEN CO-H	-	100	15	208	公益事業

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	80	80	63	887	自動車・自動車部品
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20	24	206	2,864	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	40	70	49	680	各種金融
FOSUN INTERNATIONAL	55	130	141	1,970	資本財
FULLSHARE HOLDINGS LTD	125	—	—	—	資本財
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	40	40	33	465	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8	32	74	1,032	自動車・自動車部品
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	250	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	150	231	3,218	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20	20	37	520	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	30	48	41	571	各種金融
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	200	200	14	194	小売
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	65	65	40	568	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	20	—	—	—	不動産
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	—	60	54	753	商業・専門サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	80	80	135	1,881	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	56	96	81	1,135	自動車・自動車部品
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	16	32	41	578	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	14	14	17	237	各種金融
HAILILAO INTERNATIONAL HOLDI	—	20	70	971	消費者サービス
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	30	50	111	1,540	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10	10	18	250	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	68	100	81	1,135	各種金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20	20	102	1,421	家庭用品・パーソナル用品
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10	10	13	192	半導体・半導体製造装置
HUANENG POWER INTL INC-H	80	140	51	713	公益事業
HUANENG RENEWABLES CORP-H	80	80	23	332	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	34	54	66	926	各種金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,100	2,070	1,200	16,664	銀行
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	20	21	294	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	20	20	18	253	素材
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	20	—	—	—	不動産
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	—	70	23	326	不動産
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	20	20	45	631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	25	23	320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	40	70	58	818	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	10	30	55	768	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
KUNLUN ENERGY CO LTD	60	100	69	964	公益事業
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65	40	34	480	不動産
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	30	30	16	227	素材
LEGEND GROUP LTD	180	220	127	1,764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEGEND HOLDINGS CORP-H	10	10	16	224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI NING CO LTD	—	60	156	2,169	耐久消費財・アパレル
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	40	40	49	684	不動産
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	40	55	179	2,496	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	25	25	16	224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAANSHAN IRON & STEEL-H	—	60	16	231	素材
MEITU INC	25	25	4	56	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEITUAN DIANPING-CLASS B	—	32	307	4,263	小売
MMG LTD	40	40	6	96	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	22	22	70	977	保険
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	20	20	14	199	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	30	23	328	素材
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	150	230	74	1,034	保険
PETROCHINA CO LTD-H	640	640	238	3,304	エネルギー
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	190	230	222	3,090	保険
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	160	175	1,616	22,431	保険
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	70	260	135	1,880	銀行
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	60	95	96	1,342	半導体・半導体製造装置
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40	40	40	559	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	40	40	9	136	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10	30	70	982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	10	10	14	199	資本財
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	13	27	38	538	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	20	55	92	1,282	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	80	80	24	345	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20	24	256	3,564	耐久消費財・アパレル
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	30	30	85	1,184	不動産
SHUI ON LAND LTD	—	115	18	250	不動産
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	80	80	8	113	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINO BIOPHARMACEUTICAL	180	220	256	3,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	60	60	18	250	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	30	30	13	191	資本財
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	60	240	51	719	素材

## ニッセイ新興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	
SINOPHARM GROUP CO-H	28	36	97	1,346	ヘルスケア機器・サービス
SINOTRANS LTD	–	60	14	204	運輸
SINOTRUK HONG KONG LTD	–	20	27	376	資本財
SOHO CHINA LTD	45	45	12	177	不動産
SSY GROUP LTD	40	40	25	357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUN ART RETAIL GROUP LTD	55	55	49	687	食品・生活必需品小売り
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	60	80	298	4,141	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	21	25	324	4,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD	174	180	6,058	84,096	メディア・娯楽
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	40	60	73	1,017	食品・飲料・タバコ
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	20	30	53	738	ソフトウェア・サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	–	20	101	1,403	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	30	23	328	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	110	150	100	1,390	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	30	60	82	1,142	資本財
WUXI APPTec CO LTD-H	–	5	55	766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	15	20	177	2,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XIAOMI CORP-CLASS B	–	274	234	3,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	–	24	22	306	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	60	60	27	386	半導体・半導体製造装置
YANZHOU COAL MINING CO-H	40	40	27	376	エネルギー
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	–	10	50	699	食品・飲料・タバコ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	160	160	26	373	不動産
YUZHOU PROPERTIES CO	–	130	46	651	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	35	35	29	403	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	20	20	14	200	運輸
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	–	7	18	250	保険
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	10	10	27	387	小売
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	12	17	46	648	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	180	180	51	714	素材
ZTE CORP-H	12	28	62	862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,043 175	27,801 195	29,931 –	415,452 <19.2%>
<b>(台湾)</b>			千台湾ドル		
ACER INC	50	50	90	322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD	10	10	317	1,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	–	10	444	1,582	資本財

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	100	100	790	2,812	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	40	70	315	1,122	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	20	20	475	1,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AU OPTRONICS CORP	170	260	206	735	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	20	556	1,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	250	250	1,067	3,800	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD	30	41	599	2,133	各種金融
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	114	188	430	1,533	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	40	40	169	604	自動車・自動車部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	10	10	92	328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA AIRLINES LTD	40	40	36	129	運輸
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	370	370	367	1,306	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	53	53	136	484	保険
CHINA STEEL CORP	370	370	869	3,095	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	130	120	1,356	4,827	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS	80	130	245	874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	550	600	1,335	4,752	銀行
DELTA ELECTRONICS INC	70	60	837	2,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	311	333	922	3,285	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	-	10	401	1,429	耐久消費財・アパレル
EVA AIRWAYS CORP	31	32	45	163	運輸
EVERGREEN MARINE	31	31	39	140	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	60	100	300	1,069	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	40	40	294	1,048	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10	11	216	769	耐久消費財・アパレル
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	272	325	746	2,657	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	100	110	957	3,406	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	30	40	385	1,371	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	140	140	1,363	4,854	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	10	10	34	121	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20	20	134	478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	200	200	911	3,243	保険
GIANT MANUFACTURING	10	10	218	777	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	10	10	340	1,212	半導体・半導体製造装置
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	20	20	93	333	不動産
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10	10	266	947	資本財
HON HAI PRECISION INDUSTRY	352	392	3,637	12,950	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10	10	579	2,061	小売
HTC CORP	10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	217	229	501	1,785	銀行
INNOLUX CORPORATION	180	280	195	694	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	40	80	186	662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	40	70	352	1,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MACRONIX INTERNATIONAL	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MEDIATEK INC	50	50	2,105	7,493	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	320	350	1,074	3,825	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10	20	171	610	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PLASTICS CORP	150	170	1,222	4,351	素材
NANYA TECHNOLOGY CORP	20	40	284	1,013	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	10	282	1,005	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	20	20	438	1,559	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	40	60	424	1,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	—	10	295	1,051	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	40	70	283	1,008	耐久消費財・アパレル
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10	20	191	681	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	20	624	2,221	食品・生活必需品小売り
QUANTA COMPUTER INC	70	90	571	2,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10	20	468	1,666	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	12	12	56	202	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	6	6	46	165	耐久消費財・アパレル
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	172	312	317	1,128	保険
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	244	344	444	1,583	銀行
STANDARD FOODS CORP	10	10	62	222	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	20	40	149	530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIMED BIOLOGICS INC	—	10	130	464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	279	285	410	1,461	銀行
TAIWAN BUSINESS BANK	83	87	109	388	銀行
TAIWAN CEMENT	118	158	666	2,373	素材
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	245	293	616	2,195	銀行
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	30	60	216	768	運輸
TAIWAN MOBILE CO LTD	40	50	575	2,047	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	750	780	24,570	87,469	半導体・半導体製造装置
TATUNG CO LTD	—	60	125	447	耐久消費財・アパレル
TECO ELECTRIC & MACHINERY	30	—	—	—	資本財

ニッセイ新興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>(台湾)</b>		百株	百株	千台湾ドル	千円		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	–	–	100	521	1,854	銀行	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	150	150	150	1,110	3,951	食品・飲料・タバコ	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	310	310	370	538	1,916	半導体・半導体製造装置	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	20	20	20	133	473	半導体・半導体製造装置	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	10	10	10	167	596	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	10	10	10	325	1,157	半導体・半導体製造装置	
WINBOND ELECTRONICS CORP	50	50	50	85	302	半導体・半導体製造装置	
WISTRON CORP	51	51	91	267	952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS LTD	27	27	27	105	376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YAGEO CORPORATION	10	10	10	323	1,151	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	220	220	300	595	2,119	各種金融	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10	10	10	140	498	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	8,374 82	9,937 86	65,106 –	231,779 <10.7%>	
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド			
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	–	–	7	8	1,185	素材	
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	– –	7 1	8 –	1,185 <0.1%>	
<b>(トルコ)</b>				千トルコ・リラ			
AKBANK T.A.S.	46	46	93	72	1,385	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	4	4	4	8	169	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	4	4	4	8	165	耐久消費財・アパレル	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3	3	10	20	388	資本財	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4	4	12	59	1,125	食品・生活必需品小売り	
COCA-COLA ICECEK AS	1	1	–	–	–	食品・飲料・タバコ	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	28	28	81	61	1,179	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1	1	1	10	198	自動車・自動車部品	
HACI OMER SABANCI HOLDING	18	18	65	59	1,140	各種金融	
KOC HOLDING AS	15	15	25	52	995	資本財	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	13	13	–	–	–	素材	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	2	2	2	8	159	運輸	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	2	2	–	–	–	自動車・自動車部品	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2	2	3	50	960	エネルギー	
TURK HAVA YOLLARI AO	9	9	9	14	267	運輸	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	13	13	13	6	120	資本財	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	22	22	35	47	898	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	48	48	71	73	1,391	銀行	

ニッセイ新興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>(トルコ)</b>		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE HALK BANKASI		11	—	—	—	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		30	30	19	369	銀行
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		14	—	—	—	銀行
ULKER BISKUVI SANAYI AS		3	—	—	—	食品・飲料・タバコ
YAPI VE KREDI BANKASI		16	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	320	465	573	10,915	
	銘柄数<比率>	23	16	—	<0.5%>	
<b>(メキシコ)</b>				千メキシコ・ペソ		
ALFA S.A.B.-A		63	96	150	843	資本財
ALSEA SAB DE CV		11	11	59	331	消費者サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV		1,023	1,081	1,631	9,151	電気通信サービス
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		10	22	233	1,311	食品・飲料・タバコ
BANCO SANTANDER MEXICO, S.A., INSTITUCION B		35	—	—	—	銀行
CEMEX SAB-CPO		417	478	339	1,906	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		11	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		—	16	179	1,006	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		3	3	29	165	小売
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		60	60	1,077	6,042	食品・飲料・タバコ
GRUMA S.A.B.-B		4	9	202	1,136	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		4	6	218	1,225	運輸
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH		9	9	185	1,040	運輸
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		35	53	183	1,029	食品・飲料・タバコ
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		9	9	62	349	資本財
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		81	81	857	4,809	銀行
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		49	75	181	1,015	銀行
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		107	107	572	3,213	素材
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		69	69	299	1,678	メディア・娯楽
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		3	3	83	468	素材
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV		11	18	149	836	公益事業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		29	49	187	1,051	家庭用品・パーソナル用品
MEGACABLE HOLDINGS-CPO		—	8	60	340	メディア・娯楽
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		20	33	144	809	素材
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		4	11	207	1,165	運輸
WALMART DE MEXICO-SER V		149	168	922	5,177	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	2,217	2,477	8,218	46,106	
	銘柄数<比率>	24	24	—	<2.1%>	

ニッセイ新興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>(フィリピン)</b>	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	36	63	323	688	資本財
ABOITIZ POWER CORP	28	28	102	217	公益事業
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	75	75	85	182	資本財
AYALA CORPORATION	5	11	971	2,069	資本財
AYALA LAND INC	197	239	1,075	2,290	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	15	48	454	969	銀行
BDO UNIBANK INC	53	63	1,002	2,135	銀行
DMCI HOLDINGS INC	71	71	54	115	資本財
GLOBE TELECOM INC	0.65	0.65	125	267	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	1	1	171	364	資本財
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9	28	341	728	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	59	91	713	1,520	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP	8	13	282	600	消費者サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY	4	13	452	963	公益事業
MEGAWORLD CORP	229	229	109	232	不動産
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	281	281	130	278	各種金融
METROPOLITAN BANK & TRUST	12	55	375	800	銀行
PLDT INC	1	2	294	627	電気通信サービス
ROBINSONS LAND CO	34	34	88	188	不動産
SECURITY BANK CORP	4	4	91	195	銀行
SM INVESTMENTS CORP	4	7	785	1,673	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC	273	329	1,309	2,789	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP	17	28	428	912	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,424 23	1,720 23	9,769 -	20,809 <1.0%>
<b>(チリ)</b>			千チリ・ペソ		
AGUAS ANDINAS SA-A	46	46	1,597	220	公益事業
BANCO DE CHILE	689	1,789	16,374	2,258	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	0.79	1	6,079	838	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	0.06	-	-	-	銀行
BANCO SANTANDER CHILE	1,780	2,197	10,411	1,435	銀行
CENCOSUD SA	27	43	4,525	624	食品・生活必需品小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	2	2	1,984	273	食品・飲料・タバコ
COLBUN SA	137	137	1,664	229	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	4	4	994	137	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	2	2	1,524	210	電気通信サービス
EMPRESAS CMPC SA	24	37	6,911	953	素材

ニッセイ新興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>(チリ)</b>		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
EMPRESAS COPEC SA		9	12	8,731	1,204	エネルギー
ENEL CHILE SA		604	904	5,542	764	公益事業
ENERSIS SA		588	1,364	20,607	2,841	公益事業
ITAU CORPBANCA		2,575	10,008	4,375	603	銀行
LATAM AIRLINES GROUP SA		6	9	8,264	1,139	運輸
S.A.C.I. FALABELLA		18	24	8,962	1,235	小売
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		3	3	5,934	818	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,522 18	16,590 17	114,485 -	15,787 <0.7%>	
<b>(コロンビア)</b>				千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		4	7	32,057	1,013	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		12	16	73,149	2,311	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		8	8	5,931	187	素材
ECOPETROL SA		126	126	39,335	1,243	エネルギー
GRUPO ARGOS SA		5	5	9,882	312	素材
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		76	76	10,629	335	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		5	12	42,480	1,342	各種金融
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		2	2	6,720	212	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA		8	14	28,099	887	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	250 9	271 9	248,287 -	7,845 <0.4%>	
<b>(インド)</b>				千インド・ルピー		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		15	15	550	836	運輸
AMBUJA CEMENTS LTD		11	11	229	348	素材
ASHOK LEYLAND LTD		22	22	184	280	資本財
ASIAN PAINTS LTD		7	9	1,587	2,412	素材
AUROBINDO PHARMA LTD		5	8	345	525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD		2	2	506	769	食品・生活必需品小売り
AXIS BANK LTD		54	61	4,566	6,941	銀行
BAJAJ AUTO LTD		1	2	850	1,292	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD		4	5	2,332	3,545	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD		0.80	1	1,089	1,655	保険
BHARAT FORGE LTD		4	4	195	296	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTROCALCS		17	-	-	-	資本財
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		15	22	1,173	1,783	エネルギー
BHARTI AIRTEL LTD		36	70	3,096	4,706	電気通信サービス
BHARTI INFRA TEL LTD		7	7	183	279	電気通信サービス

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BOSCH LTD	0.15	0.15	224	341	自動車・自動車部品
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	0.56	3	945	1,437	食品・飲料・タバコ
CADILA HEALTHCARE LTD	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIPLA LIMITED	7	10	506	769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	14	39	779	1,185	エネルギー
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1	6	347	527	運輸
DABUR INDIA LTD	10	16	750	1,140	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	—	2	424	645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DR. REDDY'S LABORATORIES	2	3	954	1,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	0.35	0.35	761	1,156	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	21	42	533	810	公益事業
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	2	2	101	153	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	7	11	779	1,185	家庭用品・パーソナル用品
GRASIM INDUSTRIES LTD	8	8	679	1,032	素材
HAVELLS INDIA LTD	4	7	531	808	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	13	17	1,949	2,962	ソフトウェア・サービス
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	—	20	1,148	1,746	保険
HERO MOTOCORP LTD	1	4	1,009	1,534	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	23	35	681	1,035	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	12	19	560	851	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	19	21	4,305	6,544	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	48	52	11,569	17,585	銀行
ICICI BANK LTD	67	76	3,792	5,764	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	—	4	587	892	保険
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	6	6	141	215	銀行
INDIAN OIL CORPORATION LTD	36	59	796	1,210	エネルギー
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	104	112	8,006	12,169	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	2	2	289	439	運輸
ITC LTD	104	104	2,612	3,971	食品・飲料・タバコ
JSW STEEL LTD	17	25	634	964	素材
LARSEN & TOUBRO LTD	13	15	2,088	3,174	資本財
LIC HOUSING FINANCE LTD	5	5	248	377	銀行
LUPIN LTD	4	4	356	542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	5	20	661	1,006	各種金融
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21	31	1,746	2,654	自動車・自動車部品
MARICO LTD	8	14	508	772	家庭用品・パーソナル用品
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3	3	2,324	3,533	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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>(インド)</b>	百株	百株	千ドル・ルーピー	千円	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	20	20	274	416	自動車・自動車部品
NESTLE INDIA LTD	0.62	0.62	875	1,330	食品・飲料・タバコ
NTPC LTD	52	101	1,192	1,812	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26	79	1,057	1,606	エネルギー
PAGE INDUSTRIES LTD	0.14	0.14	322	489	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	8	18	509	774	エネルギー
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2	2	355	540	素材
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1	2	472	717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	35	58	1,142	1,736	公益事業
REC LTD	13	13	195	297	各種金融
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	86	91	13,790	20,960	エネルギー
SHREE CEMENT LTD	0.16	0.26	520	790	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3	7	850	1,292	各種金融
SIEMENS LTD	1	-	-	-	資本財
STATE BANK OF INDIA	47	57	1,913	2,907	銀行
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	27	27	1,175	1,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28	28	5,957	9,055	ソフトウェア・サービス
TATA MOTORS LTD	42	42	711	1,081	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	21	21	119	181	公益事業
TATA STEEL LTD	6	11	465	707	素材
TECH MAHINDRA LTD	12	15	1,159	1,763	ソフトウェア・サービス
TITAN CO LTD	6	9	1,107	1,683	耐久消費財・アパレル
ULTRATECH CEMENT LTD	2	3	1,238	1,882	素材
UNITED SPIRITS LTD	6	6	371	565	食品・飲料・タバコ
UPL LTD	7	16	888	1,350	素材
VEDANTA LTD	30	57	815	1,239	素材
VODAFONE IDEA LTD	28	213	129	196	電気通信サービス
WIPRO LTD	25	38	974	1,480	ソフトウェア・サービス
YES BANK LTD	41	55	353	537	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	10	16	474	720	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,417 79	2,074 79	110,641 -	168,174 <7.8%>
<b>(インドネシア)</b>			千インドネシア・ルピア		
ADARO ENERGY TBK PT	271	271	35,772	275	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	584	648	430,920	3,318	自動車・自動車部品
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	307	347	1,095,652	8,436	銀行
BANK DANAMON INDONESIA TBK	67	-	-	-	銀行

ニッセイ新興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>(インドネシア)</b>		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
BANK MANDIRI TBK	539	604	431,860	3,325	銀行	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	158	232	176,320	1,357	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA	1,599	1,794	751,686	5,787	銀行	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	83	83	17,181	132	銀行	
BARITO PACIFIC TBK PT	–	885	110,182	848	素材	
BUMI SERPONG DAMAI PT	163	163	22,657	174	不動産	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	144	226	161,590	1,244	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	11	11	59,015	454	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	199	199	40,994	315	食品・飲料・タバコ	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	60	60	47,550	366	素材	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	38	38	75,905	584	素材	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	46	46	52,555	404	食品・飲料・タバコ	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	85	208	165,360	1,273	食品・飲料・タバコ	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	41	41	21,320	164	運輸	
KALBE FARMA TBK PT	418	1,152	175,104	1,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	47	–	–	–	小売	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	–	43	52,460	403	素材	
PAKUWON JATI TBK PT	453	453	26,953	207	不動産	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	215	215	43,215	332	公益事業	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	56	94	116,795	899	素材	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	111	111	14,541	111	メディア・娯楽	
TELEKOMUNIKASI TBK PT	1,438	1,581	635,562	4,893	電気通信サービス	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	40	–	–	–	電気通信サービス	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	32	47	201,160	1,548	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED TRACTORS TBK PT	35	50	112,250	864	エネルギー	
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	88	–	–	–	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,328 28	9,602 26	5,074,560 –	39,074 <1.8%>	
<b>(ブラジル)</b>				千ブラジル・リアル		
AMBEV SA	144	151	266	6,899	食品・飲料・タバコ	
ATACADAO SA	8	19	34	905	食品・生活必需品小売り	
B2W CIA DIGITAL	–	6	32	837	小売	
BANCO BRADESCO S.A.	28	39	122	3,175	銀行	
BANCO BRADESCO SA-PREF	103	130	430	11,124	銀行	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	–	6	41	1,067	各種金融	
BANCO DO BRASIL SA	24	28	128	3,315	銀行	
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	10	13	59	1,528	銀行	

ニッセイ新興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	
(ブラジル)	百株	百株	千リアル	千円	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	15	22	74	1,936	保険
BM&FBOVESPA SA	60	67	321	8,306	各種金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	18	27	41	1,082	不動産
BRASKEM SA-PREF A	3	5	14	362	素材
BRF SA	10	16	53	1,388	食品・飲料・タバコ
CCR SA	26	38	64	1,670	運輸
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR	4	7	24	631	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4	7	25	648	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	-	1	0.027	0.702	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	-	1	0.057	1	公益事業
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	3	5	39	1,027	食品・生活必需品小売り
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	17	29	36	941	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	6	10	51	1,334	公益事業
CIELO SA	27	39	29	771	ソフトウェア・サービス
COGNA EDUCACAO	29	42	43	1,114	消費者サービス
COSAN SA	3	8	48	1,248	エネルギー
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	6	-	-	-	公益事業
EMBRAER SA	14	20	34	899	資本財
ENERGISA SA-UNITS	-	6	28	737	公益事業
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	3	6	30	780	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	4	5	51	1,327	公益事業
FIBRIA CELULOSE SA	7	-	-	-	素材
GERDAU SA-PREF	22	31	47	1,226	素材
HYPERA S.A	6	11	37	958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	3	24	88	2,283	保険
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	99	156	549	14,217	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	137	137	184	4,764	銀行
JBS SA	16	35	92	2,398	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	19	19	33	865	素材
LOCALIZA RENT A CAR	11	19	77	2,015	運輸
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	15	23	45	1,187	小売
LOJAS RENNER S.A.	22	24	122	3,165	小売
M DIAS BRANCO SA	2	2	6	173	食品・飲料・タバコ
MAGAZINE LUIZA SA	2	16	71	1,842	小売
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	6	6	17	445	不動産
NATURA COSMETICOS SA	3	12	37	967	家庭用品・パーソナル用品
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	-	9	51	1,326	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ新興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>(ブラジル)</b>		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
ODONTOPREV S.A.		5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		85	95	296	7,677	エネルギー
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		120	132	379	9,824	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		8	26	71	1,861	小売
PORTO SEGURO SA		2	2	11	302	保険
RAIA DROGASIL SA		6	8	89	2,312	食品・生活必需品小売り
RUMO SA		24	34	80	2,092	運輸
SUL AMERICA SA - UNITS		4	7	36	932	保険
SUZANO S.A.		12	15	57	1,492	素材
TELEF BRASIL		10	14	78	2,019	電気通信サービス
TIM PARTICIPACOES SA		18	35	46	1,207	電気通信サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		9	22	45	1,175	エネルギー
VALE SA		96	101	489	12,664	素材
WEG SA		22	22	65	1,706	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,362 53	1,794 56	5,343 —	138,172 <6.4%>	
<b>(チェコ)</b>				千チェコ・コルナ		
CEZ AS		3	5	295	1,390	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		1	1	147	696	銀行
MONETA MONEY BANK AS		11	11	89	421	銀行
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS		1	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18 4	18 3	532 —	2,508 <0.1%>	
<b>(韓国)</b>				千韓国ウォン		
AMOREPACIFIC CORP		0.79	1	19,110	1,775	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF		0.17	0.17	1,506	139	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC GROUP		0.60	0.60	4,716	438	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD/NEW		0.15	0.15	2,700	250	食品・生活必需品小売り
BNK FINANCIAL GROUP INC		5	15	11,215	1,041	銀行
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		0.73	1	7,833	727	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION INC		2	2	50,829	4,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC		0.34	0.34	1,315	122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC		1	1	3,181	295	メディア・娯楽
CJ CHEILJEDANG CORP		0.15	0.26	6,487	602	食品・飲料・タバコ
CJ CORP		0.28	1	12,025	1,117	資本財
CJ ENM CO LTD		0.28	0.28	4,219	392	小売
CJ LOGISTICS		0.16	0.16	2,560	237	運輸

ニッセイ新興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>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	0.53	0.89	8,348	775	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	2	2	1,127	104	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	–	1	3,117	289	資本財
DAUM COMMUNICATIONS CORP	1	1	24,727	2,297	メディア・娯楽
DB INSURANCE CO LTD	1	1	8,838	821	保険
DGB FINANCIAL GROUP INC	3	–	–	–	銀行
DONGSUH COMPANIES INC	0.66	–	–	–	食品・生活必需品小売り
DOOSAN BOBCAT INC	0.69	2	8,826	819	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1	–	–	–	資本財
E-MART CO LTD	0.43	0.63	8,316	772	食品・生活必需品小売り
FILA KOREA LTD	–	1	8,670	805	耐久消費財・アパレル
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	0.96	1	6,053	562	資本財
GS HOLDINGS CORP	1	3	15,931	1,480	エネルギー
GS RETAIL CO LTD	0.52	0.52	2,080	193	食品・生活必需品小売り
HANA FINANCIAL GROUP	8	9	35,271	3,276	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	1	4	13,894	1,290	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD	0.13	0.21	6,919	642	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SCIENCE CO LTD	0.25	0.25	988	91	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	3	9	10,560	981	自動車・自動車部品
HANSSEM CO LTD	0.20	–	–	–	耐久消費財・アパレル
HANWHA CHEMICAL CORP	2	2	4,143	384	素材
HANWHA CORPORATION	0.83	4	11,158	1,036	資本財
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	5	5	1,187	110	保険
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	0.67	0.67	1,956	181	資本財
HELIXMITH CO LTD	0.30	0.53	5,310	493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HLB INC	0.69	0.69	9,404	873	耐久消費財・アパレル
HOTEL SHILLA CO LTD	0.61	0.99	8,088	751	小売
HYUNDAI DEPT STORE CO	0.26	0.26	2,064	191	小売
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2	2	9,190	853	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	0.35	0.59	8,938	830	運輸
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	0.21	0.31	10,540	979	資本財
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1	1	3,425	318	保険
HYUNDAI MOBIS	1	2	56,026	5,204	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	4	4	59,500	5,527	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	0.78	1	13,694	1,272	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	0.45	0.45	3,370	313	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	1	2	8,307	771	素材

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5	7	9,522	884	銀行
KANGWON LAND INC	2	3	11,259	1,045	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	12	13	62,321	5,789	銀行
KCC CORP	0.11	0.11	2,425	225	資本財
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	0.44	-	-	-	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORPORATION	6	8	35,322	3,281	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1	1	5,414	502	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	6	7	22,199	2,062	公益事業
KOREA GAS CORPORATION	0.54	0.54	2,173	201	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	0.83	1	9,924	921	各種金融
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	1	1	11,716	1,088	資本財
KOREA ZINC CO LTD	0.17	0.26	11,024	1,024	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	0.87	0.87	2,288	212	運輸
KT&G CORP	3	3	36,691	3,408	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	0.35	0.35	2,593	240	素材
LG CHEM LTD	1	1	46,672	4,335	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.15	0.15	2,632	244	素材
LG CORP	2	3	22,687	2,107	資本財
LG DISPLAY CO LTD	4	7	10,251	952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	2	3	23,223	2,157	耐久消費財・アパレル
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	0.29	0.36	43,740	4,063	家庭用品・パーソナル用品
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.04	0.04	2,996	278	家庭用品・パーソナル用品
LG INNOTEK CO LTD	0.28	0.28	3,346	310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	2	9	11,621	1,079	各種金融
LG UPLUS CORP	5	3	4,774	443	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	0.45	0.45	10,035	932	素材
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.57	0.57	2,091	194	資本財
LOTTE SHOPPING CO	0.22	0.22	2,937	272	小売
MEDY-TOX INC	0.08	0.08	2,368	219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MERITZ SECURITIES CO LTD	-	10	4,513	419	各種金融
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	7	13	9,656	897	各種金融
NAVER CORP	4	4	72,803	6,763	メディア・娯楽
NCSOFT CORPORATION	0.47	0.56	31,416	2,918	メディア・娯楽
NETMARBLE CORPORATION	0.58	0.58	5,092	473	メディア・娯楽
OCI CO LTD	0.32	0.32	2,057	191	素材
ORANGE LIFE INSURANCE, LTD.	0.65	0.65	1,865	173	保険
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.43	0.43	4,665	433	食品・飲料・タバコ

ニッセイ新興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>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
OTTOGI CORPORATION	0.02	0.02	1,128	104	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP	0.13	0.13	2,437	226	メディア・娯楽
POSCO	2	2	56,826	5,279	素材
POSCO CHEMICAL CO LTD	—	0.74	3,570	331	素材
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	0.69	0.69	1,331	123	資本財
S-1 CORPORATION	0.32	0.32	3,078	285	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	0.44	0.53	21,147	1,964	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	2	2	27,604	2,564	資本財
SAMSUNG CARD CO	0.58	0.58	2,148	199	各種金融
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1	1	19,178	1,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	146	150	806,833	74,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	26	26	112,102	10,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3	3	6,543	607	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	0.89	0.89	20,781	1,930	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	11	11	8,044	747	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	1	2	16,537	1,536	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	1	1	42,922	3,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD	0.93	1	22,769	2,115	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1	3	13,280	1,233	各種金融
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	13	14	62,781	5,832	銀行
SHINSEGAE CO LTD	0.14	0.14	3,745	347	小売
SILLAJEN INC	1	1	3,411	316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK HOLDINGS CO LTD	0.78	1	30,520	2,835	資本財
SK HYNIX INC	17	17	147,398	13,693	半導体・半導体製造装置
SK INNOVATION CO LTD	1	1	27,579	2,562	エネルギー
SK TELECOM CO LTD	0.42	0.62	15,221	1,414	電気通信サービス
S-OIL CORPORATION	0.94	1	13,069	1,214	エネルギー
STX PAN OCEAN CO LTD	4	4	1,811	168	運輸
WOONGJIN COWAY CO LTD	1	1	14,409	1,338	耐久消費財・アパレル
WOORI BANK	12	—	—	—	銀行
WOORI FINANCIAL GROUP INC	—	15	18,714	1,738	銀行
YUHAN CORP	0.16	0.28	6,076	564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	399 114	480 113	2,587,005 —	240,332 <11.1%>
<b>(中国)</b>			千人民元		
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	—	80	28	444	銀行
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	—	10	44	692	素材

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	86	48	744	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	—	45	16	252	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	37	20	317	銀行
BANK OF NINGBO CO LTD -A	—	17	49	761	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	—	45	41	639	銀行
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	—	110	41	633	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	97	42	648	銀行
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	—	5	43	671	消費者サービス
CHINA MERCHANTS BANK-A	8	37	138	2,143	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	—	27	44	687	各種金融
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	—	19	35	541	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-A	—	35	21	331	銀行
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	—	113	39	603	素材
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	—	106	50	785	公益事業
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	—	6	21	329	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	—	84	41	635	エネルギー
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	88	49	756	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	—	78	41	635	資本財
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	—	41	20	317	資本財
CHINA UNITED NETWORK-A	—	92	54	835	電気通信サービス
CHINA VANKE CO LTD -A	—	9	24	371	不動産
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	—	45	81	1,255	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A	—	10	22	341	各種金融
CRRC CORP LTD-A	—	23	15	246	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	29	41	646	各種金融
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	—	2	22	351	食品・飲料・タバコ
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	26	41	645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GF SECURITIES CO LTD-A	—	37	49	768	各種金融
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	—	8	47	734	耐久消費財・アパレル
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	33	55	864	各種金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	29	40	632	各種金融
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	—	22	74	1,154	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	—	28	40	620	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	21	36	558	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	—	62	46	719	銀行
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	—	5	38	591	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	—	12	40	627	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興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>(中国)</b>	百株	百株	千人民元	千円		
IND & COMM BK OF CHINA-A	-	56	32	505	銀行	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	-	22	43	673	銀行	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	-	324	41	640	素材	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	-	6	17	276	食品・飲料・タバコ	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	-	5	47	738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	-	4	39	605	食品・飲料・タバコ	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1	2	246	3,805	食品・飲料・タバコ	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	-	18	63	984	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	-	4	34	528	食品・飲料・タバコ	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	-	205	53	826	資本財	
MIDEA GROUP CO LTD-A	-	3	17	267	耐久消費財・アパレル	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	-	5	47	738	食品・飲料・タバコ	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	-	9	41	645	保険	
PETROCHINA CO LTD-A	-	69	38	590	エネルギー	
PING AN BANK CO LTD-A	-	18	29	456	銀行	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4	19	168	2,607	保険	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	-	27	39	604	不動産	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	-	100	41	639	資本財	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	-	8	18	281	自動車・自動車部品	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	-	30	43	678	資本財	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	-	31	37	585	銀行	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	-	110	52	808	各種金融	
SUNING.COM CO LTD-A	-	44	44	691	小売	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	-	9	41	641	素材	
WEICHAI POWER CO LTD-A	-	34	44	685	資本財	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	-	5	18	282	食品・飲料・タバコ	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	-	7	93	1,442	食品・飲料・タバコ	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	-	5	46	725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZTE CORP-A	-	7	22	344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13 3	2,845 68	3,163 -	48,841 <2.3%>	
<b>(マレーシア)</b>			千マレーシア・リンギット			
AIRASIA GROUP BERHAD		25	25	4	121	運輸
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD		20	20	5	148	銀行
AMBANK HOLDINGS BHD		32	97	40	1,058	銀行
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD		28	-	-	-	メディア・娯楽
AXIATA GROUP BERHAD		57	87	37	990	電気通信サービス

ニッセイ新興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	
(マレーシア)	百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	3	3	4	128	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	126	155	83	2,176	銀行
DIALOG GROUP BHD	99	99	34	891	エネルギー
DIGI.COM BHD	65	96	44	1,160	電気通信サービス
FGV HOLDINGS BHD	29	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3	3	10	272	食品・飲料・タバコ
GAMUDA BHD	31	31	11	307	資本財
GENTING BHD	45	67	41	1,071	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	59	59	19	500	消費者サービス
GENTING PLANTATIONS BHD	5	5	5	133	食品・飲料・タバコ
HAP SENG CONSOLIDATED	11	11	10	285	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	26	47	25	658	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG BANK BERHAD	13	22	37	976	銀行
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	4	19	31	832	銀行
IHH HEALTHCARE BHD	63	63	34	896	ヘルスケア機器・サービス
IJM CORP BHD	52	52	10	286	資本財
IOI CORPORATION BHD	44	44	19	508	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	35	—	—	—	不動産
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	11	11	24	645	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	122	122	105	2,754	銀行
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	16	49	40	1,061	運輸
MAXIS BHD	62	62	33	864	電気通信サービス
MISC BHD	24	24	19	519	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1	2	28	752	食品・飲料・タバコ
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	62	78	57	1,498	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	4	16	38	1,011	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	15	22	36	958	公益事業
PPB GROUP BERHAD	10	18	34	891	食品・飲料・タバコ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	24	70	33	867	素材
PUBLIC BANK BHD	91	99	198	5,167	銀行
QL RESOURCES BHD	—	20	14	386	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	16	87	50	1,317	銀行
SIME DARBY BERHAD	48	48	11	294	資本財
SIME DARBY PLANTATION BHD	52	77	39	1,032	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY PROPERTY BHD	48	48	3	102	不動産
SP SETIA BHD	23	23	3	84	不動産
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	22	8	217	電気通信サービス

ニッセイ新興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>(マレーシア)</b>		百株	百株	マレーシア・リジット	千円	
TENAGA NASIONAL BHD		97	97	133	3,483	公益事業
TOP GLOVE CORP BHD		30	30	13	359	ヘルスケア機器・サービス
UMW HOLDINGS BHD		11	—	—	—	自動車・自動車部品
WESTPORTS HOLDINGS BHD		18	18	7	202	運輸
YTL CORPORATION BERHAD		83	83	7	194	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,766 46	2,132 43	1,458 —	38,073 <1.8%>	
<b>(南アフリカ)</b>				南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD		22	22	362	2,661	銀行
ANGLO PLATINUM LTD		1	2	290	2,137	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		9	12	376	2,768	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		9	9	117	864	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD		8	10	366	2,694	食品・生活必需品小売り
BIDVEST GROUP LTD		8	8	193	1,419	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		0.86	1	192	1,418	銀行
CLICKS GROUP LTD		5	7	205	1,509	食品・生活必需品小売り
CORONATION FUND MANAGERS LTD		4	—	—	—	各種金融
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED		7	11	144	1,062	保険
EXXARO RESOURCES LTD		4	7	102	753	エネルギー
FIRSTSTRAND LTD		103	103	709	5,211	各種金融
GOLD FIELDS LTD		19	31	250	1,844	素材
IMPERIAL LOGISTICS LTD		3	—	—	—	運輸
INVESTEC LTD		5	9	78	575	各種金融
KUMBA IRON ORE LTD		1	2	81	597	素材
LIBERTY HOLDINGS LTD		2	2	26	195	保険
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		24	40	99	733	ヘルスケア機器・サービス
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD		17	17	37	273	保険
MONDI LTD		2	—	—	—	素材
MR PRICE GROUP LTD		6	6	110	812	小売
MTN GROUP LTD		48	54	521	3,832	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD		—	13	166	1,222	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS		13	18	4,264	31,344	小売
NEDBANK GROUP LTD		10	12	295	2,170	銀行
NEPI ROCKCASTLE PLC		7	11	146	1,080	不動産
NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS		18	35	68	505	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL LTD		151	151	301	2,217	保険
PICK N PAY STORES LTD		6	6	47	347	食品・生活必需品小売り

ニッセイ新興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>(南アフリカ)</b>	百株	百株	千南アフリカランド	千円		
PIONEER FOODS GROUP LTD	2	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
PSG GROUP LTD	4	4	96	710	各種金融	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	12	51	160	1,177	保険	
REINET INVESTMENTS SCA	3	3	95	703	各種金融	
REMGRO LTD	13	16	298	2,193	各種金融	
RMB HOLDINGS LTD	14	21	181	1,336	各種金融	
SANLAM LIMITED	52	68	565	4,159	保険	
SAPPI LIMITED	11	11	44	329	素材	
SASOL LTD	16	17	510	3,751	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	11	14	201	1,480	食品・生活必需品小売り	
SPAR GROUP LIMITED/THE	3	5	125	923	食品・生活必需品小売り	
STANDARD BANK GROUP LTD	39	41	744	5,471	銀行	
TELKOM SA SOC LTD	4	4	24	179	電気通信サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	4	7	114	842	小売	
TIGER BRANDS LTD	3	5	119	880	食品・飲料・タバコ	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	8	8	47	350	小売	
VODACOM GROUP LTD	15	20	264	1,943	電気通信サービス	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	20	29	172	1,266	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	769 46	943 43	13,326 —	97,953 <4.5%>	
<b>(タイ)</b>			千タイ・パーツ			
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	28	38	862	3,088	電気通信サービス	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	125	137	1,109	3,972	運輸	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	5	16	278	996	銀行	
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	74	296	713	2,553	ヘルスケア機器・サービス	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	144	236	254	912	運輸	
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	38	134	154	551	エネルギー	
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	24	60	279	998	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	111	195	273	977	運輸	
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	6	13	171	614	ヘルスケア機器・サービス	
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	30	72	466	1,668	不動産	
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	58	102	260	931	食品・飲料・タバコ	
CP ALL PCL-FOREIGN	142	185	1,419	5,083	食品・生活必需品小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	2	10	354	1,267	公益事業	
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	22	42	185	665	公益事業	
GLOW ENERGY PCL - FOREIGN	10	—	—	—	公益事業	

ニッセイ新興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>(タイ)</b>		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	–	15	261	934	公益事業	
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	74	184	312	1,119	小売	
INDORAMA VENTURES-FOREIGN	30	51	163	584	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	–	63	403	1,443	電気通信サービス	
IRPC PCL - FOREIGN	184	701	238	853	エネルギー	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	54	72	1,072	3,840	銀行	
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	67	114	188	673	銀行	
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	87	213	211	758	不動産	
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	41	71	260	934	消費者サービス	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	–	21	127	456	各種金融	
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	37	37	444	1,589	エネルギー	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	59	72	381	1,366	素材	
PTT PCL/FOREIGN	320	360	1,575	5,638	エネルギー	
RATCH GROUP PCL-FOREIGN	–	23	170	609	公益事業	
ROBINSON PCL-FOREIGN	10	10	65	233	小売	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	9	25	965	3,454	素材	
SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	52	28	324	1,162	銀行	
THAI OIL PCL-FRGN	24	24	163	584	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-F	37	98	132	473	食品・飲料・タバコ	
TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	271	271	37	135	銀行	
TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	–	22	131	470	電気通信サービス	
TRUE CORP PCL-FOREIGN	202	364	158	568	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,387 33	4,375 36	14,571 –	52,167 <2.4%>	
<b>(ポーランド)</b>				千ポーランド・ズロチ		
ALIOR BANK SA	1	1	5	159	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	0.75	–	–	–	銀行	
BANK MILLENNIUM SA	12	47	28	787	銀行	
BANK PEKAO SA	4	4	48	1,369	銀行	
CCC SA	0.57	0.57	6	180	耐久消費財・アパレル	
CD PROJEKT SA	1	2	57	1,621	メディア・娯楽	
CYFROWY POLSAT SA	4	4	12	345	メディア・娯楽	
DINO POLSKA SA	0.96	0.96	13	380	食品・生活必需品小売り	
GRUPA AZOTY SA	0.89	–	–	–	素材	
GRUPA LOTOS SA	1	2	26	734	エネルギー	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1	1	2	58	素材	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	2	4	40	1,127	素材	

## ニッセイ新興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>(ポーランド)</b>		百株	百株	千ポランド・ズチ	千円	
LPP SA		0.02	0.04	34	959	耐久消費財・アパレル
MBANK SA		0.30	1	41	1,175	銀行
ORANGE POLSKA SA		13	13	8	248	電気通信サービス
PGE SA		17	17	15	433	公益事業
PKO BANK POLSKI SA		27	27	102	2,869	銀行
PLAY COMMUNICATIONS SA		2	–	–	–	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		8	8	83	2,328	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		36	54	25	719	エネルギー
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		16	19	75	2,113	保険
SANTANDER BANK POLSKA S.A.		0.76	1	33	939	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	156 22	212 19	662 –	18,552 <0.9%>	
<b>(ハンガリー)</b>				千ハンガリー・フォリント		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		6	9	2,905	1,050	エネルギー
OTP BANK RT		6	6	9,276	3,353	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		2	6	3,738	1,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15 3	22 3	15,920 –	5,755 <0.3%>	
<b>(ユーロ/ギリシャ)</b>				千ユーロ		
FF GROUP		1	1	0.619	74	小売
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION		7	12	17	2,082	電気通信サービス
JUMBO SA		3	5	10	1,323	小売
MOTOR OIL (HELLAS) SA		2	2	5	656	エネルギー
OPAP SA		6	13	13	1,581	消費者サービス
TITAN CEMENT CO. S.A.		1	–	–	–	素材
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		–	3	6	803	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23 6	39 6	54 –	6,522 <0.3%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	58,480 834	84,605 920	–	1,850,663 <85.7%>	

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

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

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

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

ニッセイ新興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
<b>(アメリカ)</b>		千□	千□	千米ドル	千円
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF		7	9	133	14,502
ISHARES MSCI QATAR CP ETF		9	10	191	20,783
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		–	15	456	49,544
小計	□数・金額	16	35	781	84,830
	銘柄数<比率>	2	3	–	<3.9%>
<b>(トルコ)</b>				千トルコ・リラ	
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		3	–	–	–
小計	□数・金額	3	–	–	–
	銘柄数<比率>	1	–	–	<–>
<b>(メキシコ)</b>				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		8	8	266	1,494
小計	□数・金額	8	8	266	1,494
	銘柄数<比率>	1	1	–	<0.1%>
<b>(南アフリカ)</b>				千南アフリカ・ランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		6	9	205	1,513
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		0.485	–	–	–
RESILIENT REIT LTD		0.631	–	–	–
REDEFINE PROPERTIES LTD		14	29	245	1,806
FORTRESS REIT LTD-A		1	3	77	569
FORTRESS REIT LTD-B		1	–	–	–
小計	□数・金額	25	42	529	3,889
	銘柄数<比率>	6	3	–	<0.2%>
合計	□数・金額	55	86	–	90,215
	銘柄数<比率>	10	7	–	<4.2%>

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 MINI MSCI EM INDEX FUTURES	百万円 183	百万円 —

(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	1,850,663	85.1
投資信託証券	90,215	4.1
コール・ローン等、その他	234,379	10.8
投資信託財産総額	2,175,258	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香港ドル13.88円、1台湾ドル3.56円、1イギリス・ポンド140.33円、1トルコ・リラ19.03円、1メキシコ・ペソ5.61円、1フィリピン・ペソ2.13円、100チリ・ペソ13.79円、100コロンビア・ペソ3.16円、1インド・ルピー1.52円、100インドネシア・ルピア0.77円、1ブラジル・レアル25.86円、1チェコ・コルナ4.71円、100韓国ウォン9.29円、1人民元15.44円、1マレーシア・リングギット26.10円、1南アフリカ・ランド7.35円、1タイ・バーツ3.58円、1ポーランド・ズロチ28.01円、100ハンガリー・フォリント36.15円、1ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産 (2,088,262千円) の投資信託財産総額 (2,175,258千円) に対する比率は96.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,286,368,867円
コール・ローン等	156,979,444
株式(評価額)	1,850,663,620
投資信託証券(評価額)	90,215,065
未収入金	117,673,204
未収配当金	1,291,471
差入委託証拠金	69,546,063
(B)負債	125,849,834
未払金	111,537,253
未払解約金	14,311,923
その他未払費用	658
(C)純資産総額(A-B)	2,160,519,033
元本	2,309,692,542
次期繰越損益金	△ 149,173,509
(D)受益権総口数	2,309,692,542口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,354円

(注1) 期首元本額 1,844,866,571円  
 期中追加設定元本額 1,061,417,332円  
 期中一部解約元本額 596,591,361円

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

ニッセイ新興国株式インデックスファンド  
 (適格機関投資家限定) 787,226,995円  
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックス  
 ファンド 1,413,724,632円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)  
 49,901,389円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)  
 7,015,043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)  
 2,005,205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) 32,645,881円  
 DCニッセイ新興国株式インデックス 17,173,397円

(注3) 元本の欠損  
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は  
 149,173,509円です。

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	45,025,454円
受取配当金	43,685,497
受取利息	738,374
その他収益金	665,161
支払利息	△ 63,578
(B)有価証券売買損益	61,717,899
売買益	259,143,242
売買損	△ 197,425,343
(C)先物取引等損益	7,450,901
取引益	29,666,208
取引損	△ 22,215,307
(D)信託報酬等	△ 7,748,175
(E)当期損益金(A+B+C+D)	106,446,079
(F)前期繰越損益金	△ 203,294,197
(G)追加信託差損益金	△ 107,694,668
(H)解約差損益金	55,369,277
(I)合計(E+F+G+H)	△ 149,173,509
次期繰越損益金(I)	△ 149,173,509

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

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

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

# ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド

## 運用報告書

第 25 期

(計算期間：2019年5月14日～2019年11月12日)

<b>運用方針</b>	<p>①国内の金融商品取引所に上場しているJリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。</p> <p>②Jリートへの投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証REIT指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜追加・見直しを行います。</p>	<b>運用方法</b>	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"><li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li><li>・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</li><li>・外貨建資産への投資は行いません。</li></ul>
<b>主要運用対象</b>	国内の金融商品取引所に上場しているJリート		



ニッセイアセットマネジメント株式会社

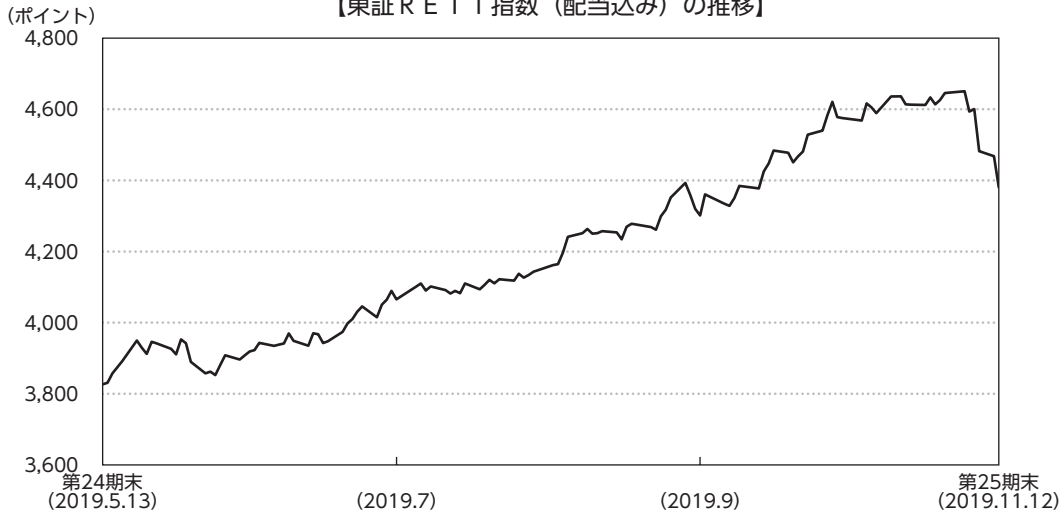
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2019年5月14日～2019年11月12日

## Jリート市況

【東証REIT指数（配当込み）の推移】

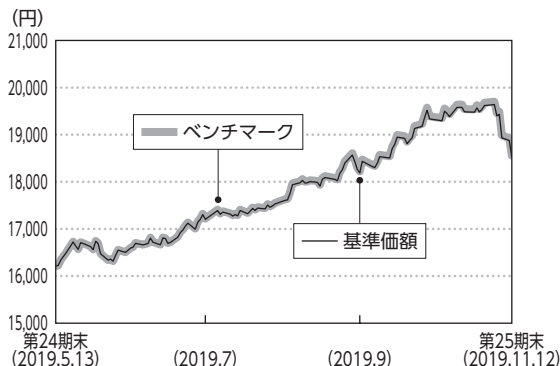


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期のJリート市場は上昇しました。

期初以降のJリート市場は、魅力的な配当利回り水準にあることや良好な不動産賃貸市況を背景とした着実な配当金成長を実現していることに加えて、活発な不動産売買市場を活用した物件入れ替えによる資産価値の顕在化やこれまで以上に収益性に連動した運用報酬体系への移行といったJリート各社による投資主価値向上を目的とした取り組みが評価され上昇基調で推移しました。当期末には米中貿易協議の進展に対する期待の高まりを受けて金利が上昇するとともに株式市場で投資家のリスク選好姿勢が強まったことを背景に、これまで相対的に高い配当利回りと業績の安定的な成長が評価されていたJリート市場から株式市場へ資金移動が生じたためJリート市場は急落しましたが、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは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

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「Ｊリート市況」をご参照ください。

## ポートフォリオ

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ポートフォリオの構築・運用は、東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+14.2%となり、ベンチマーク騰落率(+14.5%)を下回りました。これは未収配当を含めたキャッシュ保有の影響などによるものです。

## 今後の運用方針

東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄について完全法にて投資を行い、ベンチマークの動きに連動する成果を目標に運用を行います。

## 最近５期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
21期 (2017年11月13日)	12,990	△ 6.8	12,633	△ 6.9	98.3	14,369
22期 (2018年 5月14日)	14,359	10.5	13,977	10.6	98.4	16,412
23期 (2018年11月12日)	15,019	4.6	14,633	4.7	98.4	17,161
24期 (2019年 5月13日)	16,209	7.9	15,818	8.1	98.5	20,640
25期 (2019年11月12日)	18,510	14.2	18,107	14.5	98.6	31,230

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	投資信託証券組入比率
(期首) 2019年 5月13日	円 16,209	% -	15,818	% -	% 98.5
5月末	16,472	1.6	16,079	1.6	98.7
6月末	16,715	3.1	16,319	3.2	98.4
7月末	17,434	7.6	17,032	7.7	98.5
8月末	18,082	11.6	17,676	11.7	98.1
9月末	18,921	16.7	18,510	17.0	98.5
10月末	19,536	20.5	19,122	20.9	98.5
(期末) 2019年11月12日	18,510	14.2	18,107	14.5	98.6

(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14日～2019年11月12日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	0	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,799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14日～2019年11月12日

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.082	9,568	0.012	1,424
サンケイリアルエステート投資法人	0.214	25,644	0.015	1,809
日本アコモデーションファンド投資法人	0.264	172,914	0.037	24,178
MCUBS MidCity投資法人	1	119,323	0.120	13,977
森ヒルズリート投資法人	0.917	151,838	0.123	20,738
産業ファンド投資法人	1	164,238	0.136	21,379
アドバンス・レジデンス投資法人	0.822	283,237	0.231	78,599
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.497	100,947	0.063	13,076
アクティブ・プロパティーズ投資法人	0.408	212,807	0.119	61,418
GLP投資法人	1	267,163	0.259	34,260
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.334	111,184	0.046	15,481
日本プロロジスリート投資法人	1	366,381	0.158	44,582
星野リゾート・リート投資法人	0.121	69,000	0.018	10,253
Oneリート投資法人	0.143	43,978	0.015	4,818
イオンリート投資法人	0.973	138,011	0.123	17,891
ヒューリックリート投資法人	0.759	147,791	0.087	17,276
日本リート投資法人	0.260	115,180	0.034	15,545
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6	120,340	0.643	12,947
日本ヘルスケア投資法人	0.044	8,304	0.005	953
積水ハウス・リート投資法人	3	267,356	0.322	29,665
トーセイ・リート投資法人	0.247	33,010	0.044	5,537
ケネディクス商業リート投資法人	0.351	97,762	0.045	12,372
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.175	23,335	0.021	2,783
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.160	18,876	0.024	2,790
野村不動産マスターファンド投資法人	2	459,505	0.345	65,398
いちごホテルリート投資法人	0.135	17,251	0.042	5,301
ラサールロジポート投資法人	1	160,737	0.090	13,810
スターアジア不動産投資法人	0.306	35,731	0.033	3,785
マリモ地方創生リート投資法人	0.070	8,641	0.011	1,393
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.199	82,862	0.023	9,759
大江戸温泉リート投資法人	0.149	13,361	0.015	1,418
さくら総合リート投資法人	0.170	16,284	0.023	2,177

国内

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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
	千口	千円	千口	千円
投資法人みらい	0.866	50,571	0.110	6,371
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.186	26,447	0.026	3,715
三菱地所物流リート投資法人	0.348	115,695	0.016	5,411
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.194	24,706	0.011	1,486
ザイマックス・リート投資法人	0.226	29,567	0.012	1,562
タカラレーベン不動産投資法人	0.509	60,850	0.024	2,835
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.122	13,518	0.016	1,848
日本ビルファンド投資法人	0.774	608,357	0.113	89,426
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.799	557,219	0.116	81,646
日本リテールファンド投資法人	1	337,626	0.219	51,417
オリックス不動産投資法人	1	351,081	0.232	52,520
日本プライムリアルティ投資法人	0.507	250,077	0.075	37,316
プレミア投資法人	0.735	111,638	0.221	32,971
東急リアル・エステート投資法人	0.536	107,366	0.078	15,427
グローバル・ワン不動産投資法人	0.557	79,175	0.077	10,769
ユナイテッド・アーバン投資法人	1	371,255	0.262	53,299
森トラスト総合リート投資法人	0.570	107,503	0.082	15,419
インヴィンシブル投資法人	5	341,977	0.408	26,192
フロンティア不動産投資法人	0.318	147,489	0.043	20,508
平和不動産リート投資法人	0.499	67,159	0.074	10,091
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.522	138,403	0.076	20,404
福岡リート投資法人	0.414	74,912	0.061	11,038
ケネディクス・オフィス投資法人	0.247	199,711	0.036	29,159
いちごオフィスリート投資法人	0.633	67,823	0.224	23,456
大和証券オフィス投資法人	0.185	150,843	0.027	22,124
阪急阪神リート投資法人	0.360	57,598	0.048	8,120
スターツプロシード投資法人	0.125	24,102	0.022	4,163
大和ハウスリート投資法人	1	306,143	0.140	40,965
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2	220,442	0.370	32,489
日本賃貸住宅投資法人	0.900	85,726	0.132	12,589
ジャパンエクセレント投資法人	0.716	121,446	0.105	18,497

(注1) 金額は受渡代金です。

(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。

## 組入有価証券明細表

2019年11月12日現在

## 国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.222	0.292		35,653
サンケイリアルエステート投資法人	0.214	0.413		48,857
日本アコモデーションファンド投資法人	0.720	0.947		625,020
MCUBS MidCity投資法人	2	3		380,137
森ヒルズリート投資法人	2	3		552,998
産業ファンド投資法人	2	3		577,624
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2		917,329
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1	1		362,755
アクティブア・プロパティーズ投資法人	1	1		784,850
GLP投資法人	5	7		933,702
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.898	1		405,019
日本プロロジスリート投資法人	2	4		1,177,146
星野リゾート・リート投資法人	0.330	0.433		242,047
Oneリート投資法人	0.316	0.444		142,524
イオンリート投資法人	2	3		440,811
ヒューリックリート投資法人	1	2		475,150
日本リート投資法人	0.699	0.925		435,212
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12	18		363,294
日本ヘルスケア投資法人	0.099	0.138		26,910
積水ハウス・リート投資法人	5	8		766,360
トーセイ・リート投資法人	0.417	0.620		80,042
ケネディクス商業リート投資法人	0.794	1		298,210
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.454	0.608		78,918
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.434	0.570		64,809
野村不動産マスターファンド投資法人	6	8		1,696,844
いちごホテルリート投資法人	0.379	0.472		61,501
ラサールロジポート投資法人	1	2		414,038
スターアジア不動産投資法人	0.672	0.945		104,422
マリモ地方創生リート投資法人	0.186	0.245		31,017
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.526	0.702		302,562
大江戸温泉リート投資法人	0.350	0.484		46,270
さくら総合リート投資法人	0.469	0.616		56,364

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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	
	千□	千□	千円	
投資法人みらい	2	3	178,293	
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.508	0.668	93,252	
三菱地所物流リート投資法人	0.229	0.561	193,825	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.217	0.400	52,040	
ザイマックス・リート投資法人	0.200	0.414	53,406	
タカラレーベン不動産投資法人	0.324	0.809	94,653	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.335	0.441	50,803	
日本ビルファンド投資法人	2	2	2,160,297	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	2	1,997,149	
日本リテールファンド投資法人	4	5	1,298,082	
オリックス不動産投資法人	4	5	1,320,237	
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	876,258	
プレミア投資法人	2	2	392,382	
東急リアル・エステート投資法人	1	1	371,495	
グローバル・ワン不動産投資法人	1	1	267,030	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4	6	1,344,649	
森トラスト総合リート投資法人	1	2	380,324	
インヴィンシブル投資法人	7	12	777,251	
フロンティア不動産投資法人	0.737	1	475,134	
平和不動産リート投資法人	1	1	242,683	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	1	499,306	
福岡リート投資法人	1	1	263,667	
ケネディクス・オフィス投資法人	0.670	0.881	710,086	
いちごオフィスリート投資法人	1	2	236,262	
大和証券オフィス投資法人	0.500	0.658	538,244	
阪急阪神リート投資法人	0.975	1	221,750	
スターツプロシード投資法人	0.341	0.444	87,379	
大和ハウスリート投資法人	2	3	1,133,095	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6	9	780,045	
日本賃貸住宅投資法人	2	3	309,826	
ジャパンエクセレント投資法人	1	2	456,884	
合計	□数・金額	119	164	30,784,197
	銘柄数<比率>	63	63	<98.6%>

(注1) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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。

投資信託財産の構成

2019年11月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託証券	30,784,197	95.5%
コール・ローン等、その他	1,439,226	4.5%
投資信託財産総額	32,223,423	100.0%

(注) 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12日現在)

項目	当期末
(A) 資産	32,223,423,559円
コール・ローン等	792,647,436
投資信託証券(評価額)	30,784,197,200
未収入金	415,966,524
未収配当金	230,612,399
(B) 負債	992,477,248
未払解約金	992,471,957
その他未払費用	5,291
(C) 純資産総額(A-B)	31,230,946,311
元本	16,872,685,759
次期繰越損益金	14,358,260,552
(D) 受益権総口数	16,872,685,759口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,510円

- (注1) 期首元本額 12,733,396,683円  
 期中追加設定元本額 7,921,986,718円  
 期中一部解約元本額 3,782,697,642円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。  
 ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定) 1,589,972,269円  
 DCニッセイJ-REITインデックスファンド 1,581,536,665円  
 <購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド 8,419,133,428円  
 ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定) 1,858,829,013円  
 DCニッセイJ-REITインデックスファンドA 2,561,151,816円  
 DCニッセイJ-REITインデックスファンドB 803,438,830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) 37,334,238円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) 3,061,187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) 909,984円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) 2,578,683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) 14,739,646円

損益の状況

当期(2019年5月14日~2019年11月12日)

項目	当期
(A) 配当等収益	458,831,258円
受取配当金	458,993,135
受取利息	5,835
その他収益	11
支払利息	△ 167,723
(B) 有価証券売買損益	2,695,037,429
売却益	2,728,119,915
売却損	△ 33,082,486
(C) 信託報酬等	△ 12,245
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,153,856,442
(E) 前期繰越損益金	7,906,726,433
(F) 追加信託差損益金	6,453,784,418
(G) 解約差損益金	△ 3,156,106,741
(H) 合計(D+E+F+G)	14,358,260,552
次期繰越損益金(H)	14,358,260,552

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

# ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 2 期

(計算期間：2018年11月21日～2019年11月20日)

#### 運用方針

主に各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、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

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

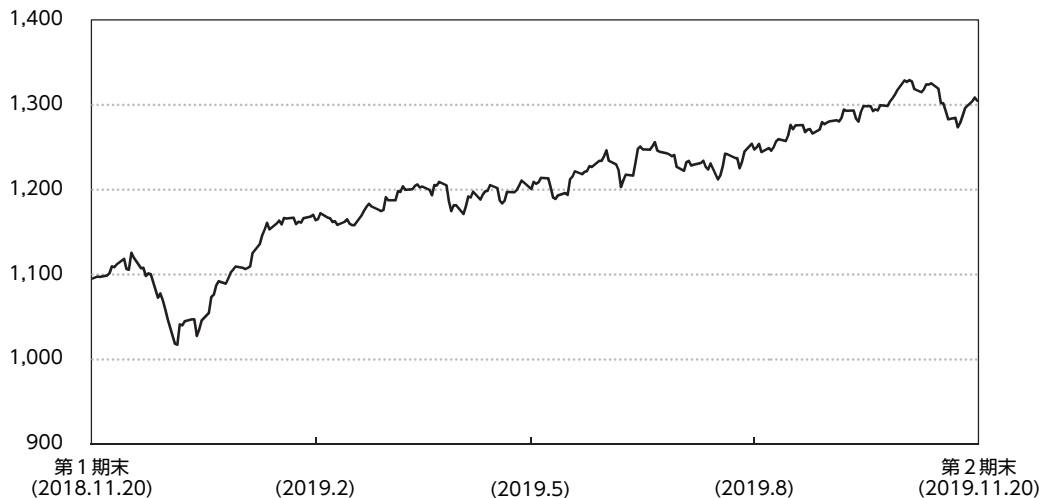
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2018年11月21日～2019年11月20日

## 先進国リート市況

【S & P先進国REITインデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】



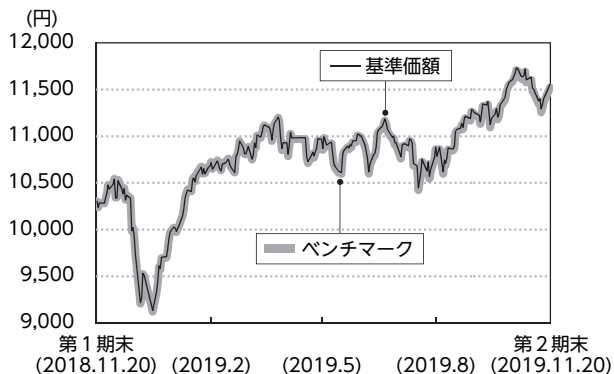
(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の先進国REIT市場は米中通商協議の進展期待から上昇して始まりました。

12月に入ると米国における経済指標の後退や政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理が悪化したため2019年1月初めにかけて下落しましたが、その後、4月中旬にかけては米長期金利が低下基調であったことや米企業の1-3月期業績が良好であったことを好感して上昇しました。

期末にかけては米中貿易摩擦の動向により下落する場面もありましたが、欧州中央銀行（ECB）による景気刺激策への期待感や良好な米主要株価指標を受けて株式市場が上昇したことから先進国REIT市場もつられて堅調推移となり、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## 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>

- ・2019年1月から当期末にかけて米長期金利が低下傾向で推移したことや米中貿易摩擦に対する懸念の後退、またECBによる景気刺激策への期待感や米株式市場の上昇につられて先進国REIT市場が上昇基調となったこと

#### <下落要因>

- ・期初から2019年1月初めにかけて米国において景気指標が後退したことや政府機関の一部閉鎖などにより米経済に対する投資家心理の悪化を受けて先進国REIT市場が軟調に推移したこと

## ポートフォリオ

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）している日本を除く先進国のリート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+12.2%となり、ベンチマーク騰落率（+11.8%）におおむね連動しました。

## 今後の運用方針

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）している日本を除く先進国のリート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。

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2017年9月28日	10,000	—	10,000	—	—	—	2,000
1期(2018年11月20日)	10,304	3.0	10,249	2.5	—	98.3	2,017
2期(2019年11月20日)	11,556	12.2	11,458	11.8	—	97.7	2,470

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 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3) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%
(期首)2018年11月20日	10,304	—	10,249	—	—	98.3
11月末	10,433	1.3	10,382	1.3	—	98.2
12月末	9,513	△ 7.7	9,454	△ 7.8	—	98.2
2019年1月末	10,385	0.8	10,334	0.8	—	98.5
2月末	10,627	3.1	10,577	3.2	—	98.3
3月末	11,013	6.9	10,948	6.8	—	97.8
4月末	10,983	6.6	10,912	6.5	—	97.7
5月末	10,674	3.6	10,601	3.4	—	98.3
6月末	10,701	3.9	10,623	3.7	—	98.1
7月末	10,965	6.4	10,886	6.2	—	98.3
8月末	10,875	5.5	10,800	5.4	—	98.3
9月末	11,333	10.0	11,245	9.7	—	97.9
10月末	11,719	13.7	11,630	13.5	0.0	97.4
(期末)2019年11月20日	11,556	12.2	11,458	11.8	—	97.7

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2018年11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 (株式) (投資信託証券)	4円 (0) (4)	0.035% (0.000) (0.035)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	1 (0) (1)	0.010 (0.000) (0.010)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用) (その他)	8 (7) (1)	0.074 (0.064) (0.010)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	13	0.119	

(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（10,798円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2018年11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	千米ドル	百株	千米ドル
		—	—	0.07	0.151
		(0.07)	(0.198)		

(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。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。

ニッセイ先進国リート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	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.269	35	0.235	30
AGREE REALTY CORP	0.210	13	—	—
ALEXANDER'S INC	0.026	10	0.067	23
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.209	29	—	—
PROLOGIS INC	1	79	0.445	37
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	0.202	10	0.130	6
		( 3)		
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	1	3
		(△0.114)		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.190	38	0.051	10
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.257	25	0.008	0.880
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17	23	19	25
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.266	13	—	—
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	0.396	11	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	0.579	20	0.080	3
	(△ 4)			
DUKE REALTY CORP	0.455	13	—	—
EASTGROUP PROPERTIES	0.212	24	0.014	1
EPR PROPERTIES	0.130	10	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	0.583	44	0.564	48
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.128	38	0.062	20
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.159	20	0.118	15
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	0.528	18	—	—
GETTY REALTY CORP	—	—	0.054	1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	—	—	0.206	4
HCP INC	0.913	27	—	—
WELLTOWER INC	0.992	78	0.118	10
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.328	10	0.034	1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.515	22	—	—
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	0.717	18	0.371	9
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	—	0.204	3
EQUITY COMMONWEALTH	1	46	1	36
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	—	—	—	0.019
	(△ 1)			
KILROY REALTY CORP	0.135	10	0.136	10
KIMCO REALTY CORP	0.567	10	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
LEXINGTON REALTY TRUST	2	22	1	11
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.723	36	0.187	11
MACK-CALI REALTY CORP	–	–	0.400	8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.299	36	0.198	25
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.273	10	–	0.003
	( 0.116)	(△0.988)		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	–	–	0.219	6
PENN REAL ESTATE INVEST TST	–	–	0.509	2
PUBLIC STORAGE	0.368	85	0.276	62
REGENCY CENTERS CORP	0.154	10	–	–
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.284	47	0.101	15
SL GREEN REALTY CORP	0.119	10	0.223	20
LIFE STORAGE INC	–	–	0.006	0.628
SUN COMMUNITIES INC	0.281	37	0.109	16
UDR INC	0.463	21	–	–
VENTAS INC	0.695	44	0.079	5
VORNADO REALTY TRUST	–	–	0.206	12
WP CAREY INC	1	86	0.075	6
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	0.387	10	0.084	2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	–	–	–	–
	(△ 1)			
REALTY INCOME CORP	0.763	53	0.018	1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.172	20	0.013	1
	( 1)			
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.095	10	0.017	1
CUBESMART	1	42	0.878	28
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.179	20	0.107	13
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	0.220	10	0.033	1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3	58	0.711	13
URSTADT BIDDLE - CL A	–	–	0.040	0.944
DOUGLAS EMMETT INC	0.504	20	0.173	7
IRON MOUNTAIN INC	–	–	0.112	3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	0.291	10	–	–
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	–	–	0.199	5
	( 1)			
CHESAPEAKE LODGING TRUST	–	–	–	–
	(△0.934)			
TERRENO REALTY CORP	0.222	10	–	–

外国

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
CORESITE REALTY CORP	0.170	16	0.065	7
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.533	24	0.418	19
CHATHAM LODGING TRUST	–	–	0.258	4
STAG INDUSTRIAL INC	0.675	19	–	–
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	–	–	0.017	0.199
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	–	–	–	0.007
	(△ 1)			
EQUINIX INC	1	810	–	–
VEREIT	5	47	0.601	5
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	0.368	10	0.142	4
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.511	10	1	19
SELECT INCOME REIT	–	–	–	–
	(△ 1)			
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	–	–	0.045	3
CORECIVIC INC	–	–	0.376	6
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	0.427	10	0.102	2
CYRUSONE INC	0.178	10	0.008	0.620
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.592	10	0.207	3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	41	–	–
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.243	10	0.009	0.432
	(△ 5)			
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	–	–	0.524	19
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	–	–	0.214	2
		(△0.084)		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.582	10	–	–
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.240	10	0.063	3
WASHINGTON PRIME GROUP INC	–	–	0.930	3
CARETRUST REIT INC	0.809	19	–	–
STORE CAPITAL CORP	0.730	24	0.104	3
URBAN EDGE PROPERTIES	1	22	–	–
XENIA HOTELS & RESORTS INC	0.967	19	0.606	12
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.338	10	–	–
APPLE HOSPITALITY REIT INC	–	–	0.407	6
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	–	–	0.191	2
GLOBAL NET LEASE INC	–	–	0.426	8
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	–	–	1	21
FOREST CITY REALTY TRUST- A	–	–	4	104
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	–	–	0.022	0.959

外国

ニッセイ先進国リート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
<b>(アメリカ)</b>	千口	千米ドル	千口	千米ドル
FARMLAND PARTNERS INC	-	-	0.696	4
MANULIFE US REAL ESTATE INV	-	-	10	9
		(△0.669)		
TIER REIT INC	-	-	-	-
	(△0.743)			
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	-	-	-	-
	(△0.494)			
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	0.611	19	0.100	2
	( 0.586)	(△ 10)		
COLONY CAPITAL INC	-	-	0.883	5
INVITATION HOMES INC	4	131	1	32
JBG SMITH PROPERTIES	0.243	10	-	-
CLIPPER REALTY INC	-	-	0.562	6
GLADSTONE LAND CORP	-	-	0.168	2
GLOBAL MEDICAL REIT INC	-	-	1	13
INFRAREIT INC	-	-	0.605	12
VICI PROPERTIES INC	6	129	-	-
AMERICOLD REALTY TRUST	2	74	-	-
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	-	-	-	0.010
	( 0.502)			
SPIRIT MTA REIT	-	-	1	9
RETAIL VALUE INC	-	-	0.243	9
	( 0.014)	( 0.445)		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	1	34	0.412	8
BRT APARTMENTS CORP	1	22	1	19
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.260	20	0.116	11
SAFEHOLD INC	0.743	21	0.587	20
AMERICAN FINANCE TRUST INC	1	17	-	-
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	1	17	-	-
ARA US HOSPITALITY TRUST	25	21	-	-
COREPOINT LODGING INC	2	22	1	11
<b>(カナダ)</b>		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.400	12	-	-
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	-	-	0.500	24
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	-	-	0.200	2
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	-	-	0.200	4
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.500	13	1	25
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	-	-	0.200	3

外国

ニッセイ先進国リート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
<b>(カナダ)</b>	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2	24	1	16
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	28	0.900	13
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	28	—	—
SLATE RETAIL REIT	—	—	0.300	3
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	—	—	0.200	2
SLATE OFFICE REIT	—	—	0.400	2
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1	13	—	—
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	0.700	13	0.200	4
<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	2	29	0.431	5
GPT GROUP	4	29	0.372	2
GOODMAN GROUP	1	20	0.380	5
STOCKLAND	3	14	1	5
MIRVAC GROUP	6	20	—	—
INVESTA OFFICE FUND	—	—	7	43
CHARTER HALL RETAIL REIT	—	—	0.408	1
CHARTER HALL GROUP	2	27	0.960	10
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	—	—	0.329	1
GDI PROPERTY GROUP	—	—	1	2
APN INDUSTRIA REIT	—	—	1	4
NATIONAL STORAGE REIT	9	17	4	7
SCENTRE GROUP	3	15	1	6
ARENA REIT	—	—	0.755	2
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	—	—	2	7
CHARTER HALL LONG WALE REIT	5	33	—	—
PROPERTYLINK GROUP	—	—	7	9
CENTURIA METROPOLITAN REIT	10	32	5	16
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	3	274	2	217
PROSPERITY REIT	—	—	18	52
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26	130	26	134
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	31	163	—	—
FORTUNE REIT	15	157	18	177
<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	—	—	—	—
		(△0.785)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7	13	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	5	13	1	3

外国

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
KEPPEL REIT	–	–	–	–
		(△0.090)		
SUNTEC REIT	19	36	8	15
		(△0.449)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	12	16	–	–
		(△0.870)		
STARHILL GLOBAL REIT	–	–	2	1
		(△0.010)		
ASCOTT RESIDENCE TRUST	–	–	3	5
		(△0.466)		
FRASERS COMMERCIAL TRUST	14	23	6	10
		(△0.061)		
FRASERS CENTREPOINT TRUST	5	14	–	–
ESR REIT	–	–	–	–
		(△0.068)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	–	–	1	2
		(△0.161)		
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	–	–	–	–
		(△0.522)		
AIMS APAC REIT	–	–	8	12
		(△0.015)		
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	–	–	–	–
		(△0.323)		
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	–	–	–	–
		(△0.247)		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	6	17	7	22
		(△0.127)		
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	6	13	0.900	2
		(△0.028)		
CACHE LOGISTICS TRUST	–	–	11	8
		(△0.018)		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	10	18	14	25
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	–	–	1	1
		(△0.139)		
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	–	–	5	3
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	–	–	12	5
		(△0.015)		
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	–	–	–	–
		(△0.626)		

ニッセイ先進国リート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
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	–	–	9	5
		(△0.006)		
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	57	30	23	12
	( 23)	(△0.705)		
FRASERS HOSPITALITY TRUST	21	15	21	15
SPH REIT	–	–	9	10
OUE HOSPITALITY TRUST	–	–	–	–
	(△ 17)			
KEPPEL DC REIT	24	46	–	–
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	25	26	4	5
		(△0.702)		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	38	30	23	19
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	–	–	5	–
	( 5)			
<b>(ニュージーランド)</b>		千ニュージーランド・ドル		千ニュージーランド・ドル
KIWI PROPERTY GROUP LTD	20	32	27	41
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	–	–	7	12
GOODMAN PROPERTY TRUST	–	–	4	10
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	–	–	3	8
ARGOSY PROPERTY LTD	–	–	5	7
STRIDE PROPERTY GROUP	–	–	5	12
<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	1	8	–	–
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.858	7	–	–
SEGRO PLC	4	35	0.958	7
WORKSPACE GROUP PLC	1	15	0.438	4
INTU PROPERTIES PLC	10	10	13	14
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1	11	0.072	0.517
SHAFTESBURY PLC	1	10	1	14
DERWENT LONDON PLC	0.235	7	–	–
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	–	–	1	0.592
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4	8	–	–
HANSTEEN HOLDINGS PLC	–	–	4	4
RDI REIT PLC	–	–	–	–
	(△ 15)			
TRITAX BIG BOX REIT PLC	10	15	5	7
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	–	–	5	5
REGIONAL REIT LTD	–	–	4	4
UNITE GROUP PLC	0.813	7	–	–
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	9	10	6	5

外国

ニッセイ先進国リート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
<b>(イギリス)</b>	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	20	19	9	8
PICTON PROPERTY INCOME LTD	10	8	7	6
AEW UK REIT PLC	20	18	16	15
<b>(イスラエル)</b>		千イスラエル・シケル		千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	2	37	0.673	14
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>		千ユーロ		千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC-W/I	11	15	4	7
GREEN REIT PLC	—	—	10	20
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	—	—	5	8
<b>(ユーロ/オランダ)</b>				
NSI NV	—	—	0.158	6
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>				
COFINIMMO	0.327	38	—	—
RETAIL ESTATES	—	—	0.098	8
BEFIMMO S.C.A.	0.225	11	0.088	4
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	—	—	0.245	6
AEDIFICA	0.284	24	0.208	17
MONTEA	0.182	11	0.047	3
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS	—	—	0.245	0.110
MONTEA-RTS	—	—	0.182	—
	(0.182)			
AEDIFICA SA-RTS	—	—	—	—
		(△0.221)		
<b>(ユーロ/フランス)</b>				
KLEPIERRE	0.291	9	—	—
GECINA SA	0.193	25	0.009	1
COVIVIO	—	—	0.305	29
	(0.130)	( 11)		
MERCIALYS	—	—	0.357	4
ICADE	0.238	18	0.342	28
ALTAREA	—	—	0.057	10
		(△0.657)		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.248	35	0.069	9
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	—	—	—	—
		(△ 1)		
HAMBORNER REIT AG	—	—	1	11
<b>(ユーロ/スペイン)</b>				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	—	—	0.221	1
		(△0.101)		

外国

## ニッセイ先進国リート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/スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	0.739	8 (△0.504)	0.093	1
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	—	— (△0.615)	2	21
外 (ユーロ/イタリア)				
国 BENI STABILI SPA	— (△ 15)	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	—	— (△0.015)	—	—
COVIVIO	—	— (△ 11)	—	0.056

(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。

### 主要な売買銘柄

2018年11月21日～2019年11月20日

#### 株式

銘柄	買付			売付			
	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
—	—	—	—	ASHFORD INC	0.007	16	2,346

(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

## 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	2	2	350	38,024
ACADIA REALTY TRUST	1	1	35	3,878
AGREE REALTY CORP	0.445	0.655	49	5,346
ALEXANDER'S INC	0.059	0.018	5	635
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	1	308	33,486
PROLOGIS INC	10	10	989	107,439
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	2	137	14,915
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3	2	5	628
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	2	506	55,047
BRANDYWINE REALTY TRUST	2	2	41	4,514
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	1	185	20,151
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6	4	6	750
CEDAR REALTY TRUST INC	1	1	3	364
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	2	159	17,295
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1	1	56	6,178
COUSINS PROPERTIES INC	6	2	108	11,790
SITE CENTERS CORP	2	2	35	3,818
DUKE REALTY CORP	5	6	222	24,139
EASTGROUP PROPERTIES	0.533	0.731	97	10,607
EPR PROPERTIES	1	1	94	10,219
EQUITY RESIDENTIAL	5	5	514	55,888
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	352	38,247
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	159	17,275
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1	2	100	10,961
GETTY REALTY CORP	0.508	0.454	15	1,643
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.430	0.224	5	550
HCP INC	7	8	295	32,087
WELLTOWER INC	6	6	586	63,673
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1	2	72	7,849
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.611	0.611	8	943
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	2	101	11,012
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2	2	68	7,393
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	12	214	23,298
EQUITY COMMONWEALTH	1	1	45	4,964

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1	0.187	13	1,517
KILROY REALTY CORP	1	1	133	14,523
KIMCO REALTY CORP	6	7	160	17,425
LEXINGTON REALTY TRUST	3	4	49	5,361
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	2	173	18,801
LTC PROPERTIES INC	0.615	0.615	29	3,171
MACERICH CO/THE	1	1	46	4,997
MACK-CALI REALTY CORP	1	1	33	3,615
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	1	256	27,904
MONMOUTH REIT -CL A	1	1	17	1,862
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.637	0.637	51	5,574
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	3	3	149	16,258
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.246	0.027	0.732	79
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2	1	9	1,012
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.309	0.309	54	5,931
PUBLIC STORAGE	2	2	522	56,758
RPT REALTY	1	1	18	1,959
REGENCY CENTERS CORP	2	2	185	20,098
SAUL CENTERS INC	0.186	0.186	9	1,060
SENIOR HOUSING PROP TRUST	3	3	27	2,953
SIMON PROPERTY GROUP INC	4	5	777	84,403
SL GREEN REALTY CORP	1	1	121	13,188
LIFE STORAGE INC	0.723	0.717	78	8,573
SUN COMMUNITIES INC	1	1	243	26,433
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	1	23	2,527
TAUBMAN CENTERS INC	0.943	0.943	31	3,456
UDR INC	4	4	236	25,710
UMH PROPERTIES INC	0.479	0.479	7	775
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.194	0.194	23	2,505
VENTAS INC	5	6	370	40,245
VORNADO REALTY TRUST	2	2	176	19,217
WP CAREY INC	1	2	234	25,468
WASHINGTON REAL ESTATE INV	1	1	37	4,020
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1	2	68	7,441
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1	—	—	—
REALTY INCOME CORP	4	5	414	45,048
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	2	210	22,822

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
KITE REALTY GROUP TRUST	1	1	30	3,362
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	2	228	24,811
CUBESMART	2	3	96	10,490
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	3	432	46,968
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	2	2	109	11,881
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3	3	31	3,412
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	8	166	18,135
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3	3	48	5,287
URSTADT BIDDLE - CL A	0.462	0.422	10	1,116
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	1	14	1,572
DOUGLAS EMMETT INC	2	2	124	13,570
IRON MOUNTAIN INC	4	4	164	17,840
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	2	49	5,336
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	2	96	10,471
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1	2	63	6,917
CHESAPEAKE LODGING TRUST	0.934	—	—	—
TERRENO REALTY CORP	0.813	1	58	6,373
CORESITE REALTY CORP	0.567	0.672	77	8,426
RLJ LODGING TRUST	3	3	52	5,648
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.644	0.759	35	3,876
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1	1	31	3,378
CHATHAM LODGING TRUST	0.958	0.700	12	1,370
STAG INDUSTRIAL INC	1	2	65	7,163
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	1	1	18	2,054
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1	0.707	22	2,470
EQUINIX INC	—	1	807	87,745
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	3	3	50	5,481
VEREIT	15	19	190	20,665
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	3	3	101	11,077
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	3	73	8,021
SELECT INCOME REIT	1	—	—	—
WHITESTONE REIT	0.599	0.599	8	911
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.942	0.897	79	8,630
CORECIVIC INC	2	2	32	3,563
GEO GROUP INC/THE	2	2	30	3,321
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3	4	111	12,135
CYRUSONE INC	1	1	129	14,034

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
PHYSICIANS REALTY TRUST	2	3	58	6,397
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	2	111	12,122
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7	1	84	9,216
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	1	1	28	3,047
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	2	127	13,900
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	0.866	8	908
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	5	125	13,643
QTS REALTY TRUST INC-CL A	0.870	1	54	5,889
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	1	1	38	4,172
WASHINGTON PRIME GROUP INC	5	4	18	1,974
CARETRUST REIT INC	1	1	40	4,426
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	1	1	18	2,032
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	0.508	0.508	6	751
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	1	1	10	1,101
STORE CAPITAL CORP	2	3	139	15,181
PARAMOUNT GROUP INC	3	3	42	4,664
URBAN EDGE PROPERTIES	1	2	58	6,324
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.677	0.677	15	1,688
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1	2	42	4,611
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	0.688	1	33	3,624
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.298	0.298	14	1,546
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	2	45	4,986
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.376	0.185	2	234
CITY OFFICE REIT INC	0.423	0.423	5	616
GLOBAL NET LEASE INC	1	1	28	3,146
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.951	0.951	26	2,888
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.390	0.390	16	1,797
FOREST CITY REALTY TRUST- A	4	—	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.266	0.244	11	1,238
FARMLAND PARTNERS INC	1	0.604	3	415
MANULIFE US REAL ESTATE INV	14	4	4	495
TIER REIT INC	0.743	—	—	—
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	0.494	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	3	4	98	10,751
COLONY CAPITAL INC	9	8	41	4,457
INVITATION HOMES INC	4	8	244	26,571

ニッセイ先進国リート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>(アメリカ)</b>		千口	千口	千米ドル	千円
JBG SMITH PROPERTIES		1	1	71	7,788
CLIPPER REALTY INC		0.655	0.093	0.867	94
GLADSTONE LAND CORP		0.168	—	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC		1	0.215	2	308
INFREIT INC		0.605	—	—	—
VICI PROPERTIES INC		1	7	187	20,315
AMERICOLD REALTY TRUST		0.888	3	124	13,496
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		0.305	0.807	17	1,885
SPIRIT MTA REIT		1	—	—	—
RETAIL VALUE INC		0.555	0.326	12	1,368
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC		—	1	25	2,795
BRT APARTMENTS CORP		—	0.345	5	643
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		0.491	0.491	5	578
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		0.080	0.224	18	2,013
SAFEHOLD INC		—	0.156	5	586
AMERICAN FINANCE TRUST INC		—	1	18	2,058
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		—	1	34	3,716
ARA US HOSPITALITY TRUST		—	25	21	2,381
COREPOINT LODGING INC		—	1	10	1,100
小計	□数・金額	372	404	16,768	1,821,216
	銘柄数<比率>	156	154	—	<73.7%>
<b>(カナダ)</b>				千カナダ・ドル	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		0.300	0.300	14	1,166
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		1	1	44	3,655
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1	1	59	4,873
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		1	1	17	1,414
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM		0.500	0.500	14	1,214
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		2	2	43	3,555
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE		0.300	0.300	8	735
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		2	1	50	4,170
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		0.700	0.700	38	3,113
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		1	1	12	1,062
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		0.600	0.400	6	520
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		0.600	1	17	1,403
Dream Global Real Estate Investm		1	1	21	1,780

ニッセイ先進国リート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
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	0.600	0.600	9	794
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.300	0.300	20	1,676
CHOICE PROPERTIES REIT	1	1	23	1,942
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.200	0.200	3	307
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	0.400	1	21	1,751
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	0.400	2	36	2,954
SLATE RETAIL REIT	0.300	–	–	–
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	0.500	0.500	9	801
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.200	–	–	–
SLATE OFFICE REIT	0.400	–	–	–
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	0.400	1	17	1,459
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	–	0.500	11	930
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	19 24	22 22	504 – <1.7%>
<b>(オーストラリア)</b>			千オーストラリア・ドル	
DEXUS	16	18	226	16,803
GPT GROUP	29	34	209	15,537
GOODMAN GROUP	26	27	410	30,436
STOCKLAND	39	42	210	15,630
BWP TRUST	7	7	31	2,360
MIRVAC GROUP	62	68	225	16,717
INVESTA OFFICE FUND	7	–	–	–
CHARTER HALL RETAIL REIT	5	4	21	1,568
ABACUS PROPERTY GROUP	5	5	19	1,417
VICINITY CENTRES	53	53	143	10,620
CHARTER HALL GROUP	7	9	99	7,370
CROMWELL PROPERTY GROUP	24	24	31	2,299
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	11	11	30	2,284
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	3	3	15	1,149
INGENIA COMMUNITIES GROUP	3	3	14	1,050
GDI PROPERTY GROUP	7	5	9	669
APN INDUSTRIA REIT	1	–	–	–
NATIONAL STORAGE REIT	7	13	26	1,972
SCENTRE GROUP	88	90	362	26,909
ARENA REIT	4	3	9	713
CHARTER HALL EDUCATION TRUST	3	3	11	870
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	2	–	–	–

ニッセイ先進国リート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>(オーストラリア)</b>		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
VIVA ENERGY REIT		6	6	18	1,341
CHARTER HALL LONG WALE REIT		2	8	44	3,312
PROPERTYLINK GROUP		7	–	–	–
RURAL FUNDS GROUP		3	3	7	543
CENTURIA METROPOLITAN REIT		–	5	17	1,293
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	440	455	2,196	162,874
<b>(香港)</b>				千香港ドル	
CHAMPION REIT		31	31	156	2,168
LINK REIT		35	36	2,937	40,773
PROSPERITY REIT		18	–	–	–
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		–	31	160	2,228
FORTUNE REIT		21	18	163	2,266
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	105	116	3,417	47,437
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		37	37	108	8,697
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		40	47	95	7,602
CAPITALAND MALL TRUST		41	46	117	9,364
KEPPEL REIT		27	27	33	2,667
SUNTEC REIT		34	45	83	6,629
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		31	44	73	5,828
STARHILL GLOBAL REIT		2	–	–	–
ASCOTT RESIDENCE TRUST		19	15	20	1,666
FRASERS COMMERCIAL TRUST		0.100	8	13	1,066
FRASERS CENTREPOINT TRUST		–	5	15	1,228
ESR REIT		17	17	9	727
CDL HOSPITALITY TRUSTS		11	10	16	1,281
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		8	8	12	1,032
AIMS APAC REIT		8	–	–	–
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		8	8	8	716
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		29	29	7	570
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		1	0.300	0.975	77
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		11	17	42	3,425
CACHE LOGISTICS TRUST		16	5	3	283
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		29	25	58	4,646
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		11	10	11	877

ニッセイ先進国リート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>(シンガポール)</b>		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		13	8	5	459
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		12	—	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		35	35	40	3,211
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		9	—	—	—
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		—	57	31	2,483
SPH REIT		9	—	—	—
OUE HOSPITALITY TRUST		17	—	—	—
KEPPEL DC REIT		1	26	52	4,155
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		5	25	32	2,562
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		—	14	12	990
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	494	575	905	72,255
		28	25	—	<2.9%>
<b>(ニュージーランド)</b>				千ニュージーランド・ドル	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		22	14	22	1,546
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		15	8	14	978
GOODMAN PROPERTY TRUST		15	10	22	1,598
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		5	1	4	324
ARGOSY PROPERTY LTD		12	7	10	738
STRIDE PROPERTY GROUP		5	—	—	—
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	76	42	74	5,186
		6	5	—	<0.2%>
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		16	17	99	14,027
HAMMERSON PLC		12	12	37	5,330
LAND SECURITIES GROUP PLC		12	13	120	16,970
SEGRO PLC		16	20	174	24,529
WORKSPACE GROUP PLC		1	2	32	4,506
INTU PROPERTIES PLC		22	19	7	1,049
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		9	9	13	1,856
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		4	5	46	6,565
SHAFTESBURY PLC		3	3	32	4,565
BIG YELLOW GROUP PLC		2	2	26	3,710
DERWENT LONDON PLC		1	1	71	10,062
INVISTA FOUNDATION PROPERTY		8	6	3	544
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		10	14	35	4,986
HANSTEEN HOLDINGS PLC		12	8	8	1,165
RDI REIT PLC		19	3	5	749

ニッセイ先進国リート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>(イギリス)</b>		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円
TRITAX BIG BOX REIT PLC		21	26	41	5,781
SAFESTORE HOLDINGS PLC		3	3	24	3,373
ASSURA PLC		37	37	26	3,780
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		8	2	2	395
REGIONAL REIT LTD		4	—	—	—
CAPITAL & REGIONAL PLC		8	8	2	298
NEWRIVER REIT PLC		4	4	9	1,289
UNITE GROUP PLC		4	4	58	8,161
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		3	6	5	791
LXI REIT PLC		2	2	2	380
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		3	3	2	386
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		—	10	8	1,257
PICTON PROPERTY INCOME LTD		—	2	2	363
AEW UK REIT PLC		—	3	3	448
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	255 26	259 28	907 —	127,328 <5.2%>
<b>(イスラエル)</b>				千イスラエル・シケル	
REIT 1 LTD		—	1	34	1,082
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	— —	1 1	34 —	1,082 <0.0%>
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>				千ユーロ	
HIBERNIA REIT PLC-W/I		—	6	9	1,132
GREEN REIT PLC		10	—	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		5	0.257	0.459	55
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	16 2	7 2	9 —	1,187 <0.0%>
<b>(ユーロ/オランダ)</b>					
WERELDHAVE NV		0.626	0.626	13	1,632
EUROCOMMERCIAL-CVA		0.759	0.759	20	2,463
VASTNED RETAIL NV		0.245	0.245	7	857
NSI NV		0.282	0.124	5	604
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1 4	1 4	46 —	5,558 <0.2%>
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>					
COFINIMMO		—	0.327	43	5,256
RETAIL ESTATES		0.098	—	—	—
BEFIMMO S.C.A.		—	0.137	8	975
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES		0.245	—	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA		0.251	0.251	42	5,061

## ニッセイ先進国リート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>(ユーロ/ベルギー)</b>		千□	千□	千ユーロ	千円
AEDIFICA		0.279	0.355	41	4,954
MONTEA		–	0.135	11	1,353
INTERVEST OFFICES&WAREHO-RTS		0.245	–	–	–
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1 5	1 5	146 –	17,601 <0.7%>
<b>(ユーロ/フランス)</b>					
KLEPIERRE		3	3	121	14,654
GECINA SA		0.784	0.968	150	18,134
COVIVIO		0.826	0.651	66	8,036
MERCIALYS		0.857	0.500	6	745
ICADE		0.700	0.596	53	6,396
ALTAREA		0.057	–	–	–
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		2	2	342	41,199
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	8 7	8 6	741 –	89,166 <3.6%>
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1	1	32	3,906
HAMBORNER REIT AG		1	–	–	–
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3 2	1 1	32 –	3,906 <0.2%>
<b>(ユーロ/スペイン)</b>					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		1	1	9	1,153
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		5	5	78	9,400
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		6	4	54	6,507
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	13 3	11 3	141 –	17,061 <0.7%>
<b>(ユーロ/イタリア)</b>					
BENI STABILI SPA		15	–	–	–
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		1	1	6	822
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	16 2	1 1	6 –	822 <0.0%>
ユーロ計	□数・金額 銘柄数<比率>	61 25	33 22	1,124 –	135,304 <5.5%>
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,824 295	1,911 284	– –	2,413,971 <97.7%>

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

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

(注3) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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。

## 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	%
投資信託証券	2,413,971	95.5
コール・ローン等、その他	113,831	4.5
投資信託財産総額	2,527,803	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ユーロ120.32円です。

(注2) 外貨建純資産(2,428,992千円)の投資信託財産総額(2,527,803千円)に対する比率は96.1%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
<b>(A)資産</b>	<b>2,527,803,057円</b>
コール・ローン等	109,238,996
投資信託証券(評価額)	2,413,971,912
未収入金	104,316
未収配当金	4,487,833
<b>(B)負債</b>	<b>56,919,556</b>
未払解約金	56,919,231
その他未払費用	325
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,470,883,501</b>
元本	2,138,126,735
次期繰越損益金	332,756,766
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>2,138,126,735口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	11,556円

(注1) 期首元本額 1,958,293,015円  
期中追加設定元本額 322,424,011円  
期中一部解約元本額 142,590,291円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。  
ニッセイ先進国リートインデックスファンド  
(適格機関投資家限定) 1,859,238,576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) 64,798,652円  
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)  
5,538,910円  
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)  
1,584,230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) 25,749,136円  
DCニッセイ先進国リートインデックス 181,217,231円

## 損益の状況

当期(2018年11月21日~2019年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>85,194,427円</b>
受取配当金	84,772,482
受取利息	278,115
その他収益	167,077
支払利息	△ 23,247
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>174,378,381</b>
売益	332,384,426
売損	△ 158,006,045
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 1,576,335</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>257,996,473</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>59,621,713</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>31,006,755</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>△ 15,868,175</b>
<b>(H)合計(D+E+F+G)</b>	<b>332,756,766</b>
次期繰越損益金(H)	332,756,766

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

#### ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xの商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

M S C I 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。

#### ・ M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

M S C I エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。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。

#### ・ 東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証 R E I T 指数の商標または標章に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証 R E I T 指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証 R E I T 指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値および東証 R E I T 指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証 R E I T 指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証 R E I T 指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。㈱東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。㈱東京証券取引所は、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、東証 R E I T 指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・ S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）  
S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>および S & P<sup>®</sup>は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。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。