

第6期末 (2019年11月20日)

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

# <購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド

追加型投信／海外／株式／インデックス型

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2018年11月21日～2019年11月20日

第6期(決算日 2019年11月20日)

### 受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

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

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

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



**ニッセイアセットマネジメント株式会社**

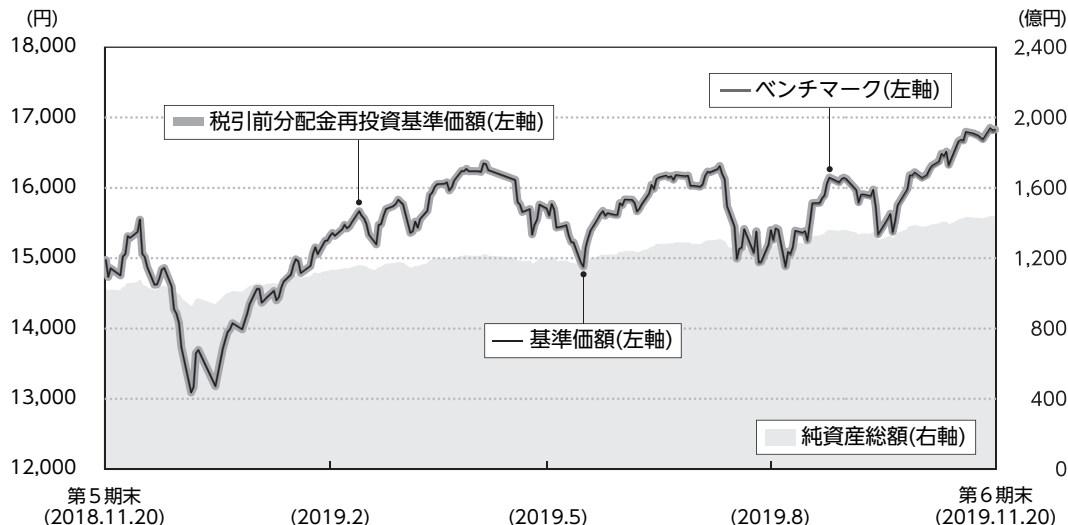
NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

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

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

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

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ■基準価額の主な変動要因

### <上昇要因>

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

### <下落要因>

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	18円	0.113%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は15,508円です。
(投信会社)	( 7)	(0.044)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	( 7)	(0.048)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.003	
(株式)	( 0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	( 0)	(0.002)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	2	0.012	
(株式)	( 2)	(0.012)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	7	0.045	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 6)	(0.040)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.001)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	( 1)	(0.004)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	27	0.174	

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

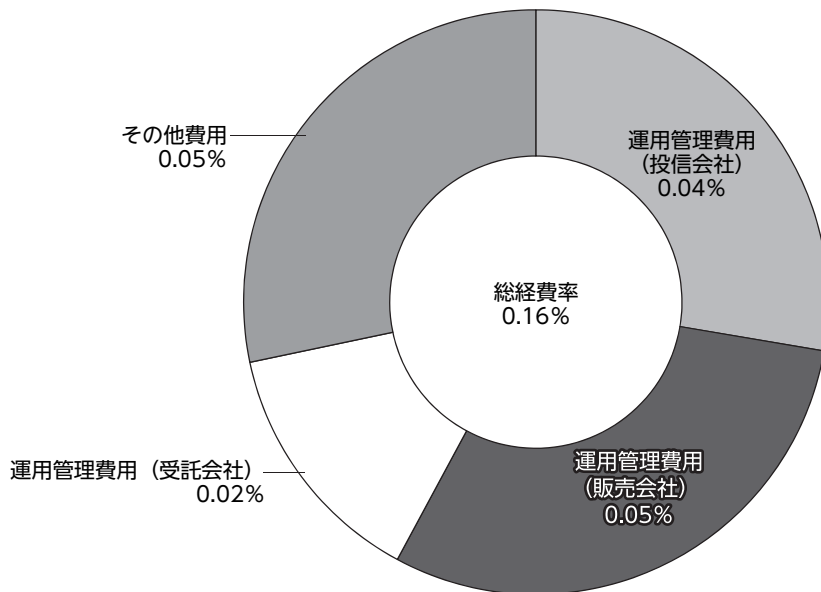
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

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



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

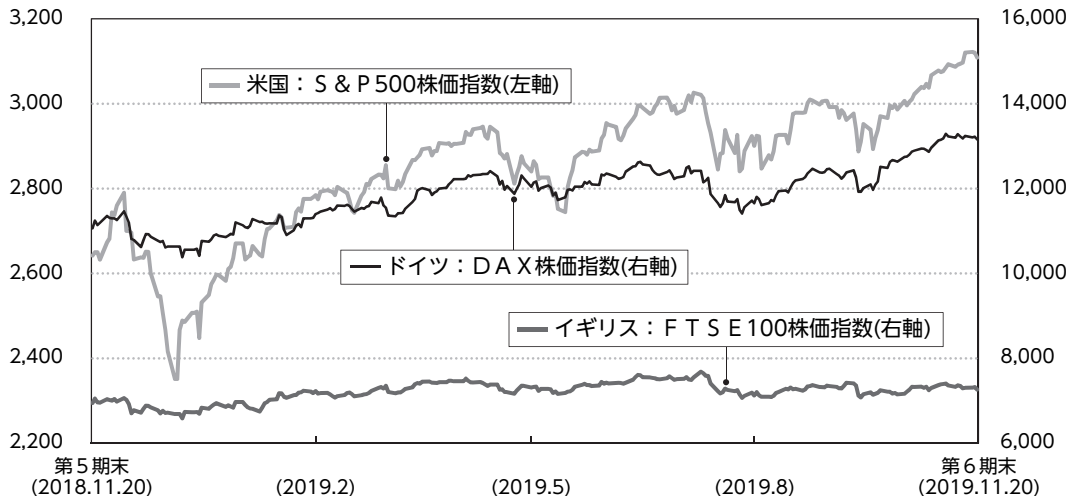
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は上昇しました。

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

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

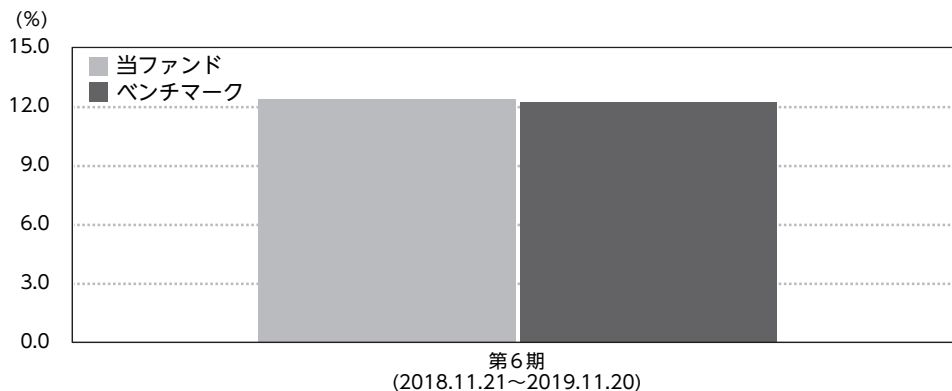
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

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

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

## ベンチマークとの差異



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

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金

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

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

### 【分配原資の内訳（1万口当たり）】

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

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

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

## 今後の運用方針

### ■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ■マザーファンド

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

# ファンドデータ

## 当ファンドの組入資産の内容

### ■組入ファンド

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

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

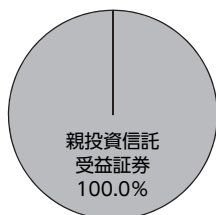
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

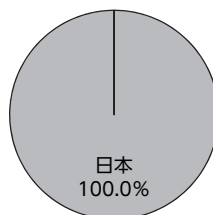
項目	第6期末 2019年11月20日
純資産総額	143,238,909,972円
受益権総口数	85,111,936,866口
1万口当たり基準価額	16,829円

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

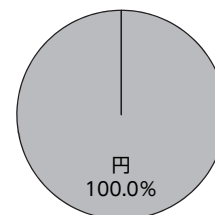
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

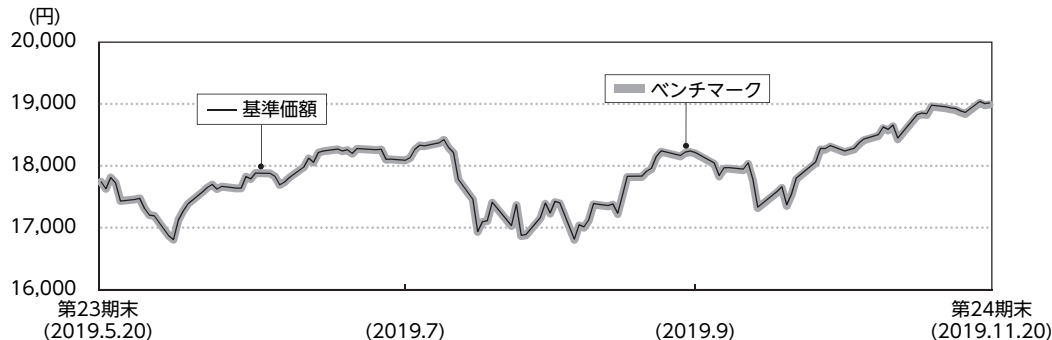


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2019年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

### ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 上位銘柄

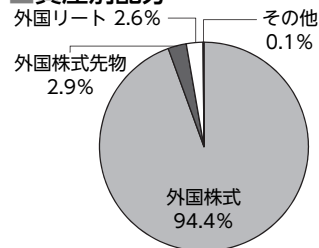
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	3.0%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.7%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.8%
FACEBOOK INC-A	米ドル	1.2%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.0%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9%
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8%
VISA INC-CLASS A SHARES	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,318

### ■ 1万口当たりの費用明細

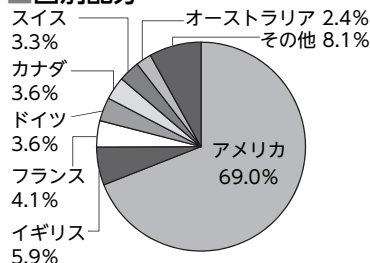
2019.5.21~2019.11.20

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

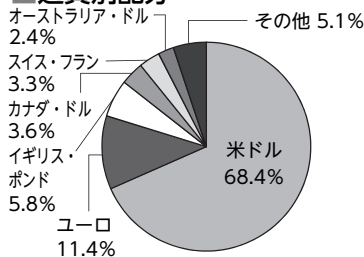
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2019年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (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						
	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
2期(2015年11月20日)	12,964	0	3.5	12,964	13,046	3.6	93.7	3.6	2.4	19,029
3期(2016年11月21日)	11,931	0	△ 8.0	11,931	12,033	△ 7.8	94.1	3.5	2.4	35,666
4期(2017年11月20日)	14,711	0	23.3	14,711	14,834	23.3	94.3	2.1	2.4	68,498
5期(2018年11月20日)	14,973	0	1.8	14,973	15,091	1.7	94.2	3.3	2.4	101,893
6期(2019年11月20日)	16,829	0	12.4	16,829	16,939	12.3	94.4	2.9	2.6	143,238

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ 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	14,973	-	15,091	-	94.2	3.3	2.4
11月末	15,290	2.1	15,410	2.1	95.3	1.9	2.4
12月末	13,695	△ 8.5	13,802	△ 8.5	94.8	2.5	2.5
2019年1月末	14,580	△ 2.6	14,697	△ 2.6	95.5	1.9	2.5
2月末	15,452	3.2	15,574	3.2	94.9	2.4	2.5
3月末	15,558	3.9	15,678	3.9	94.6	2.6	2.6
4月末	16,253	8.5	16,377	8.5	94.3	3.3	2.4
5月末	15,224	1.7	15,335	1.6	94.9	2.3	2.6
6月末	15,770	5.3	15,884	5.3	94.8	2.3	2.6
7月末	16,197	8.2	16,314	8.1	94.0	3.3	2.5
8月末	15,392	2.8	15,498	2.7	95.0	2.2	2.8
9月末	15,886	6.1	15,993	6.0	94.0	3.2	2.7
10月末	16,515	10.3	16,626	10.2	94.7	2.6	2.7
(期末)2019年11月20日	16,829	12.4	16,939	12.3	94.4	2.9	2.6

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

**親投資信託受益証券の設定、解約状況**

2018年11月21日～2019年11月20日

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

(注) 単位未満は切り捨てています。

**株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合**

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

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

**利害関係人との取引状況等**

2018年11月21日～2019年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

**親投資信託残高**

2019年11月20日現在

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

(注1) 単位未満は切り捨てています。

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

## 投資信託財産の構成

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	143,239,338	99.5
コール・ローン等、その他	686,628	0.5
投資信託財産総額	143,925,966	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1ユーロ120.32円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（207,877,451千円）の投資信託財産総額（212,007,217千円）に対する比率は98.1%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

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

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

## 損益の状況

当期(2018年11月21日~2019年11月20日)

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

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

## 分配金の計算過程

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

# お知らせ

## ■約款変更

- ・信用リスク分散規制にかかる投資制限条項の追加および変更に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。  
(2019年2月21日)
- ・信託報酬率の上限引き下げに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。  
(2019年6月27日)

## ■関連会社の実質保有比率

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

## 当ファンドの概要

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

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 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

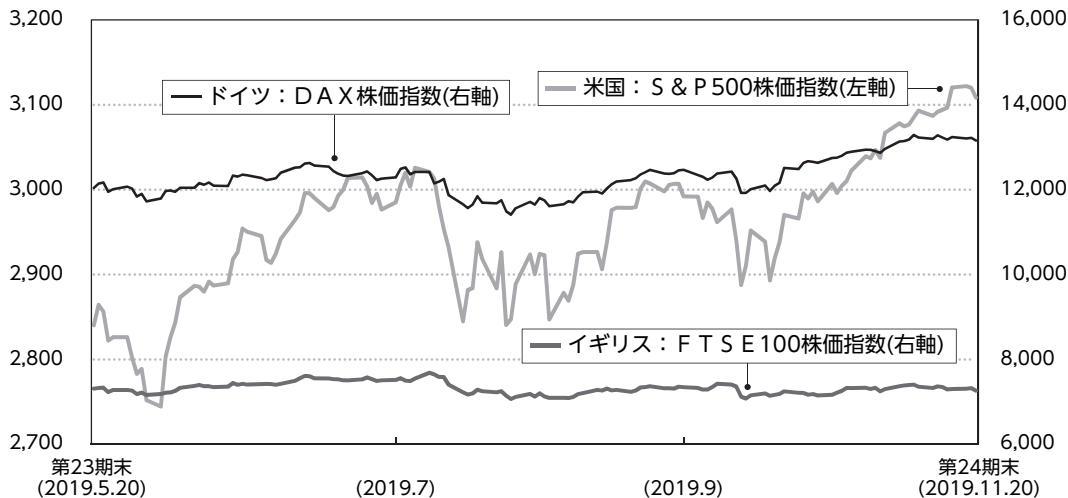


# 運用経過

2019年5月21日～2019年11月20日

## 海外株式市況

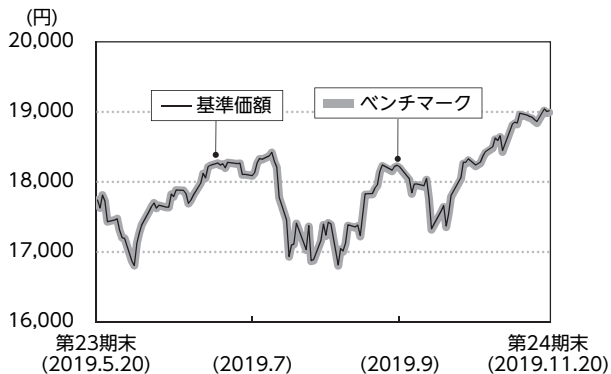
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーク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)	
	(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 (3)	0.021 (0.019)	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)	(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	—	—

外国



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

### (3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	33,343	31,677	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2019年5月21日～2019年11月20日

### 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP	45	665,041	14,471	RED HAT INC	7	160,013	20,641
APPLE INC	26	570,630	21,912	WALT DISNEY CO	5	85,704	14,521
AMAZON.COM INC	2	544,378	195,187	APPLE INC	2	58,054	22,132
FACEBOOK INC-A	15	304,894	19,873	AMCOR PLC-CDI	52	57,165	1,091
ALPHABET INC-CL C	1	244,092	123,904	ORACLE CORP	8	46,717	5,673
ALPHABET INC-CL A	1	237,555	124,114	NEWMONT GOLDCORP CORP	11	39,924	3,459
JOHNSON & JOHNSON	15	228,777	14,453	INNOGY SE	6	34,820	5,244
NESTLE SA	19	222,407	11,370	ELI LILLY & CO	2	29,193	12,627
PROCTER & GAMBLE CO	16	207,174	12,398	PFIZER INC	5	26,543	4,587
JPMORGAN CHASE & CO	17	206,136	11,865	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	4	23,551	4,938

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

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

## 組入有価証券明細表

2019年11月20日現在

## (1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
3M CO	239	274	4,682	508,559	資本財
ABBOTT LABORATORIES	724	840	7,085	769,538	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	620	704	6,271	681,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	17	21	395	42,925	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	262	303	6,016	653,403	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	298	364	1,943	211,117	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	16	18	240	26,135	資本財
ADOBE INC	201	232	6,982	758,416	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	30	34	552	59,973	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	391	489	2,021	219,592	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	51	59	351	38,224	資本財
AES CORP	273	316	584	63,499	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	20	23	197	21,417	各種金融
AFLAC INC	313	355	1,920	208,549	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	130	149	1,187	128,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	90	105	2,534	275,322	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	66	77	688	74,770	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	43	50	334	36,300	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	91	106	1,178	128,000	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	31	36	980	106,459	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	64	74	149	16,183	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	6	6	540	58,751	保険
ALLEGION PLC	39	44	533	57,991	資本財
ALLERGAN PLC	139	156	2,893	314,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	20	20	216	23,469	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	96	112	590	64,114	公益事業
ALLSTATE CORP	141	158	1,756	190,821	保険
ALLY FINANCIAL INC	168	188	580	63,077	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	37	52	517	56,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	123	142	18,687	2,029,632	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	129	149	19,666	2,135,938	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	136	71	192	20,934	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	775	891	4,183	454,327	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	171	199	34,934	3,794,274	小売
AMCOR PLC	-	780	791	85,924	素材
AMERCO	4	4	175	19,015	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	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
FREEMORT-MCMORAN INC	565	687	775	84,277	素材
GAP INC	93	106	179	19,485	小売
GARMIN LTD	46	63	613	66,579	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	37	43	692	75,223	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	103	116	2,161	234,721	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	3,590	4,157	4,781	519,274	資本財
GENERAL MILLS INC	246	285	1,511	164,190	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	524	608	2,213	240,460	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	60	69	727	79,024	小売
GILEAD SCIENCES INC	533	605	3,934	427,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	65	139	2,543	276,273	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	41	48	482	52,386	保険
GODADDY INC - CLASS A	69	84	574	62,420	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	137	156	3,445	374,203	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	95	-	-	-	自動車・自動車部品
GRUBHUB INC	37	43	173	18,874	小売
H&R BLOCK INC	84	96	238	25,921	消費者サービス
HALLIBURTON CO	360	413	823	89,386	エネルギー
HANESBRANDS INC	149	172	258	28,103	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	66	75	279	30,369	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	48	-	-	-	資本財



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
INVESCO LTD	168	188	330	35,887	各種金融
IONIS PHARMACEUTICALS INC	-	63	370	40,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPG PHOTONICS CORP	15	17	241	26,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	66	80	1,145	124,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	31	36	552	59,986	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	52	64	611	66,464	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	93	107	599	65,102	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	93	107	345	37,501	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	26	372	40,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	38	43	507	55,072	運輸
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	119	116	237	25,749	各種金融
JM SMUCKER CO	46	54	564	61,343	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,106	1,264	17,048	1,851,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	381	379	1,629	177,008	資本財
JONES LANG LASALLE INC	18	24	396	43,102	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,370	1,544	20,167	2,190,356	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	141	162	424	46,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	44	50	774	84,084	運輸
KELLOGG CO	107	122	797	86,665	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	425	479	915	99,443	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	77	89	969	105,331	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	143	164	2,184	237,211	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	824	975	1,952	212,014	エネルギー
KKR & CO INC -A	199	233	680	73,874	各種金融
KLA CORPORATION	67	76	1,354	147,084	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	57	66	244	26,542	運輸
KOHL'S CORP	68	77	365	39,649	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	252	320	1,004	109,089	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	327	383	1,029	111,854	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	96	111	191	20,829	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	32	-	-	-	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	-	105	2,144	232,864	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	41	46	803	87,244	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	63	71	1,969	213,869	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	60	69	585	63,599	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	160	164	1,020	110,818	消費者サービス
LEAR CORP	26	28	338	36,792	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	54	63	332	36,135	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	59	65	603	65,580	ソフトウェア・サービス

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
LENNAR CORP-CL A	120	136	812	88,236	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	14	16	427	46,432	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	45	52	619	67,243	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	71	84	191	20,846	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	220	242	529	57,497	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	36	30	145	15,804	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	71	91	430	46,807	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	85	98	443	48,133	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	85	93	539	58,567	保険
LINDE PLC	227	258	5,369	583,230	素材
LIVE NATION INC	61	71	489	53,206	メディア・娯楽
LKQ CORP	130	147	520	56,544	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	105	121	4,744	515,292	資本財
LOEWS CORP	109	129	651	70,779	保険
LOWE'S COS INC	332	378	4,293	466,322	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	40	52	1,142	124,113	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	133	127	1,183	128,533	素材
M&T BANK CORP	55	61	1,006	109,291	銀行
MACY'S INC	126	146	220	23,940	小売
MANPOWER GROUP	24	27	257	27,943	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	340	385	442	48,015	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	284	315	1,952	212,112	エネルギー
MARKEL CORP	5	6	739	80,348	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	-	17	719	78,145	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	119	134	1,827	198,439	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	207	243	2,610	283,477	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	29	780	84,716	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	258	299	790	85,874	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	125	139	636	69,089	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	378	432	12,346	1,340,984	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	143	-	-	-	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	114	129	726	78,873	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	50	58	971	105,463	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	318	363	7,040	764,683	消費者サービス
MCKESSON CORP	80	90	1,360	147,781	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	554	638	7,095	770,652	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	102	100	219	23,803	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	17	21	1,135	123,375	小売
MERCK & CO INC	1,072	1,226	10,382	1,127,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
METLIFE INC	343	382	1,880	204,260	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	10	11	861	93,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	205	242	770	83,653	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	97	113	1,054	114,531	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	466	526	2,451	266,278	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	3,007	3,467	52,142	5,663,177	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	23	26	304	33,069	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	29	405	44,012	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	78	90	472	51,270	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	598	685	3,611	392,225	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	-	20	283	30,794	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	170	193	1,133	123,095	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	71	81	1,820	197,774	各種金融
MORGAN STANLEY	530	598	2,953	320,831	各種金融
MOSAIC CO/THE	150	174	327	35,561	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67	78	1,307	141,962	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	36	40	1,038	112,791	各種金融
MYLAN NV	211	244	422	45,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	47	55	581	63,117	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	157	183	386	42,017	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	71	83	153	16,676	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	103	117	738	80,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	179	208	6,304	684,783	メディア・娯楽
NEWELL BRANDS INC	193	192	376	40,933	耐久消費財・アパレル
NEWMONT GOLDCORP CORP	218	389	1,493	162,163	素材
NEWS CORP - CLASS A	164	184	238	25,855	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	196	228	5,309	576,617	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	147	171	349	37,920	商業・専門サービス
NIKE INC	524	598	5,598	608,026	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	154	178	465	50,585	公益事業
NOBLE ENERGY INC	197	227	444	48,261	エネルギー
NORDSTROM INC	48	51	183	19,922	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	114	128	2,479	269,302	運輸
NORTHERN TRUST CORP	86	98	1,051	114,173	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	68	76	2,720	295,434	資本財
NORTONLIFELOCK INC	263	294	726	78,937	ソフトウェア・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	90	101	545	59,253	消費者サービス
NRG ENERGY INC	119	126	498	54,165	公益事業
NUCOR CORP	129	143	788	85,611	素材

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
NVIDIA CORP	238	275	5,729	622,281	半導体・半導体製造装置
NVR INC	1	1	596	64,746	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	142	136	1,550	168,428	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	311	426	1,625	176,598	エネルギー
OGE ENERGY CORP	82	94	404	43,899	公益事業
OKTA INC	-	49	626	68,043	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	26	32	623	67,716	運輸
OMNICOM GROUP	94	106	839	91,168	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	173	196	414	44,973	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	170	197	1,376	149,479	エネルギー
ORACLE CORP	1,093	1,139	6,411	696,348	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	33	37	1,659	180,198	小売
OWENS CORNING	44	51	342	37,244	資本財
PACCAR INC	144	165	1,310	142,369	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	38	44	508	55,177	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	39	45	1,140	123,857	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	54	60	1,192	129,508	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	103	133	200	21,828	エネルギー
PAYCHEX INC	133	154	1,321	143,501	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	-	23	570	61,984	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	461	531	5,580	606,121	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	67	76	332	36,089	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	156	187	306	33,253	銀行
PEPSICO INC	582	667	8,984	975,828	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	-	52	478	51,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PERRIGO CO PLC	53	61	300	32,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,384	2,644	9,958	1,081,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	641	741	6,184	671,713	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	180	215	2,534	275,273	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	45	53	460	49,992	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	70	80	1,037	112,680	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	65	76	130	14,161	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	190	215	3,261	354,283	銀行
POLARIS INC	24	27	281	30,566	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	99	112	1,448	157,279	素材
PPL CORPORATION	297	343	1,153	125,328	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	116	132	723	78,591	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,028	1,195	14,511	1,576,134	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	240	277	1,987	215,824	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	169	192	1,794	194,923	保険
PTC INC	46	52	382	41,526	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	208	240	1,455	158,063	公益事業
PULTE GROUP INC	109	125	495	53,865	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	31	35	343	37,329	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	51	56	585	63,598	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	500	579	5,096	553,510	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	56	63	668	72,590	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	172	189	187	20,373	小売
RALPH LAUREN CORP	22	24	273	29,671	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	52	59	530	57,666	各種金融
RAYTHEON CO	117	133	2,905	315,554	資本財
RED HAT INC	73	-	-	-	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	32	38	1,321	143,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	422	478	790	85,882	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	25	29	482	52,371	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	16	21	396	43,112	保険
REPUBLIC SERVICES INC	94	108	948	102,998	商業・専門サービス
RESMED INC	58	68	1,023	111,110	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	49	54	321	34,944	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	49	56	1,104	119,959	資本財
ROKU INC	-	39	602	65,427	メディア・娯楽
ROLLINS INC	59	69	254	27,634	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	42	49	1,731	188,107	資本財
ROSS STORES INC	153	174	1,962	213,161	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	68	84	1,003	108,968	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	103	117	3,142	341,294	各種金融
SABRE CORP	114	131	296	32,221	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	315	396	6,492	705,184	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	-	35	348	37,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER LTD	571	659	2,261	245,618	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	112	118	707	76,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	65	74	284	30,865	素材
SEATTLE GENETICS INC	46	53	635	68,969	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	52	59	372	40,507	各種金融
SEMPRA ENERGY	112	130	1,926	209,225	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	67	76	400	43,527	資本財
SERVICENOW INC	74	88	2,447	265,786	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34	39	2,316	251,642	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
SIGNATURE BANK	22	26	329	35,773	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	705	783	546	59,330	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	73	82	793	86,135	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	58	66	320	34,768	資本財
SNAP INC - A	-	331	501	54,503	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	23	26	421	45,772	資本財
SOUTHERN CO	426	497	3,092	335,899	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	58	63	368	39,984	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	43	48	443	48,220	資本財
SPLUNK INC	60	71	892	96,968	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	351	400	230	24,984	電気通信サービス
SQUARE INC - A	127	160	1,063	115,551	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	93	109	650	70,672	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	62	71	1,125	122,208	資本財
STARBUCKS CORP	512	577	4,828	524,398	消費者サービス
STATE STREET CORP	155	176	1,296	140,789	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	94	105	330	35,890	素材
STERIS PLC	-	40	612	66,564	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	138	160	3,319	360,554	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	184	211	1,492	162,136	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	21	24	561	60,993	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	266	295	1,090	118,475	各種金融
SYNOPSIS INC	60	70	1,005	109,200	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	203	232	1,868	202,991	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	97	110	1,351	146,765	各種金融
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	29	-	-	-	ソフトウェア・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	47	53	664	72,184	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	119	138	373	40,513	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	96	114	423	46,048	エネルギー
TARGET CORP	204	244	2,706	293,954	小売
TE CONNECTIVITY LTD	140	159	1,480	160,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	176	204	393	42,767	エネルギー
TELEFLEX INC	18	22	780	84,775	ヘルスケア機器・サービス
TESLA, INC.	53	62	2,248	244,163	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	399	520	535	58,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	396	446	5,264	571,790	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	99	109	509	55,322	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	165	190	5,835	633,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	44	51	637	69,199	小売

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
TJX COS INC	509	576	3,496	379,774	小売
T-MOBILE US INC	141	164	1,267	137,655	電気通信サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	67	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	50	57	552	60,006	小売
TRANSDIGM GROUP INC	19	22	1,299	141,125	資本財
TRANSUNION	76	89	769	83,611	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	108	124	1,685	183,065	保険
TRIMBLE INC	102	119	468	50,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	43	50	143	15,575	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	—	53	547	59,502	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	283	347	1,024	111,230	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	121	140	1,270	138,013	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	—	92	250	27,193	運輸
UGI CORP	72	99	437	47,470	公益事業
ULTA BEAUTY INC	23	26	633	68,752	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	78	89	154	16,789	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	78	93	146	15,868	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	305	339	6,009	652,741	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	28	30	288	31,359	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	287	333	4,020	436,613	運輸
UNITED RENTALS INC	33	37	565	61,372	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	338	390	5,789	628,754	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	396	452	12,408	1,347,731	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	35	39	556	60,475	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	87	96	282	30,715	保険
US BANCORP	632	719	4,276	464,440	銀行
VAIL RESORTS INC	16	19	461	50,119	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	174	198	1,938	210,502	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	37	42	552	59,961	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	51	60	926	100,597	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	44	50	986	107,096	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	64	74	1,068	116,015	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,707	1,973	11,740	1,275,178	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	105	121	2,622	284,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	139	160	1,387	150,695	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	148	170	401	43,607	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	725	827	15,132	1,643,574	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	135	172	456	49,570	公益事業



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
VMWARE INC-CLASS A	33	39	680	73,953	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	63	67	388	42,212	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	54	62	888	96,534	素材
WABCO HOLDINGS INC	21	24	329	35,781	資本財
WABTEC CORP	56	86	688	74,739	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	332	369	2,267	246,300	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	598	682	8,184	888,921	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	813	857	12,723	1,381,860	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	109	126	1,143	124,203	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	176	203	2,284	248,128	商業・専門サービス
WATERS CORP	31	32	722	78,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	24	29	244	26,544	小売
WEC ENERGY GROUP INC	131	151	1,332	144,706	公益事業
WELLCARE HEALTH PLANS INC	20	23	762	82,810	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	1,843	2,033	10,986	1,193,210	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	119	139	664	72,168	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	185	207	567	61,661	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	15	18	126	13,782	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	104	122	487	52,974	素材
WEYERHAEUSER CO	309	355	1,055	114,628	不動産
WHIRLPOOL CORP	26	30	424	46,119	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	503	582	1,289	140,009	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	53	61	1,171	127,230	保険
WIX.COM LTD	18	22	289	31,463	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	61	77	1,290	140,149	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC	124	-	-	-	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	60	70	487	52,952	保険
WW GRAINGER INC	19	22	707	76,888	資本財
WYNN RESORTS LTD	40	45	552	60,025	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	211	245	1,503	163,269	公益事業
XEROX CORP	87	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XEROX HOLDINGS CORP	-	95	370	40,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	104	121	1,123	122,016	半導体・半導体製造装置
XPO LOGISTICS INC	53	45	377	40,974	運輸
XYLEM INC	73	85	663	72,067	資本財
YUM! BRANDS INC	128	145	1,431	155,430	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	85	114	394	42,824	電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	-	25	606	65,849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>		百株	百株	千円	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	2,850	3,283	2,683	187,339	
	銘柄数<比率>	7	7	-	<0.1%>	
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド		
3I GROUP PLC		395	458	484	67,946	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		85	91	188	26,412	保険
ANGLO AMERICAN PLC		431	495	1,014	142,365	素材
ANTOFAGASTA PLC		158	180	162	22,741	素材
ASHTREAD GROUP PLC		196	221	520	73,101	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		146	168	410	57,535	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		523	625	4,572	641,708	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		388	442	237	33,289	メディア・娯楽
AVIVA PLC		1,610	1,855	776	108,898	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC		101	-	-	-	商業・専門サービス
BAE SYSTEMS PLC		1,321	1,526	883	123,978	資本財
BARCLAYS PLC		7,056	8,197	1,396	196,026	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		420	486	317	44,493	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		50	58	263	36,963	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC		868	1,002	1,708	239,810	素材
BP PLC		8,280	9,699	4,868	683,138	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		945	1,092	3,157	443,116	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		3,514	4,058	771	108,260	電気通信サービス
BUNZL PLC		140	161	331	46,492	資本財
BURBERRY GROUP PLC		168	195	405	56,886	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC		68	76	247	34,684	消費者サービス
CENTRICA PLC		2,373	2,772	203	28,598	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI		83	94	229	32,160	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		655	756	1,530	214,834	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC		579	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		52	60	292	41,081	素材
DCC PLC		40	46	309	43,442	資本財
DIAGEO PLC		1,000	1,132	3,530	495,389	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		570	648	179	25,140	保険
EASYJET PLC		69	77	103	14,565	運輸
EVRAZ PLC		-	246	89	12,489	素材



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
EXPERIAN PLC	374	433	1,074	150,751	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	95	110	742	104,191	資本財
FRESNILLO PLC	91	106	66	9,331	素材
G4S PLC	641	748	155	21,835	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,050	2,379	4,083	573,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	4,632	5,221	1,257	176,524	素材
GVC HOLDINGS PLC	228	277	237	33,330	消費者サービス
HALMA PLC	-	180	371	52,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	115	134	244	34,299	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	8,272	9,653	5,606	786,696	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	394	456	810	113,745	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	524	604	476	66,799	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	70	82	395	55,550	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	66	76	423	59,435	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	280	321	140	19,710	各種金融
ITV PLC	1,533	1,752	239	33,573	メディア・娯楽
JOHNSON MATTHEY PLC	79	90	290	40,801	素材
KINGFISHER PLC	869	987	206	28,924	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,457	2,839	792	111,258	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	29,375	33,828	2,009	281,983	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	129	150	1,037	145,641	各種金融
M&G PLC	-	1,213	283	39,753	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	673	923	171	24,097	小売
MEGGITT PLC	319	368	235	33,009	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,008	2,332	522	73,322	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	292	-	-	-	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	145	164	170	23,987	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	149	227	380	53,429	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	924	1,123	224	31,520	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	1,401	1,626	1,461	205,111	公益事業
NEXT PLC	57	64	427	60,007	小売
NMC HEALTH PLC	43	44	116	16,358	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	-	217	253	35,575	小売
PEARSON PLC	323	372	248	34,863	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	130	151	373	52,475	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,064	1,213	1,600	224,570	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	277	337	1,999	280,554	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	813	931	1,743	244,637	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	-	889	396	55,593	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イリス・ポンド	千円		
RIO TINTO PLC	474	539	2,271	318,793	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	699	821	598	84,051	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	48,600	—	—	—	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT	—	37,783	3	530	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	1,976	2,295	511	71,750	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,861	2,068	4,729	663,662	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,542	1,787	4,053	568,862	エネルギー	
ROYAL MAIL PLC	381	—	—	—	運輸	
RSA INSURANCE GROUP PLC	425	489	265	37,190	保険	
SAGE GROUP PLC	446	517	383	53,862	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	726	834	177	24,869	食品・生活必需品小売り	
SCHRODERS PLC	50	58	190	26,719	各種金融	
SEVERN TRENT PLC	98	113	267	37,583	公益事業	
SMITH & NEPHEW PLC	361	417	694	97,440	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC	163	188	311	43,761	資本財	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	35	300	42,233	資本財	
SSE PLC	426	494	651	91,398	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC	224	257	273	38,401	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC	1,160	1,331	927	130,121	銀行	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,044	1,157	364	51,102	各種金融	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,361	1,564	271	38,167	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	4,041	4,663	1,096	153,840	食品・生活必需品小売り	
TUI AG-DI	182	210	223	31,431	消費者サービス	
UNILEVER PLC	458	529	2,411	338,419	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	283	326	286	40,156	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	11,106	12,785	1,958	274,866	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE	101	122	173	24,349	資本財	
WHITBREAD PLC	75	62	278	39,052	消費者サービス	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	281	326	114	16,088	エネルギー	
WPP PLC	524	605	592	83,133	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 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 HAPOALIM 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	349	403	1,395	167,852	
	銘柄数<比率>	6	6	-	<0.1%>	
<b>(ユーロ/その他)</b>						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		89	102	685	82,495	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	89	102	685	82,495	
	銘柄数<比率>	1	1	-	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	80,796	92,308	194,158	23,361,149	
	銘柄数<比率>	237	237	-	<11.1%>	
合計	株数・金額	509,058	568,479	-	199,297,460	
	銘柄数<比率>	1,243	1,256	-	<94.4%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	8	9	317	38,234	
GECINA SA	1	2	335	40,352	
COVIVIO	1	2	236	28,442	
ICADE	1	1	133	16,045	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5	6	947	113,997	
小計	口数・金額	19	22	1,970	237,072
	銘柄数<比率>	5	5	-	<0.1%>
合計	口数・金額	2,006	2,313	-	5,434,364
	銘柄数<比率>	62	62	-	<2.6%>

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 S&P 500 EMINI FUTURE	4,470	-
国 FTSE 100	441	-
DJ EURO STOXX 50	1,114	-

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

### 投資信託財産の構成

2019年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	199,297,460	94.0
投資信託証券	5,434,364	2.6
コール・ローン等、その他	7,275,391	3.4
投資信託財産総額	212,007,217	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル108.61円、1カナダ・ドル81.82円、1オーストラリア・ドル74.14円、1香港ドル13.88円、1シンガポール・ドル79.80円、1ニュージーランド・ドル69.81円、1イギリス・ポンド140.33円、1イスラエル・シェケル31.35円、1スイス・フラン109.61円、1デンマーク・クローネ16.10円、1ノルウェー・クローネ11.89円、1スウェーデン・クローナ11.26円、1ユーロ120.32円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年11月20日現在)

項目	当期末
<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ートファンド2055	59,931,201円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	72,703,499円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	39,305,684円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	79,667,845円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	22,747,558円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (6資産均等型)	40,031,114円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	24,696,756円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)	3,481,454円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	995,057円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (8資産均等型)	16,196,854円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	4,212,091円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	3,974,678円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	6,685,873円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	7,284,270円

### 損益の状況

当期 (2019年5月21日~2019年11月20日)

項目	当期
<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 利 息	4,764,663
そ の 他 収 益	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 益	18,903,752,207
売 買 損	△ 6,640,416,488
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>193,374,215</b>
取 引 益	596,390,171
取 引 損	△ 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。

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。