

第7期末 (2020年11月20日)

基準価額	18,326円
純資産総額	2,097億円
騰落率	8.9%
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:2019年11月21日～2020年11月20日

第7期(決算日 2020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7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

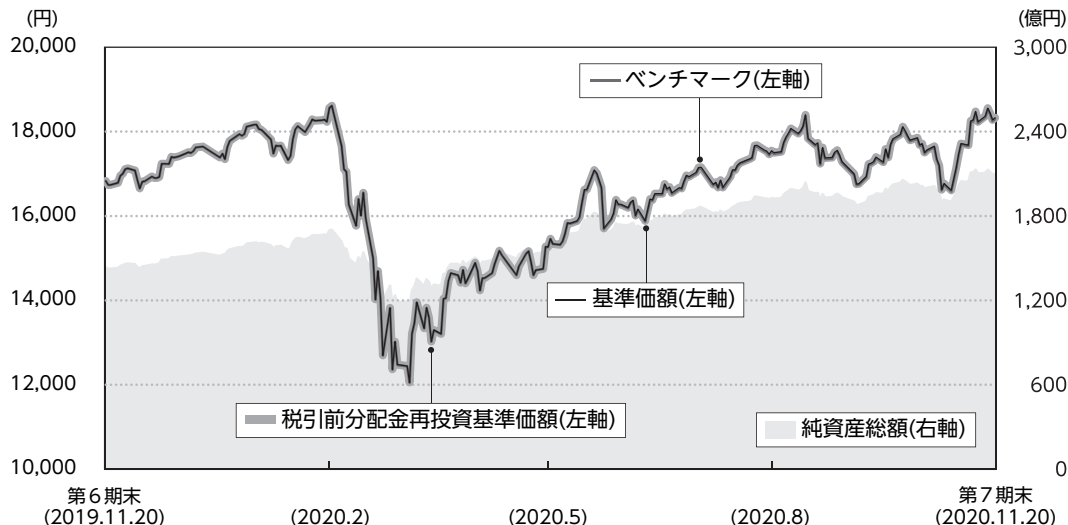
NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2019年11月21日～2020年11月20日

## 基準価額等の推移



第7期首	16,829円	既払分配金	0円
第7期末	18,326円	騰落率(分配金再投資ベース)	8.9%

(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>

- ・新型コロナウイルスのワクチン開発に対する期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標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>

- ・米国によるイラン空爆を受けて中東の地政学リスクが高まったことや、新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした世界景気への懸念など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7期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.104%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は16,623円です。
(投信会社)	( 6)	(0.038)	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)	(0.044)	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)	( 4)	(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	1	0.003	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
(株式)	( 0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.002)	
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	2	0.011	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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
(株式)	( 2)	(0.011)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
その他費用	6	0.038	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 5)	(0.028)	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)	(0.008)	・ 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	26	0.156	

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

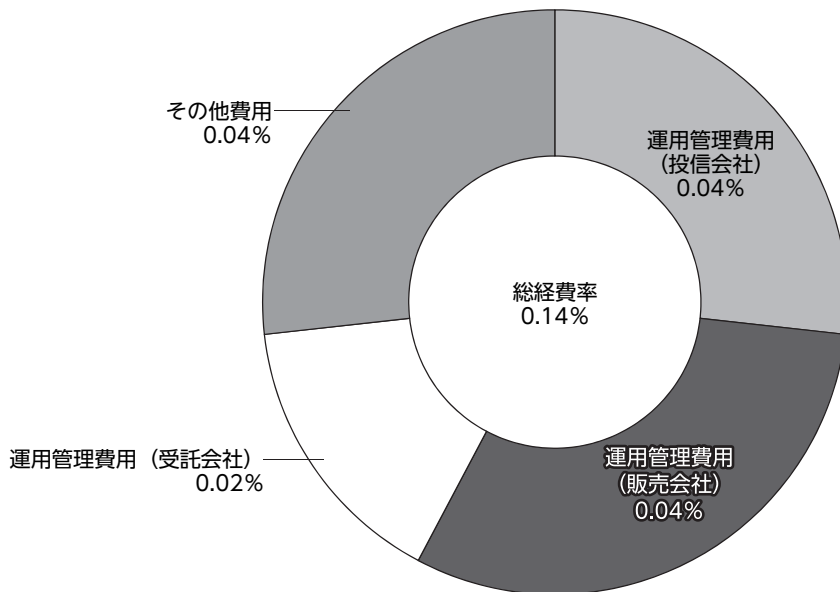
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(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0.14%**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。

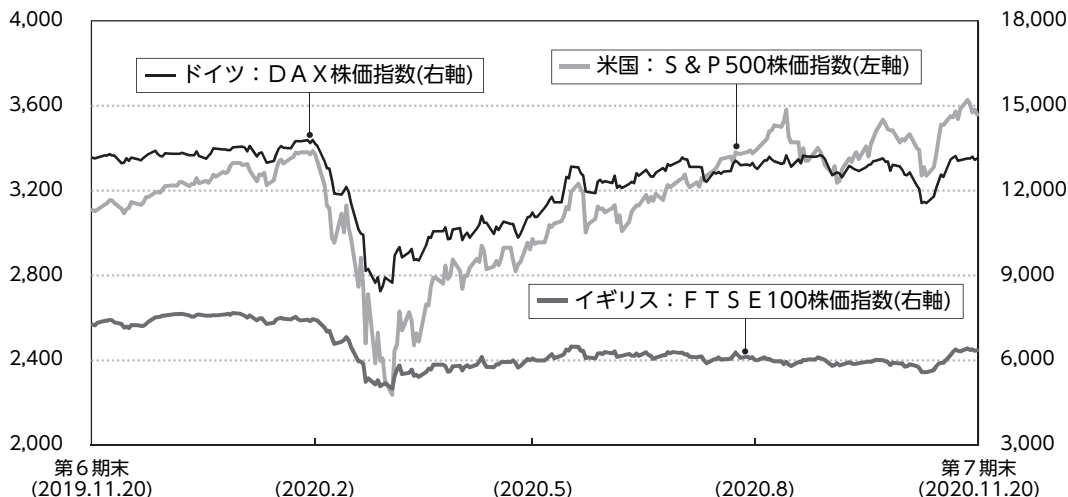
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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グのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期初以降、堅調な経済指標や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に、2019年12月にかけて上昇基調で推移しました。2020年1月下旬に入ると、米国によるイラン空爆を受けて中東の地政学リスクが高まったことや新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした世界景気への懸念などから下落し、その後も中国外での新規感染者数増加や企業業績への影響懸念からセンチメント（市場心理）が悪化して、3月下旬にかけて大幅に下落しました。4月以降は同ウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標を背景に海外株式市場は上昇する展開となりました。結局、前期末と比較すると米国は上昇しましたが、欧州については新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、イギリスと欧州連合（EU）の離脱協定を巡る対立の問題もあり、ドイツは横ばい、イギリスは下落して当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

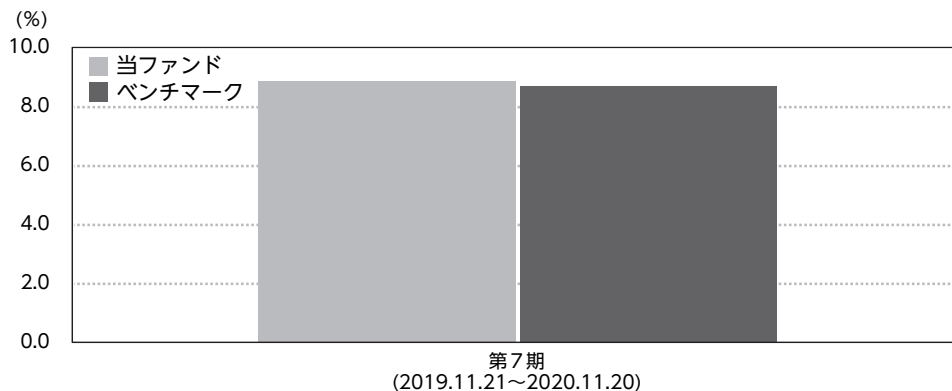
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■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+8.9%となり、ベンチマーク騰落率（+8.7%）におおむね連動しました。

(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 2019年11月21日～2020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	8,326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7期末 2020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。

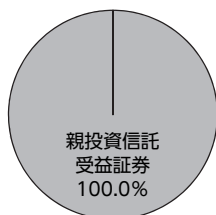
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

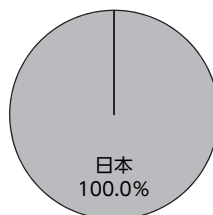
項目	第7期末 2020年11月20日
純資産総額	209,723,222,121円
受益権総口数	114,439,129,689口
1万口当たり基準価額	18,326円

(注) 当期間中における追加設定元本額は55,388,528,172円、同解約元本額は26,061,335,349円です。

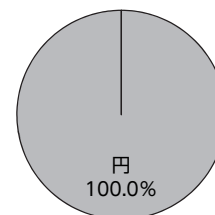
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

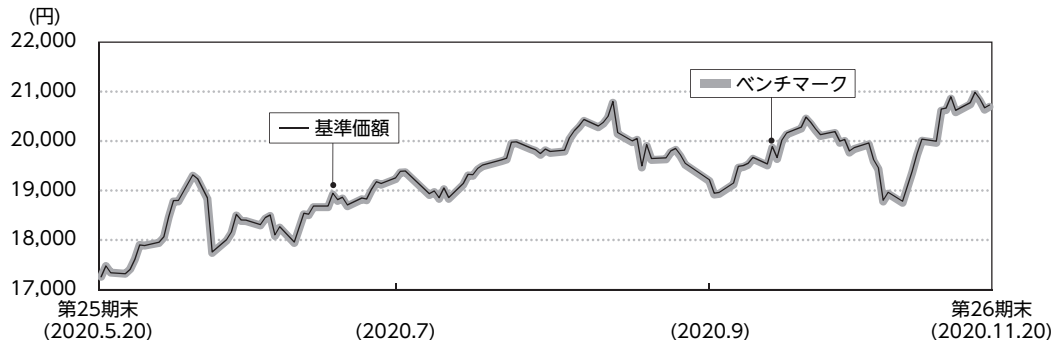


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2020年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



## 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

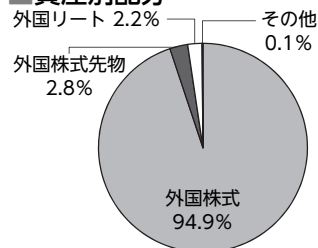
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	3.3%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.9%
FACEBOOK INC-A	米ドル	1.4%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.2%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.1%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.8%
TESLA, INC.	米ドル	0.8%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	0.8%
VISA INC-CLASS A SHARES	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,275

### ■ 1万口当たりの費用明細

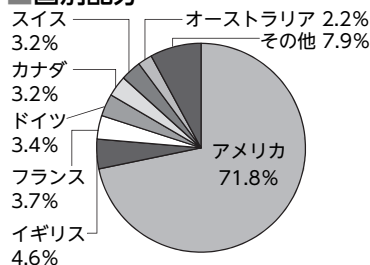
2020.5.21~2020.11.20

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

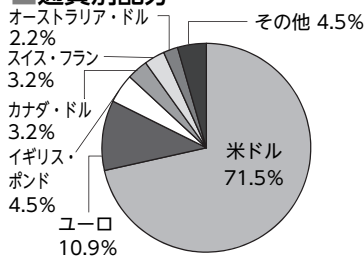
### ■ 資産別配分



### ■ 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(2020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。

<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

**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
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
7期(2020年11月20日)	18,326	0	8.9	18,326	18,418	8.7	94.9	2.8	2.2	209,723

(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) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注6) 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)2019年11月20日	16,829	-	16,939	-	94.4	2.9	2.6
11月末	17,130	1.8	17,240	1.8	95.2	1.9	2.7
12月末	17,646	4.9	17,759	4.8	93.5	3.6	2.5
2020年1月末	17,666	5.0	17,778	5.0	95.2	1.9	2.6
2月末	16,274	△ 3.3	16,380	△ 3.3	92.9	4.1	2.7
3月末	13,826	△ 17.8	13,908	△ 17.9	94.3	3.1	2.5
4月末	15,176	△ 9.8	15,270	△ 9.9	94.8	2.6	2.5
5月末	15,824	△ 6.0	15,921	△ 6.0	95.3	3.4	2.4
6月末	16,142	△ 4.1	16,224	△ 4.2	94.8	2.7	2.4
7月末	16,677	△ 0.9	16,763	△ 1.0	95.1	2.3	2.4
8月末	17,956	6.7	18,049	6.5	94.2	3.3	2.2
9月末	17,248	2.5	17,337	2.3	95.0	2.6	2.2
10月末	16,769	△ 0.4	16,856	△ 0.5	95.3	2.2	2.2
(期末)2020年11月20日	18,326	8.9	18,418	8.7	94.9	2.8	2.2

(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**

2019年11月21日～2020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	48,995,123	89,861,540	23,146,709	43,527,886

(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	69,235,887千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	228,143,016千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.30

(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**

2019年11月21日～2020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**

2020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	75,325,693	101,174,107	209,723,806

(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145,169,780千口です。

## 投資信託財産の構成

2020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	209,723,806	99.4
コール・ローン等、その他	1,347,033	0.6
投資信託財産総額	211,070,840	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103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1香港ドル13.40円、1シンガポール・ドル77.26円、1ニュージーランド・ドル71.77円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シェケル31.04円、1スイス・フラン114.09円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1ユーロ123.34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（298,461,197千円）の投資信託財産総額（302,611,037千円）に対する比率は98.6%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

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>211,070,840,041円</b>
コール・ローン等	95,491,814
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	209,723,806,460
未収入金	1,251,541,767
<b>(B) 負債</b>	<b>1,347,617,920</b>
未払解約金	1,249,748,049
未払信託報酬	96,828,675
その他未払費用	1,041,196
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>209,723,222,121</b>
元本	114,439,129,689
次期繰越損益金	95,284,092,432
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>114,439,129,689口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	18,326円

(注) 期首元本額 85,111,936,866円  
 期中追加設定元本額 55,388,528,172円  
 期中一部解約元本額 26,061,335,349円

## 損益の状況

当期(2019年11月21日~2020年11月20日)

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 20,891円</b>
受取利息	3,193
支払利息	△ 24,084
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>20,192,838,997</b>
売買益	23,241,078,676
売買損	△ 3,048,239,679
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 177,462,904</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>20,015,355,202</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>15,177,725,071</b>
(分配準備積立金)	(15,177,725,071)
<b>(F) 追加信託差損益金*</b>	<b>60,091,012,159</b>
(配当等相当額)	(49,630,620,305)
(売買損益相当額)	(10,460,391,854)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>95,284,092,432</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>95,284,092,432</b>
追加信託差損益金	60,091,012,159
(配当等相当額)	(49,735,827,113)
(売買損益相当額)	(10,355,185,046)
分配準備積立金	35,193,080,273

(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	3,005,858,381円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	17,009,496,821円
(c) 信託約款に定める収益調整金	60,091,012,159円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	15,177,725,071円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	95,284,092,432円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	8,326.18円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■運用体制の変更について

代表取締役社長に大関洋が就任いたしました。

(2020年3月25日)

## ■約款変更

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。

(2020年2月21日)

## ■関連会社の実質保有比率

2020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7.7%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 26 期

(計算期間：2020年5月21日～2020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

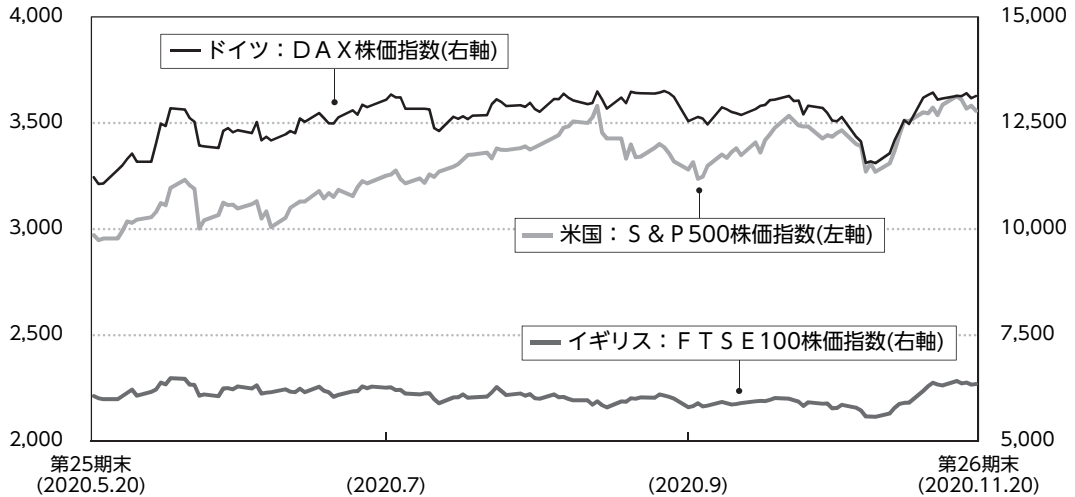


# 運用経過

2020年5月21日～2020年11月20日

## 海外株式市況

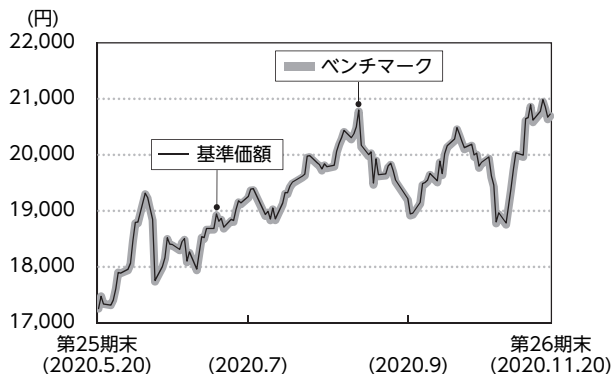
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期初から8月にかけて新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標を背景に上昇しました。9月以降は同ウイルスの感染再拡大や米中対立悪化等を受けて下落する場面もありましたが、追加財政刺激策や米大統領選の結果が好感されたこともあり上昇基調で推移し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標、追加財政刺激策や米大統領選の結果が好感されたこと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>

- ・新型コロナウイルスの感染再拡大や米中対立悪化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+20.1%となり、ベンチマーク騰落率(+19.9%)にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	△	騰落率				
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
25期(2020年5月20日)	17,256	△ 9.3	16,893	△ 9.3	95.1	2.3	2.4	227,678
26期(2020年11月20日)	20,729	20.1	20,257	19.9	94.9	2.8	2.2	300,923

(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) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	△	騰落率			
(期首)2020年5月20日	17,256	-	16,893	-	95.1	2.3	2.4
5月末	17,890	3.7	17,511	3.7	95.3	3.4	2.4
6月末	18,251	5.8	17,845	5.6	94.8	2.7	2.4
7月末	18,858	9.3	18,438	9.1	95.1	2.3	2.4
8月末	20,306	17.7	19,851	17.5	94.2	3.3	2.2
9月末	19,507	13.0	19,068	12.9	95.0	2.6	2.2
10月末	18,966	9.9	18,539	9.7	95.3	2.2	2.2
(期末)2020年11月20日	20,729	20.1	20,257	19.9	94.9	2.8	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2020年5月21日～2020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) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	0円 (0) (0) (0) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (0.001) (0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	1 (1) (0) (0)	0.004 (0.004) (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (3) (1)	0.021 (0.016) (0.006)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	5	0.027	

(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（19,355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

2020年5月21日～2020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 20,423 ( 10,299)	千米ドル 180,640 (△ 122)	百株 6,723	千米ドル 15,911
	カナダ	3,570 (△ 130)	千カナダ・ドル 12,626 (△ 487)	1,965	千カナダ・ドル 1,120
	オーストラリア	7,026 ( 263)	千オーストラリア・ドル 10,017	5,313	千オーストラリア・ドル 1,674
	香港	5,645 (△ 1,294)	千香港ドル 19,969	3,420	千香港ドル 5,615
	シンガポール	2,635	千シンガポール・ドル 1,192	3,356	千シンガポール・ドル 639
	ニュージーランド	606	千ニュージーランド・ドル 501	495	千ニュージーランド・ドル 171
	イギリス	17,518 ( 4,193)	千イギリス・ポンド 9,148 ( 280)	13,455	千イギリス・ポンド 1,803
	イスラエル	239	千イスラエル・シケル 828	4	千イスラエル・シケル 10
	スイス	1,174 ( 0.21)	千スイス・フラン 8,893 (△ 49)	210	千スイス・フラン 439
	デンマーク	420	千デンマーク・クローネ 16,823	114	千デンマーク・クローネ 2,958
	ノルウェー	479	千ノルウェー・クローネ 6,383	70	千ノルウェー・クローネ 1,076
	スウェーデン	2,266 ( 144)	千スウェーデン・クローナ 38,237	419	千スウェーデン・クローナ 2,898

## 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	120	1,054	1,001	140
		オランダ	1,185 ( 10)	4,020	47	190
		ベルギー	188	1,679	1	13
		ルクセンブルグ	100	87	1	0.910
		フランス	1,641 ( 197)	7,506 (△ 2)	202	743
		ドイツ	1,842 ( 236)	8,281 (△ 220)	149	238
		ポルトガル	328 ( 1,552)	166	1,552	14
		スペイン	2,772 (10,668)	1,927 (△ 4)	4,251	394
		イタリア	4,075	2,162	564	30
		フィンランド	538 ( 265)	741	398	336
		オーストリア	47	111	11	24
		その他	11	86	-	-

(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。

### (2) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	アメリカ	証券	千米ドル	証券	千米ドル
		6,624	41	6,624	28

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 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	0.807	68	0.342	30
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	385	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	219	—	—
PROLOGIS INC	4	411	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	7	54	0.483	3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.870	132	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.640	58	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.958	33	0.060	1
DUKE REALTY CORP	2	87	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	122	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.319	68	0.006	1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.385	29	0.186	14
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5	144	—	—
WELLTOWER INC	3	162	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	41	—	—
KIMCO REALTY CORP	—	—	24	282
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.640	73	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1	53	—	—
PUBLIC STORAGE	0.850	176	—	—
REGENCY CENTERS CORP	1	44	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	107	—	—
SL GREEN REALTY CORP	—	—	4	199
SUN COMMUNITIES INC	0.866	124	—	—
UDR INC	1	61	—	—
VENTAS INC	2	79	—	—
VORNADO REALTY TRUST	1	35	0.433	16
WP CAREY INC	0.976	64	—	—
REALTY INCOME CORP	2	171	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.894	55	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.645	66	0.012	1
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	722	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4	80	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	45	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	4	56	0.054	0.707
AMERICAN TOWER REIT INC	2	616	—	—
EQUINIX INC	0.674	509	—	—

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
<b>(アメリカ)</b>		千口	千口	千米ドル
VEREIT	5	37	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.551	165	—	—
INVITATION HOMES INC	2	79	0.035	0.917
VICI PROPERTIES INC	2	50	—	—
<b>(カナダ)</b>		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.570	11	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.605	28	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	—	—	8	87
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	17	0.724	10
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	0.856	11	0.254	3
<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	8	74	—	—
GPT GROUP	11	45	2	10
GOODMAN GROUP	10	170	0.757	13
STOCKLAND	11	43	4	15
MIRVAC GROUP	27	61	—	—
VICINITY CENTRES	63	90	17	27
SCENTRE GROUP	25	57	11	26
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	12	782	1	91
<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	24	76	1	3
		(△ 4)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	12	21	—	—
	(△ 166)			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	16	31	—	—
	( 120)	(△ 43)		
SUNTEC REIT	10	15	1	2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168	323	1	2
		(△ 1)		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	13	26	0.100	0.196
		(△0.753)		
<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	20	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	4	25	—	—
SEGRO PLC	13	122	—	—

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	0.982	14 (△ 9)	0.019	0.335
外国 GECINA SA	0.247	27	0.003	0.345
COVIVIO	0.510	31	0.026	1
ICADE	0.226	12	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.807	34	0.068	3

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

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

### (4) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 43,170	百万円 41,565	百万円 —	百万円 —

(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

2020年5月21日～2020年11月20日

### (1) 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	52	887,251	16,901	BANK OF AMERICA CORP	36	97,066	2,673
MICROSOFT CORP	37	827,954	21,886	ORACLE CORP	12	73,850	6,005
AMAZON.COM INC	2	799,330	317,446	APPLE INC	2	70,868	34,219
FACEBOOK INC-A	13	361,934	27,153	INGENICO GROUP	3	61,963	16,153
ALPHABET INC-CL A	1	309,285	159,015	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	2	49,579	16,909
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	12	252,470	20,767	ALPHABET INC-CL C	0.311	48,547	156,100
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10	244,535	24,334	WABCO HOLDINGS INC	2	43,678	14,706
NVIDIA CORP	5	241,409	44,888	POLARIS INC	3	32,006	9,551
JOHNSON & JOHNSON	14	230,032	15,470	FLEX LTD	29	31,254	1,067
SALESFORCE.COM INC	8	224,511	25,382	GRUBHUB INC	5	29,777	5,680

(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。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (2) 新株予約権証券

買付				売付			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
OCCIDENTAL PETROLEUM-CW27-WI	6,624	4,305	649	OCCIDENTAL PETROLEUM-CW27-WI	6,624	3,000	453

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## 組入有価証券明細表

2020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	330	363	6,237	647,934	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,018	1,117	12,403	1,288,461	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,015	1,116	11,124	1,155,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	25	28	765	79,525	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	365	401	9,773	1,015,268	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	442	486	3,690	383,361	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	22	-	-	-	資本財
ADOBE INC	278	304	14,184	1,473,481	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	39	43	636	66,101	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	609	739	6,327	657,298	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	69	81	318	33,034	資本財
AES CORP	382	424	885	92,007	公益事業
AFLAC INC	420	427	1,870	194,313	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	177	195	2,123	220,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	127	139	3,769	391,589	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	92	102	1,035	107,568	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	61	67	842	87,569	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	126	138	1,694	176,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	43	47	2,081	216,216	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	8	8	528	54,917	保険
ALLEGION PLC	53	58	672	69,818	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	25	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	141	157	828	86,113	公益事業
ALLSTATE CORP	185	196	1,975	205,213	保険
ALLY FINANCIAL INC	218	236	708	73,572	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	64	72	901	93,695	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	
ALPHABET INC-CL A	168	187	33,054	3,433,658	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	181	192	33,960	3,527,842	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	81	196	625	64,990	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,076	1,175	4,709	489,188	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	242	267	83,461	8,669,962	小売
AMCOR PLC	941	1,001	1,193	123,959	素材
AMERCO	5	6	269	28,022	運輸
AMEREN CORPORATION	141	155	1,221	126,919	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	61	-	-	-	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	285	313	2,584	268,518	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	400	433	4,942	513,473	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	43	47	426	44,332	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	502	543	2,096	217,788	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	104	114	1,792	186,225	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	72	76	1,408	146,270	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	89	96	982	102,011	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	154	-	-	-	各種金融
AMETEK INC	130	144	1,710	177,715	資本財
AMGEN INC	342	371	8,347	867,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	170	187	2,381	247,344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	212	233	3,175	329,869	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	48	53	1,747	181,580	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	145	159	4,960	515,306	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	134	145	2,961	307,631	保険
APACHE CORP	215	-	-	-	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	-	109	488	50,724	各種金融
APPLE INC	2,557	10,949	129,907	13,494,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	531	577	4,461	463,468	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	147	169	1,958	203,457	自動車・自動車部品
ARAMARK	144	144	510	52,982	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	231	254	886	92,136	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	319	350	1,712	177,924	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	30	35	976	101,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	45	49	437	45,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	107	119	1,390	144,421	保険
ASSURANT INC	34	37	506	52,642	保険
AT&T INC	4,208	4,504	12,738	1,323,281	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>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	80	77	333	34,593	保険
ATMOS ENERGY CORP	68	76	731	75,979	公益事業
AUTODESK INC	126	138	3,555	369,316	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	48	53	476	49,470	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	249	271	4,719	490,219	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	13	14	1,670	173,482	小売
AVALARA INC	-	50	823	85,531	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	-	292	776	80,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	48	52	774	80,460	素材
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	122	135	382	39,758	素材
BAKER HUGHES COMPANY	375	417	763	79,351	エネルギー
BALL CORP	179	206	2,022	210,110	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,915	4,928	13,296	1,381,240	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	477	502	1,934	200,940	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	278	321	2,533	263,168	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	155	183	4,264	442,985	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	22	25	722	75,056	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	756	877	20,151	2,093,322	各種金融
BEST BUY CO INC	135	146	1,740	180,791	小売
BIOGEN INC	103	102	2,506	260,372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	103	113	856	88,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	12	13	794	82,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	86	94	888	92,314	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	66	96	6,473	672,466	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	379	423	2,484	258,134	各種金融
BOEING CO	307	338	6,971	724,230	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	24	25	5,192	539,378	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	81	87	769	79,931	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	118	130	493	51,269	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	802	902	3,087	320,710	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,349	1,429	8,877	922,208	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	228	252	9,715	1,009,243	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	66	72	1,064	110,576	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	137	150	715	74,325	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	177	195	1,563	162,419	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	82	91	536	55,711	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	38	41	974	101,187	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	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	81	86	815	84,677	運輸
CABLE ONE INC	-	3	609	63,288	メディア・娯楽
CABOT OIL & GAS CORP	235	249	427	44,443	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	160	175	1,970	204,707	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	96	114	565	58,785	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	267	288	2,449	254,480	各種金融
CAPRI HOLDINGS LIMITED	86	-	-	-	耐久消費財・アパレル
CARDINAL HEALTH INC	169	185	971	100,880	ヘルスケア機器・サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	-	89	248	25,817	各種金融
CARMAX INC	95	103	975	101,369	小売
CARNIVAL CORP	241	301	548	57,027	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	472	520	2,034	211,395	資本財
CATALENT INC	-	98	1,025	106,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	317	342	5,914	614,368	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	64	69	622	64,706	各種金融
CBRE GROUP INC	182	212	1,242	129,075	不動産
CDK GLOBAL INC	70	77	369	38,396	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	82	90	1,197	124,428	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	69	74	999	103,826	素材
CENTENE CORP	336	365	2,328	241,839	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	289	321	753	78,318	公益事業
CENTURYLINK INC	570	597	587	60,987	電気通信サービス
CERNER CORP	180	190	1,390	144,438	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	126	135	436	45,363	素材
CHARLES SCHWAB CORP	663	915	4,310	447,760	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	86	91	5,949	618,001	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	69	71	855	88,829	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	133	143	793	82,418	エネルギー
CHEVRON CORP	1,088	1,178	10,106	1,049,876	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	15	16	2,189	227,474	消費者サービス
CHUBB LTD	260	284	4,198	436,178	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	141	155	1,340	139,259	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	214	232	4,767	495,255	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	88	97	760	78,956	保険
CINTAS CORP	50	55	2,055	213,553	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	2,440	2,665	10,974	1,140,080	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,255	1,314	6,854	712,021	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	249	269	883	91,771	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	74	73	890	92,486	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	72	79	1,612	167,482	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	206	226	3,759	390,568	各種金融
CMS ENERGY CORP	166	182	1,103	114,653	公益事業
COCA-COLA CO	2,344	2,578	13,698	1,422,956	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	132	130	556	57,796	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	97	107	770	80,044	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	314	340	2,595	269,591	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	469	514	4,394	456,457	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	2,615	2,876	14,233	1,478,593	メディア・娯楽
COMERICA INC	82	88	451	46,895	銀行
CONAGRA BRANDS INC	280	307	1,112	115,575	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	115	123	705	73,303	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	629	674	2,662	276,550	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	191	211	1,627	169,033	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	96	106	2,166	225,009	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	49	-	-	-	エネルギー
COOPER COS INC/THE	28	33	1,116	116,029	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	120	133	1,515	157,386	商業・専門サービス
CORNING INC	442	480	1,746	181,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	431	471	1,743	181,085	素材
COSTAR GROUP INC	21	24	2,222	230,879	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	254	278	10,688	1,110,280	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	178	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
COUPA SOFTWARE INC	-	42	1,324	137,573	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	-	90	1,295	134,568	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	78	85	824	85,638	素材
CSX CORP	429	488	4,476	465,049	運輸
CUMMINS INC	83	92	2,166	225,039	資本財
CVS HEALTH CORP	748	825	5,453	566,504	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	21	24	268	27,936	ソフトウェア・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	203	228	99	10,302	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	360	402	9,097	945,007	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	70	81	899	93,438	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	-	83	740	76,955	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	52	53	576	59,872	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	
DEERE & CO	172	188	4,805	499,152	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	93	152	1,044	108,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	92	101	383	39,837	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	128	138	676	70,311	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	220	-	-	-	エネルギー
DEXCOM INC	52	58	1,929	200,414	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	87	98	389	40,478	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	180	195	1,496	155,505	各種金融
DISCOVERY INC-A	89	96	241	25,096	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	211	207	468	48,620	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP	146	154	523	54,369	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	61	109	2,414	250,864	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	147	158	3,357	348,809	小売
DOLLAR TREE INC	136	149	1,415	147,072	小売
DOMINION ENERGY INC	475	530	4,233	439,751	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	22	24	949	98,634	消費者サービス
DOVER CORP	83	91	1,136	118,016	資本財
DOW INC	428	469	2,597	269,827	素材
DR HORTON INC	202	218	1,638	170,179	耐久消費財・アパレル
DROPBOX INC-CLASS A	139	157	297	30,858	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	111	122	1,587	164,928	公益事業
DUKE ENERGY CORP	422	465	4,266	443,197	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	425	464	2,879	299,102	素材
DXC TECHNOLOGY CO	146	-	-	-	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	-	115	415	43,190	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	128	-	-	-	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	81	87	379	39,421	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	77	85	828	86,058	素材
EATON CORP PLC	238	252	2,986	310,230	資本財
EATON VANCE CORP	63	-	-	-	各種金融
EBAY INC	444	442	2,203	228,859	小売
ECOLAB INC	149	161	3,395	352,773	素材
EDISON INTERNATIONAL	206	239	1,525	158,440	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	119	390	3,329	345,918	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	228	252	744	77,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	167	181	2,183	226,851	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	497	544	7,804	810,747	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	
EMERSON ELECTRIC CO	349	377	2,914	302,757	資本財
ENTERGY CORP	115	127	1,388	144,248	公益事業
EOG RESOURCES INC	333	365	1,659	172,437	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	31	35	1,175	122,063	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	70	76	1,336	138,812	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	238	255	632	65,679	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	14	16	386	40,117	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	125	148	637	66,237	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	127	141	3,434	356,804	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	23	24	584	60,677	保険
EVERGY INC	132	144	775	80,575	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	187	213	1,878	195,142	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	84	95	1,076	111,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	558	616	2,609	271,068	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	80	85	1,063	110,497	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	103	105	955	99,222	運輸
EXXON MOBIL CORP	2,434	2,670	9,987	1,037,519	エネルギー
F5 NETWORKS INC	34	37	608	63,204	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	1,385	1,518	41,444	4,305,234	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21	23	754	78,346	各種金融
FAIR ISAAC CORP	-	18	880	91,463	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	329	359	1,726	179,394	資本財
FEDEX CORP	143	157	4,416	458,737	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	158	174	622	64,665	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	354	390	5,771	599,546	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	407	450	1,165	121,123	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	97	108	1,431	148,704	銀行
FIRSTENERGY CORP	311	346	1,005	104,485	公益事業
FISERV INC	333	359	4,068	422,611	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	50	52	1,376	142,976	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	292	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	76	82	308	32,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	74	-	-	-	資本財
FMC CORP	74	81	945	98,207	素材
FORD MOTOR CO	2,250	2,475	2,183	226,784	自動車・自動車部品
FORTINET INC	83	86	1,014	105,414	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	173	191	1,367	142,059	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	80	87	743	77,192	資本財
FOX CORP - CLASS A	202	208	578	60,117	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	100	115	314	32,721	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	166	183	383	39,813	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	835	915	1,933	200,857	素材
GAP INC	125	-	-	-	小売
GARMIN LTD	76	90	1,030	107,065	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	51	57	868	90,177	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	141	154	2,312	240,211	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	5,030	5,528	5,340	554,770	資本財
GENERAL MILLS INC	348	382	2,371	246,351	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	740	814	3,486	362,163	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	83	91	898	93,362	小売
GILEAD SCIENCES INC	727	792	4,803	498,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	173	189	3,606	374,647	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	57	62	585	60,869	保険
GODADDY INC - CLASS A	99	105	802	83,370	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	183	206	4,629	480,866	各種金融
GRUBHUB INC	52	-	-	-	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47	52	621	64,571	ソフトウェア・サービス
HALLIBURTON CO	502	553	886	92,069	エネルギー
HANESBRANDS INC	208	-	-	-	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	89	-	-	-	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	205	224	1,036	107,639	保険
HASBRO INC	75	82	759	78,888	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	155	170	2,573	267,350	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	93	101	566	58,828	資本財
HEICO CORP	24	27	365	37,918	資本財
HEICO CORP-CLASS A	43	45	535	55,650	資本財
HENRY SCHEIN INC	84	88	565	58,694	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	85	93	1,393	144,767	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	157	174	821	85,343	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	739	806	845	87,845	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	153	174	1,797	186,773	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	86	-	-	-	エネルギー
HOLOGIC INC	154	162	1,139	118,405	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	627	679	18,407	1,912,173	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	411	443	8,989	933,799	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	686	777	327	34,061	不動産
HORMEL FOODS CORP	168	185	926	96,225	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	223	247	583	60,638	資本財
HP INC	851	902	1,850	192,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	76	83	3,395	352,755	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	594	645	770	80,089	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	23	25	412	42,867	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	45	-	-	-	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	-	50	696	72,379	メディア・娯楽
IDEX CORP	43	47	932	96,828	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	49	53	2,452	254,751	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	219	240	2,224	231,093	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	185	199	4,133	429,383	資本財
ILLUMINA INC	84	92	2,776	288,455	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	105	116	951	98,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	119	223	989	102,757	資本財
INGREDION INC	38	41	318	33,046	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	35	41	1,097	113,969	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	2,503	2,673	12,194	1,266,745	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	321	345	3,486	362,146	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	509	561	6,577	683,251	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	58	54	607	63,089	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	214	236	1,162	120,777	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	226	251	543	56,439	メディア・娯楽
INTUIT INC	149	164	5,943	617,450	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	66	73	5,401	561,070	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	221	244	390	40,571	各種金融
IONIS PHARMACEUTICALS INC	77	83	423	44,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPG PHOTONICS CORP	21	23	468	48,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	95	121	2,056	213,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	44	48	778	80,856	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	76	82	867	90,092	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	128	140	717	74,490	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	129	142	347	36,095	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	32	34	494	51,366	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	52	55	739	76,822	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	145	-	-	-	各種金融
JM SMUCKER CO	65	71	838	87,108	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,515	1,663	24,479	2,542,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	446	472	2,159	224,340	資本財
JONES LANG LASALLE INC	29	32	439	45,610	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,805	1,923	22,231	2,309,425	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	190	208	456	47,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	59	61	1,154	119,958	運輸
KELLOGG CO	147	162	1,059	110,050	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	-	225	669	69,564	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	566	619	967	100,549	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	107	117	1,387	144,127	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	197	215	3,054	317,271	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,176	1,288	1,855	192,746	エネルギー
KKR & CO INC -A	284	318	1,224	127,213	各種金融
KLA CORPORATION	90	97	2,387	248,016	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	78	84	353	36,736	運輸
KOHL'S CORP	91	-	-	-	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	386	424	1,352	140,455	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	460	494	1,620	168,341	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	127	136	2,670	277,376	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	55	61	1,220	126,738	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	83	91	4,010	416,561	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	84	92	665	69,164	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	198	217	1,272	132,212	消費者サービス
LEAR CORP	32	35	504	52,367	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	76	-	-	-	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	77	85	859	89,254	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	161	173	1,326	137,825	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	20	22	656	68,220	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	-	15	237	24,648	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	61	69	1,093	113,621	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	90	125	288	30,017	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	246	225	504	52,361	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA CORP - RIGHT	13	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	50	53	230	23,948	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	94	112	481	50,061	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>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	117	130	535	55,607	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	111	119	535	55,593	保険
LINDE PLC	309	332	8,403	873,002	素材
LIVE NATION INC	87	103	692	71,938	メディア・娯楽
LKQ CORP	175	182	643	66,810	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	146	159	6,000	623,360	資本財
LOEWS CORP	153	159	684	71,054	保険
LOWE'S COS INC	442	476	7,135	741,186	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	63	78	2,695	279,968	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	152	169	1,391	144,531	素材
M&T BANK CORP	72	80	964	100,144	銀行
MANPOWER GROUP	32	-	-	-	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	452	-	-	-	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	373	412	1,610	167,325	エネルギー
MARKEL CORP	7	8	875	90,918	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	21	23	1,274	132,355	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	159	174	2,109	219,121	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	290	322	3,695	383,939	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36	39	1,059	110,015	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	365	420	1,856	192,879	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	163	166	919	95,566	資本財
MASIMO CORPORATION	-	32	797	82,801	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	516	564	18,847	1,957,881	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	32	155	2,056	213,628	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	155	168	1,367	142,053	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	71	78	1,433	148,929	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	433	469	10,108	1,050,088	消費者サービス
MCKESSON CORP	103	102	1,754	182,290	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	771	846	9,401	976,579	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	125	136	256	26,601	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	25	28	3,872	402,271	小売
MERCK & CO INC	1,465	1,594	12,816	1,331,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	446	483	2,201	228,729	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	13	15	1,733	180,089	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	278	294	801	83,226	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	137	155	1,982	205,931	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	637	701	4,335	450,412	半導体・半導体製造装置

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	
MICROSOFT CORP	4,171	4,549	96,648	10,039,895	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	32	-	-	-	資本財
MODERNA INC	-	171	1,595	165,745	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	35	38	488	50,744	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	-	37	780	81,073	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	109	119	526	54,688	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	828	901	5,190	539,196	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	27	30	777	80,721	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	231	248	2,078	215,872	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	97	106	2,922	303,606	各種金融
MORGAN STANLEY	697	890	5,218	542,053	各種金融
MOSAIC CO/THE	207	228	447	46,527	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	99	107	1,821	189,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	48	53	2,153	223,658	各種金融
MYLAN NV	295	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	66	71	897	93,247	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	219	245	301	31,339	エネルギー
NETAPP INC	130	139	725	75,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	252	277	13,464	1,398,654	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	50	55	486	50,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	233	256	522	54,310	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	471	506	3,108	322,944	素材
NEWS CORP - CLASS A	225	246	432	44,877	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	281	1,237	9,293	965,448	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	206	227	364	37,910	商業・専門サービス
NIKE INC	717	783	10,338	1,073,971	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	215	247	584	60,668	公益事業
NOBLE ENERGY INC	274	-	-	-	エネルギー
NORDSON CORP	-	34	699	72,694	資本財
NORDSTROM INC	62	-	-	-	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	152	163	3,956	410,990	運輸
NORTHERN TRUST CORP	115	124	1,165	121,063	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	92	99	3,094	321,455	資本財
NORTONLIFELOCK INC	357	352	658	68,423	ソフトウェア・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	121	-	-	-	消費者サービス
NRG ENERGY INC	143	152	471	48,929	公益事業
NUCOR CORP	172	189	998	103,722	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NVIDIA CORP	334	388	20,880	2,169,094	半導体・半導体製造装置
NVR INC	2	2	931	96,777	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	161	176	2,668	277,214	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	514	569	761	79,073	エネルギー
OGE ENERGY CORP	114	128	431	44,791	公益事業
OKTA INC	61	73	1,708	177,528	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	56	60	1,250	129,938	運輸
OMNICOM GROUP	126	136	813	84,459	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	236	260	724	75,248	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	238	278	928	96,497	エネルギー
ORACLE CORP	1,321	1,294	7,307	759,109	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	43	46	2,114	219,634	小売
OTIS WORLDWIDE CORP	236	260	1,721	178,800	資本財
OWENS CORNING	62	68	497	51,651	資本財
PACCAR INC	199	218	1,968	204,520	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	54	59	775	80,591	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	56	61	1,755	182,311	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	73	81	2,179	226,377	資本財
PAYCHEX INC	185	204	1,879	195,236	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	28	31	1,236	128,398	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	642	704	13,447	1,396,973	ソフトウェア・サービス
PELTON INTERACTIVE INC-A	-	123	1,302	135,291	耐久消費財・アパレル
PENTAIR PLC	90	104	554	57,616	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	254	263	339	35,250	銀行
PEPSICO INC	802	876	12,562	1,305,029	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	63	70	922	95,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PERRIGO CO PLC	74	85	419	43,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	3,185	3,508	12,695	1,318,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	-	676	830	86,309	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	895	984	7,627	792,371	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	254	275	1,691	175,742	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	64	71	597	62,021	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	168	254	1,680	174,519	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	95	102	994	103,340	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	252	268	3,492	362,807	銀行
POLARIS INC	33	-	-	-	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	136	149	2,134	221,722	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PPL CORPORATION	417	487	1,426	148,167	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	158	172	843	87,597	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,436	1,563	21,818	2,266,500	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	336	369	3,479	361,470	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	230	250	1,894	196,826	保険
PTC INC	63	69	694	72,192	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	290	320	1,844	191,597	公益事業
PULTE GROUP INC	149	169	739	76,863	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	42	-	-	-	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	67	72	1,059	110,085	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	657	710	10,482	1,088,916	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	77	84	1,036	107,686	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	28	30	244	25,349	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	70	76	686	71,265	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	846	956	6,803	706,779	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	46	63	3,273	340,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	549	603	932	96,906	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	35	42	499	51,921	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	25	31	551	57,330	保険
REPUBLIC SERVICES INC	129	141	1,418	147,356	商業・専門サービス
RESMED INC	83	91	1,932	200,728	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	43	46	1,373	142,705	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	64	71	445	46,300	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	66	73	1,834	190,544	資本財
ROKU INC	52	64	1,647	171,172	メディア・娯楽
ROLLINS INC	84	92	545	56,672	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	59	65	2,699	280,445	資本財
ROSS STORES INC	207	224	2,473	256,986	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	102	112	836	86,893	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	75	82	733	76,178	素材
S&P GLOBAL INC	140	152	5,151	535,110	各種金融
SABRE CORP	159	-	-	-	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	479	568	15,035	1,561,839	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	43	47	633	65,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER LTD	799	878	1,796	186,670	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	136	145	815	84,752	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGEN INC	69	76	1,336	138,876	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	
SEALED AIR CORP	89	98	442	45,984	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	71	76	414	43,007	各種金融
SEMPRA ENERGY	162	185	2,411	250,474	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	91	100	479	49,758	資本財
SERVICENOW INC	108	120	6,191	643,173	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	47	51	3,769	391,598	素材
SIGNATURE BANK	31	33	351	36,520	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	907	704	451	46,940	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	98	105	1,463	152,034	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	-	242	671	69,762	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	78	85	482	50,170	資本財
SNAP INC - A	428	564	2,386	247,879	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	31	32	552	57,421	資本財
SOUTHERN CO	605	669	4,087	424,638	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	74	91	419	43,598	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	59	-	-	-	資本財
SPLUNK INC	89	100	2,002	208,005	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	200	229	4,396	456,667	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	131	146	1,005	104,418	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	87	97	1,817	188,825	資本財
STARBUCKS CORP	679	737	7,213	749,339	消費者サービス
STATE STREET CORP	208	221	1,534	159,443	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	121	131	470	48,886	素材
STERIS PLC	48	53	1,042	108,303	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	193	213	4,988	518,166	ヘルスケア機器・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	29	32	1,140	118,487	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	334	332	1,000	103,899	各種金融
SYNOPSIS INC	86	94	2,097	217,935	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	279	305	2,196	228,156	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	133	142	1,983	206,081	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	65	71	1,189	123,568	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	158	-	-	-	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	134	-	-	-	エネルギー
TARGET CORP	291	315	5,409	561,935	小売
TE CONNECTIVITY LTD	192	208	2,319	240,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	247	-	-	-	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	-	44	855	88,857	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	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	20	23	905	94,025	資本財
TELEFLEX INC	26	29	1,095	113,771	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	96	103	1,106	114,914	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	77	468	23,396	2,430,406	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	628	692	647	67,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	538	579	9,113	946,708	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	129	142	648	67,354	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	230	249	11,303	1,174,159	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	62	68	905	94,085	小売
TJX COS INC	694	756	4,659	484,071	小売
T-MOBILE US INC	247	352	4,550	472,715	電気通信サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	68	72	957	99,420	小売
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	-	25	2,084	216,497	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	-	52	309	32,168	各種金融
TRANE TECHNOLOGIES PLC	135	151	2,224	231,030	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	27	32	1,924	199,900	資本財
TRANSUNION	108	120	1,162	120,769	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	148	159	2,129	221,223	保険
TRIMBLE INC	142	157	911	94,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	59	-	-	-	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	772	853	4,000	415,613	銀行
TWILIO INC - A	68	77	2,285	237,427	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	424	496	2,163	224,763	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	22	25	1,036	107,700	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	169	185	1,158	120,328	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	249	605	2,983	309,929	運輸
UGI CORP	121	133	479	49,845	公益事業
ULTA BEAUTY INC	32	33	927	96,364	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	108	-	-	-	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	113	-	-	-	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	402	431	8,820	916,305	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	34	-	-	-	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	405	445	7,417	770,566	運輸
UNITED RENTALS INC	42	45	984	102,272	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	545	598	20,180	2,096,357	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	45	48	652	67,792	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	112	-	-	-	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
US BANCORP	854	856	3,705	384,904	銀行
VAIL RESORTS INC	23	25	703	73,129	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	236	257	1,317	136,891	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	52	57	993	103,199	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	75	85	2,320	241,013	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	60	65	1,299	134,997	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	89	97	2,005	208,380	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,383	2,617	15,759	1,637,089	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	148	163	3,462	359,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	195	209	1,780	184,994	耐久消費財・アパレル
VIACOMCBS INC	325	356	1,193	123,947	メディア・娯楽
VIATRIS INC	-	759	1,375	142,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	985	1,065	22,115	2,297,406	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	211	278	515	53,542	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	47	52	787	81,796	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	77	80	461	47,919	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	76	83	1,172	121,807	素材
WABCO HOLDINGS INC	29	-	-	-	資本財
WABTEC CORP	105	114	829	86,167	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	435	468	1,773	184,266	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	818	894	13,605	1,413,303	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	1,037	1,141	16,173	1,680,104	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	152	167	1,770	183,943	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	245	267	3,224	334,966	商業・専門サービス
WATERS CORP	36	39	884	91,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	36	40	1,010	105,007	小売
WEC ENERGY GROUP INC	183	199	1,905	197,938	公益事業
WELLS FARGO & CO	2,313	2,459	6,433	668,306	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	46	1,302	135,286	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	171	189	808	83,945	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	242	259	559	58,120	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	22	-	-	-	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	148	162	693	72,013	素材
WEYERHAEUSER CO	427	470	1,365	141,800	不動産
WHIRLPOOL CORP	36	39	756	78,552	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	702	767	1,547	160,796	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	74	81	1,662	172,700	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	
WIX.COM LTD	28	32	842	87,468	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	94	109	2,538	263,682	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	84	89	600	62,349	保険
WW GRAINGER INC	26	28	1,207	125,410	資本財
WYNN RESORTS LTD	55	61	608	63,220	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	302	332	2,303	239,312	公益事業
XEROX HOLDINGS CORP	111	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	144	153	2,040	211,998	半導体・半導体製造装置
XPO LOGISTICS INC	54	58	622	64,681	運輸
XYLEM INC	103	113	1,074	111,599	資本財
YUM! BRANDS INC	174	189	1,996	207,434	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30	33	1,198	124,458	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C W/I	74	88	969	100,681	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	118	130	1,914	198,854	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.	95	100	385	40,043	銀行
ZOETIS INC	274	300	4,996	518,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	-	100	4,163	432,473	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	-	45	628	65,251	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	173,094 609	197,094 590	1,971,641 -	204,814,075 <68.1%>
<b>(カナダ)</b>			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	138	152	1,341	106,543	素材
AIR CANADA	76	91	199	15,811	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	311	383	771	61,293	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	500	542	2,345	186,269	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	163	178	321	25,520	公益事業
ATCO LTD -CL 'I'	45	49	186	14,834	公益事業
AURORA CANNABIS INC	53	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B2GOLD CORP	-	645	478	38,017	素材
BANK OF MONTREAL	368	404	3,733	296,560	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	702	766	4,827	383,422	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,023	1,122	3,542	281,381	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	182	204	523	41,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	94	106	604	48,033	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	297	343	240	19,113	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC	1,258	-	-	-	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	772	847	4,516	358,722	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>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAE INC	155	168	523	41,559	資本財
CAMECO CORP	226	246	317	25,235	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	257	281	3,085	245,050	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	418	455	6,513	517,403	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	680	745	2,081	165,332	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	80	87	3,854	306,182	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	33	36	585	46,540	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	77	85	267	21,233	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	121	145	454	36,064	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	87	96	562	44,713	素材
CENOVUS ENERGY INC	597	655	396	31,471	エネルギー
CGI INC	136	144	1,317	104,683	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	124	129	223	17,773	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	12	1,976	157,029	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC	110	124	117	9,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	172	187	937	74,498	小売
EMERA INC	143	160	881	70,054	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	100	106	383	30,451	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	1,167	1,284	4,890	388,419	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	15	17	747	59,342	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	396	370	621	49,352	素材
FORTIS INC	257	300	1,590	126,369	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	108	119	1,999	158,797	素材
GEORGE WESTON LTD	45	49	478	38,012	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	119	126	426	33,885	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	164	182	549	43,667	保険
HUSKY ENERGY INC	194	-	-	-	エネルギー
HYDRO ONE LTD	195	216	615	48,904	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	61	66	383	30,469	保険
IGM FINANCIAL INC	51	54	185	14,739	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	148	159	360	28,639	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	81	90	1,341	106,580	保険
INTER PIPELINE LTD	243	270	333	26,460	エネルギー
KEYERA CORP	124	137	302	24,032	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	719	784	769	61,140	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	156	166	878	69,798	素材
LOBLAW COS LTD	104	112	723	57,434	食品・生活必需品小売り

## 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	
LUNDIN MINING CORP	380	411	362	28,771	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	167	181	1,437	114,183	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,121	1,225	2,666	211,798	保険
METHANEX CORP	38	-	-	-	素材
METRO INC	146	161	972	77,221	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	196	212	1,499	119,096	銀行
NUTRIEN LTD	332	360	2,109	167,555	素材
ONEX CORPORATION	50	53	369	29,339	各種金融
OPEN TEXT CORP	156	174	969	77,014	ソフトウェア・サービス
OVINTIV INC	145	-	-	-	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	133	528	41,945	素材
PARKLAND CORP	86	95	385	30,640	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	317	347	1,094	86,948	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	330	357	1,045	83,011	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	122	-	-	-	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	107	117	380	30,212	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	164	180	1,408	111,872	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	-	69	587	46,652	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	210	228	1,367	108,605	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	826	900	9,364	743,787	銀行
SAPUTO INC	141	155	531	42,200	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	280	302	698	55,457	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	59	67	8,574	681,035	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	130	-	-	-	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	339	370	2,180	173,195	保険
SUNCOR ENERGY INC	882	962	1,938	153,976	エネルギー
TC ENERGY CORP	539	595	3,301	262,232	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	276	295	573	45,527	素材
THOMSON REUTERS CORP	118	110	1,164	92,484	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD	-	36	461	36,683	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	1,043	1,143	7,820	621,214	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	30	-	-	-	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	257	283	1,516	120,416	素材
WSP GLOBAL INC	61	72	677	53,851	資本財
YAMANA GOLD INC	-	596	411	32,711	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,945 83	24,420 80	121,709 -	9,667,384 <3.2%>

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	オーストラリアドル	千円	
AFTERPAY LTD	-	136	1,336	101,046	ソフトウェア・サービス
AGL ENERGY LTD	394	444	576	43,566	公益事業
ALUMINA LTD	1,540	-	-	-	素材
AMP LTD	2,087	2,316	403	30,472	各種金融
AMPOL LTD	151	169	482	36,488	エネルギー
ARISTOCRAT LEISURE LTD	341	373	1,291	97,644	消費者サービス
ASX LTD	124	132	1,083	81,892	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	1,370	1,410	569	43,089	運輸
AUSNET SERVICES	1,591	1,516	284	21,493	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	1,661	1,839	4,129	312,191	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	364	-	-	-	銀行
BHP GROUP LIMITED	1,723	1,875	6,848	517,739	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	303	341	604	45,729	素材
BORAL LTD	737	-	-	-	素材
BRAMBLES LTD	935	1,015	1,105	83,594	商業・専門サービス
CHALLENGER LTD	334	-	-	-	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED	69	78	182	13,803	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED	336	382	481	36,418	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	34	44	1,039	78,589	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	674	872	1,574	119,035	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,031	1,135	8,958	677,258	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	317	355	480	36,303	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	270	289	273	20,695	消費者サービス
CSL LIMITED	263	289	8,968	678,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EVOLUTION MINING LTD	-	1,077	596	45,060	素材
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	36	-	-	-	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	814	1,079	1,830	138,379	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	389	-	-	-	小売
INCITEC PIVOT LTD	1,098	-	-	-	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,404	1,562	853	64,500	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	266	290	1,168	88,311	素材
MACQUARIE GROUP LTD	201	219	3,026	228,776	各種金融
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	76	85	529	40,046	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,700	1,896	553	41,863	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,696	2,068	4,695	355,001	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	453	521	1,476	111,600	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	485	686	51,877	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>(オーストラリア)</b>		百株	百株	オーストラリアドル	千円	
OIL SEARCH LTD	841	1,318	491	37,193	エネルギー	
ORICA LTD	265	300	510	38,603	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,063	1,193	568	42,961	エネルギー	
QANTAS AIRWAYS LTD	495	642	337	25,484	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LTD	789	970	970	73,365	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	102	127	842	63,675	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	34	38	534	40,387	メディア・娯楽	
RIO TINTO LTD	219	239	2,368	179,091	素材	
SANTOS LTD	1,080	1,178	707	53,459	エネルギー	
SEEK LTD	210	238	606	45,882	メディア・娯楽	
SONIC HEALTHCARE LTD	293	304	1,041	78,763	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	2,956	3,249	747	56,505	素材	
SUNCORP GROUP LTD	800	903	851	64,377	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	1,333	1,582	649	49,065	消費者サービス	
TELSTRA CORP LTD	2,553	2,888	895	67,693	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD	247	-	-	-	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD	-	285	219	16,582	電気通信サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	432	475	470	35,550	食品・飲料・タバコ	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	84	80	234	17,701	エネルギー	
WESFARMERS LIMITED	674	744	3,681	278,302	小売	
WESTPAC BANKING CORP	2,092	2,337	4,651	351,635	銀行	
WISETECH GLOBAL LTD	87	96	295	22,373	ソフトウェア・サービス	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	572	648	1,412	106,768	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	744	813	3,105	234,759	食品・生活必需品小売り	
WORLEY LIMITED	208	-	-	-	エネルギー	
<b>小計</b>	<b>株数・金額</b>	<b>42,988</b>	<b>44,964</b>	<b>82,284</b>	<b>6,220,708</b>	
	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>58</b>	<b>53</b>	<b>-</b>	<b>&lt;2.1%&gt;</b>	
<b>(香港)</b>				千香港ドル		
AIA GROUP LTD	6,974	7,642	67,409	903,281	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	177	195	1,706	22,863	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	774	860	1,379	18,484	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,150	2,380	5,855	78,467	銀行	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	770	1,091	2,945	39,472	食品・飲料・タバコ	
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,489	1,639	7,162	95,981	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,579	1,709	9,921	132,944	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	395	435	1,742	23,345	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD	946	1,046	7,691	103,062	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	
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港ドル	千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,228	1,358	8,325	111,557	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,191	1,311	2,773	37,171	不動産
HANG SENG BANK LTD	443	488	6,472	86,731	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	866	996	3,123	41,858	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	5,880	6,847	8,312	111,392	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	693	761	28,191	377,766	各種金融
KERRY PROPERTIES LTD	405	450	933	12,512	不動産
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	-	460	1,589	21,296	ヘルスケア機器・サービス
MTR CORP	937	1,057	4,531	60,723	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,656	1,009	4,072	54,564	不動産
NWS HOLDINGS LTD	950	-	-	-	資本財
PCCW LTD	3,020	3,330	1,581	21,195	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	810	885	3,649	48,907	公益事業
SANDS CHINA LTD	1,405	1,557	5,304	71,077	消費者サービス
SINO LAND CO	1,860	2,060	2,053	27,521	不動産
SJM HOLDINGS LTD	1,130	1,270	1,191	15,962	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	920	830	8,850	118,593	不動産
SWIRE PACIFIC LTD	288	328	1,531	20,522	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	698	772	1,856	24,879	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	795	875	9,143	122,526	資本財
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	380	-	-	-	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	5,505	6,045	4,062	54,434	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	707	1,067	4,167	55,850	不動産
WHEELOCK & CO LTD	490	-	-	-	不動産
WYNN MACAU LTD	905	1,033	1,429	19,158	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	440	-	-	-	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	50,863 34	51,793 31	218,963 -	2,934,105 <1.0%>
<b>(シンガポール)</b>			千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD	1,516	1,751	521	40,314	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	249	297	225	17,393	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,332	-	-	-	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,031	1,134	2,769	213,950	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,397	3,760	308	23,820	消費者サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	56	61	125	9,708	小売
KEPPEL CORP LTD	837	943	478	36,938	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,904	2,093	2,049	158,309	銀行



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポールドル	千円	
	百株	百株				
	SATS LTD	466	-	-	-	運輸
	SENBCORP INDUSTRIES LTD	542	-	-	-	資本財
	SINGAPORE AIRLINES LTD	317	874	354	27,415	運輸
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	465	506	459	35,496	各種金融
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	962	-	-	-	メディア・娯楽
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	926	995	389	30,057	資本財
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,768	5,229	1,249	96,554	電気通信サービス
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	722	744	1,667	128,815	銀行
	UOL Group Limited	271	298	220	17,060	不動産
	VENTURE CORP LTD	158	175	331	25,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,108	1,191	506	39,107	食品・飲料・タバコ
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,325	1,580	145	11,230	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,352 20	21,631 16	11,801 -	911,753 <0.3%>	
<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	423	469	682	48,953	食品・飲料・タバコ
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	594	827	638	45,822	運輸
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	331	363	1,215	87,215	ヘルスケア機器・サービス
	FLETCHER BUILDING LTD	487	-	-	-	素材
	MERCURY NZ LTD	412	464	273	19,618	公益事業
	MERIDIAN ENERGY LTD	738	829	494	35,521	公益事業
	RYMAN HEALTHCARE LTD	238	259	402	28,894	ヘルスケア機器・サービス
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,109	1,232	559	40,119	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,334 8	4,445 7	4,265 -	306,145 <0.1%>	
<b>(イギリス)</b>				千イギリスポンド		
	3I GROUP PLC	555	612	677	93,214	各種金融
	ADMIRAL GROUP PLC	109	121	357	49,200	保険
	ANGLO AMERICAN PLC	586	770	1,632	224,815	素材
	ANTOFAGASTA PLC	217	245	269	37,070	素材
	ASHTREAD GROUP PLC	262	284	890	122,637	資本財
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	204	223	446	61,508	食品・飲料・タバコ
	ASTRAZENECA PLC	755	829	6,736	927,506	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	530	611	341	46,970	メディア・娯楽
	AVEVA GROUP PLC	37	41	173	23,917	ソフトウェア・サービス
	AVIVA PLC	2,249	2,448	771	106,192	保険
	BAE SYSTEMS PLC	1,846	2,029	1,030	141,912	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>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BARCLAYS PLC	9,939	10,888	1,512	208,231	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	588	646	421	58,082	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	68	79	380	52,383	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	1,209	1,326	2,151	296,229	素材
BP PLC	11,673	12,830	3,126	430,497	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,321	1,449	4,029	554,812	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	4,859	5,639	721	99,380	電気通信サービス
BUNZL PLC	194	212	505	69,654	資本財
BURBERRY GROUP PLC	234	256	411	56,640	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC	89	-	-	-	消費者サービス
CENTRICA PLC	3,388	-	-	-	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI	114	126	282	38,896	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	913	1,124	1,518	209,008	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	73	81	507	69,927	素材
DCC PLC	56	62	343	47,356	資本財
DIAGEO PLC	1,350	1,478	4,405	606,551	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	782	852	258	35,614	保険
EASYJET PLC	93	-	-	-	運輸
EVRAZ PLC	296	318	120	16,595	素材
EXPERIAN PLC	523	574	1,686	232,137	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	130	141	1,143	157,500	資本財
G4S PLC	905	-	-	-	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,875	3,173	4,427	609,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	6,134	6,299	1,199	165,132	素材
GVC HOLDINGS PLC	336	367	356	49,109	消費者サービス
HALMA PLC	217	239	581	80,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	190	208	306	42,134	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	-	108	281	38,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	11,710	12,860	4,935	679,551	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	546	598	901	124,115	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	727	963	561	77,246	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	99	110	494	68,051	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	93	102	616	84,917	商業・専門サービス
ITV PLC	2,098	-	-	-	メディア・娯楽
JD SPORTS FASHION PLC	251	276	221	30,471	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	109	121	292	40,241	素材
KINGFISHER PLC	1,202	1,321	384	52,997	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>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,426	3,791	978	134,671	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	40,320	44,527	1,585	218,248	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	181	200	1,620	223,122	各種金融
M&G PLC	1,481	1,650	318	43,864	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,116	-	-	-	小売
MEGGITT PLC	447	-	-	-	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,811	3,082	487	67,098	資本財
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	192	-	-	-	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	276	304	513	70,689	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	1,370	1,498	279	38,415	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	2,006	2,220	2,072	285,282	公益事業
NATWEST GROUP PLC	2,784	3,031	474	65,279	銀行
NEXT PLC	76	83	560	77,148	小売
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.653	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	261	289	674	92,812	小売
PEARSON PLC	447	475	303	41,794	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	183	201	583	80,350	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,492	1,647	2,106	290,082	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	408	449	3,026	416,728	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,117	1,221	2,170	298,867	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,075	1,176	606	83,503	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	645	707	3,334	459,093	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,013	1,237	121	16,784	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,405	2,590	3,176	437,305	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,147	2,335	2,761	380,213	エネルギー
RSA INSURANCE GROUP PLC	592	642	434	59,840	保険
SAGE GROUP PLC	624	686	466	64,248	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	1,013	1,106	245	33,810	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	70	78	232	32,051	各種金融
SEVERN TRENT PLC	137	152	374	51,509	公益事業
SMITH & NEPHEW PLC	504	551	798	109,965	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	226	252	386	53,183	資本財
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	42	46	537	74,020	資本財
SSE PLC	598	662	902	124,263	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC	313	339	367	50,645	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	1,566	1,681	737	101,563	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,353	1,451	392	53,991	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>(イギリス)</b>		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
TAYLOR WIMPEY PLC		1,902	2,300	385	53,057	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		5,640	6,204	1,464	201,699	食品・生活必需品小売り
TUI AG-DI		254	-	-	-	消費者サービス
UNILEVER PLC		639	738	3,297	453,942	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		393	436	400	55,106	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		15,472	16,981	2,064	284,309	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE		149	-	-	-	資本財
WHITBREAD PLC		76	126	387	53,318	消費者サービス
WPP PLC		731	781	578	79,698	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	172,799 93	181,055 84	94,627 -	13,028,336 <4.3%>	
<b>(イスラエル)</b>				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		24	27	525	16,321	不動産
BANK HAPOALIM BM		658	719	1,602	49,750	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		847	909	1,699	52,763	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		14	16	659	20,458	資本財
ICL GROUP LTD		403	440	609	18,931	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		670	730	820	25,472	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		84	91	662	20,578	銀行
NICE LTD		35	39	3,094	96,051	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,739 8	2,974 8	9,675 -	300,328 <0.1%>	
<b>(スイス)</b>				千スイス・フラン		
ABB LTD		1,062	1,165	2,861	326,450	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		88	98	513	58,552	商業・専門サービス
ALCON INC		239	310	1,782	203,391	ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG		27	29	466	53,197	保険
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		-	20	201	23,042	銀行
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	1	377	43,094	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.60	0.68	537	61,327	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.05	0.06	504	57,501	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		300	330	2,480	282,951	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		113	127	228	26,019	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		1,468	1,524	1,692	193,114	各種金融
DUFREY AG-REG		23	-	-	-	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		4	5	417	47,683	素材
GEBERIT AG-REG		21	23	1,299	148,308	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>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
GIVAUDAN-REG	5	5	2,129	242,927	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	129	142	703	80,221	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	34	660	75,397	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	283	329	1,527	174,221	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	-	102	769	87,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG	42	47	2,748	313,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	1,713	1,878	19,561	2,231,812	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	1,236	1,402	11,092	1,265,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR	22	-	-	-	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	11	1,117	127,545	各種金融
ROCHE HOLDING AG	404	443	13,553	1,546,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	13	341	39,011	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22	24	620	70,817	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	3	3	1,009	115,144	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER	73	89	2,112	240,975	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	31	34	771	88,034	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	5	6	685	78,159	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	15	17	399	45,604	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	19	20	809	92,318	保険
SWISS PRIME SITE-REG	45	50	426	48,608	不動産
SWISS RE AG	171	187	1,520	173,422	保険
SWISSCOM AG	15	16	805	91,936	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	37	42	475	54,281	ソフトウェア・サービス
THE SWATCH GROUP AG-REG	32	37	168	19,205	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG	2,221	2,312	3,029	345,592	各種金融
VIFOR PHARMA AG	26	28	357	40,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	86	95	3,478	396,891	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,052 39	11,017 39	84,238 -	9,610,722 <3.2%>
<b>(デンマーク)</b>			千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	3	4	4,713	78,006	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	2	2,209	36,562	運輸
AMBU A/S-B	-	102	2,044	33,840	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	61	65	6,160	101,949	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	60	66	4,322	71,531	素材
COLOPLAST-B	68	74	6,986	115,632	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	372	433	4,442	73,529	銀行

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(デンマーク)</b>		百株	百株	千円		
DEMANT A/S	62	67	1,460	24,171	ヘルスケア機器・サービス	
DSV PANALPINA A/S	123	131	13,232	219,003	運輸	
GENMAB A/S	37	41	9,368	155,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GN STORE NORD A/S	-	80	3,763	62,287	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	40	44	846	14,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S	91	-	-	-	商業・専門サービス	
NOVO-NORDISK A/S	1,017	1,086	45,825	758,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	122	130	4,846	80,207	素材	
ORSTED A/S	108	119	13,216	218,737	公益事業	
PANDORA A/S	57	62	3,841	63,581	耐久消費財・アパレル	
TRYGVESTA AS	71	78	1,410	23,349	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	108	124	14,824	245,352	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,410 17	2,716 18	143,517 -	2,375,212 <0.8%>	
<b>(ノルウェー)</b>				千ノルウェー・クローネ		
ADEVINTA ASA-B	-	152	2,046	23,590	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	62	-	-	-	エネルギー	
DNB ASA	548	601	9,446	108,915	銀行	
EQUINOR ASA	574	628	8,584	98,982	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	117	129	2,533	29,207	保険	
MOWI ASA	254	280	4,939	56,949	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	771	844	2,895	33,380	素材	
ORKLA ASA	437	477	4,109	47,387	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA-B SHS	58	63	1,941	22,383	メディア・娯楽	
TELENOR ASA	428	477	7,252	83,620	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	102	111	4,017	46,320	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,356 10	3,765 10	47,765 -	550,738 <0.2%>	
<b>(スウェーデン)</b>				千スウェーデン・クローナ		
ALFA LAVAL AB	180	199	4,082	49,311	資本財	
ASSA ABLOY AB	578	636	13,769	166,334	資本財	
ATLAS COPCO AB	222	245	9,474	114,455	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	386	425	18,760	226,624	資本財	
BOLIDEN AB	153	169	4,681	56,547	素材	
ELECTROLUX AB	130	144	2,967	35,851	耐久消費財・アパレル	
EPIROC AB-A	383	418	6,042	72,988	資本財	
EPIROC AB-B	222	246	3,396	41,029	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>(スウェーデン)</b>		百株	百株	千ユーロ/千円	
EQT AB	-	150	2,950	35,639	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	350	385	10,436	126,072	家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION GAMING GROUP	-	79	5,193	62,733	消費者サービス
HENNES & MAURITZ AB	463	507	8,775	106,009	小売
HEXAGON AB-B SHS	151	178	12,615	152,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS	237	265	2,429	29,354	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB	53	63	2,631	31,785	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89	98	2,551	30,817	各種金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	-	93	2,152	26,000	資本財
INVESTOR AB	261	284	17,037	205,807	各種金融
KINNEVIK AB - B	134	148	5,950	71,879	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	41	47	2,128	25,716	各種金融
LUNDIN ENERGY AB	109	116	2,423	29,281	エネルギー
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	57	-	-	-	電気通信サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	-	199	4,770	57,633	資本財
NORDEA BANK ABP	1,872	2,047	15,089	182,280	銀行
SANDVIK AB	646	712	13,338	161,134	資本財
SECURITAS AB	180	201	2,915	35,223	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	940	1,031	9,413	113,710	銀行
SKANSKA AB-B SHS	196	216	4,452	53,784	資本財
SKF AB	217	241	4,866	58,786	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB	-	379	5,101	61,624	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN	898	987	8,418	101,694	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	521	569	8,863	107,074	銀行
SWEDISH MATCH AB	97	102	7,268	87,801	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB	297	328	3,538	42,749	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	1,774	1,841	19,214	232,105	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	1,624	1,610	5,839	70,536	電気通信サービス
VOLVO AB	852	941	18,817	227,317	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,328 32	16,319 36	272,358 -	3,290,085 <1.1%>
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>			千ユーロ		
AIB GROUP PLC	454	-	-	-	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC	546	-	-	-	銀行
CRH PLC	454	493	1,639	202,245	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	45	97	1,380	170,268	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A	91	100	1,201	148,175	食品・飲料・タバコ

## 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	
KINGSPAN GROUP PLC		88	97	727	89,767	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		130	142	514	63,400	素材
小計	株数・金額	1,811	930	5,463	673,857	
	銘柄数<比率>	7	5	-	<0.2%>	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>						
ABN AMRO BANK NV		243	272	246	30,416	銀行
ADYEN NV		6	11	1,821	224,632	ソフトウェア・サービス
AEGON NV		1,015	1,113	333	41,073	保険
AIRBUS SE		336	372	3,323	409,912	資本財
AKZO NOBEL NV		117	122	1,063	131,138	素材
ALTICE NV - A-W/I		360	404	174	21,566	電気通信サービス
ASML HOLDING NV		245	268	9,556	1,178,714	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV		585	650	578	71,373	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		332	364	348	43,044	食品・飲料・タバコ
EXOR NV		61	68	387	47,850	各種金融
FERRARI NV		69	79	1,432	176,694	自動車・自動車部品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		630	691	894	110,284	自動車・自動車部品
GALAPAGOS NV		26	27	281	34,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEINEKEN HOLDING NV		66	73	582	71,840	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV		149	164	1,480	182,576	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA		2,235	2,462	1,894	233,711	銀行
JUST EAT TAKEAWAY		66	80	720	88,804	小売
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		632	694	1,632	201,352	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV		104	108	1,543	190,359	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV		520	576	2,514	310,105	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV		178	181	624	77,000	保険
PROSUS		280	307	2,701	333,193	小売
QIAGEN NV		130	144	576	71,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV		67	74	370	45,735	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV		2,125	2,313	599	73,984	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		393	402	1,223	150,930	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV		845	923	4,577	564,573	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		40	43	193	23,867	エネルギー
WOLTERS KLUWER NV		157	172	1,229	151,648	商業・専門サービス
小計	株数・金額	12,021	13,169	42,906	5,292,143	
	銘柄数<比率>	29	29	-	<1.8%>	



## 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	101	109	447	55,213	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	438	482	2,660	328,087	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	-	28	633	78,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	30	34	169	20,862	食品・生活必需品小売り
ELIA GROUP SA/NV	-	19	185	22,844	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	45	72	581	71,715	各種金融
KBC GROEP NV	142	157	893	110,199	銀行
PROXIMUS	90	100	173	21,408	電気通信サービス
SOFINA	-	9	236	29,116	各種金融
SOLVAY SA	42	47	421	51,958	素材
TELENET GROUP HOLDING NV	28	30	102	12,683	メディア・娯楽
UCB SA	72	79	724	89,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	113	123	441	54,508	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,106 10	1,293 13	7,670 -	946,031 <0.3%>
<b>(ユーロ/ルクセンブルグ)</b>					
ARCELORMITTAL	376	452	622	76,801	素材
TENARIS SA	261	283	177	21,888	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	637 2	736 2	800 -	98,689 <0.0%>
<b>(ユーロ/フランス)</b>					
ACCOR	99	120	354	43,763	消費者サービス
ADP	18	20	232	28,672	運輸
AIR LIQUIDE	272	299	4,153	512,231	素材
ALSTOM RGPT	110	121	530	65,429	資本財
ALSTOM SA - RIGHTS	-	121	52	6,467	資本財
AMUNDI SA	35	38	262	32,401	各種金融
ARKEMA	39	43	398	49,132	素材
ATOS SE	56	61	430	53,075	ソフトウェア・サービス
AXA SA	1,112	1,219	2,308	284,717	保険
BIOMERIEUX	23	26	311	38,378	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS	646	707	2,888	356,222	銀行
BOLLORE	550	585	198	24,537	メディア・娯楽
BOUYGUES	130	144	484	59,728	資本財
BUREAU VERITAS SA	171	189	405	50,001	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA	91	101	1,185	146,221	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	348	379	536	66,160	食品・生活必需品小売り

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	
CASINO GUICHARD PERRACHON	31	-	-	-	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN	283	327	1,290	159,201	資本財
CNP ASSURANCES	98	107	136	16,795	保険
CREDIT AGRICOLE SA	665	721	640	78,961	銀行
DANONE	355	390	2,064	254,593	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA	1	1	139	17,163	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA	75	83	1,305	160,963	ソフトウェア・サービス
EDENRED	141	155	705	86,982	ソフトウェア・サービス
EDF	351	395	470	58,013	公益事業
EIFFAGE	45	54	449	55,450	資本財
ENGIE	1,053	1,155	1,393	171,856	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	163	180	2,056	253,595	耐久消費財・アパレル
EURAZEO	23	25	133	16,486	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	6	83	605	74,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	103	-	-	-	メディア・娯楽
FAURECIA	43	48	195	24,072	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	270	293	425	52,486	運輸
HERMES INTERNATIONAL	18	20	1,698	209,492	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	8	9	165	20,438	電気通信サービス
INGENICO GROUP	35	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	21	23	198	24,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	51	56	110	13,685	メディア・娯楽
KERING	43	47	2,930	361,417	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	-	53	185	22,865	消費者サービス
LEGRAND SA	154	168	1,211	149,415	資本財
L'OREAL SA	144	158	4,939	609,243	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	159	175	8,577	1,057,981	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	98	106	1,143	141,093	自動車・自動車部品
NATIXIS	547	597	150	18,592	各種金融
ORANGE S.A.	1,164	1,277	1,326	163,612	電気通信サービス
ORPEA	-	33	352	43,502	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD	122	134	2,158	266,186	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	337	366	717	88,473	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	126	137	523	64,567	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12	14	217	26,838	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	111	123	384	47,468	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	188	202	2,434	300,281	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>(ユーロ/フランス)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
SANOFI	649	714	6,116	754,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15	17	533	65,827	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	318	349	4,145	511,284	資本財
SCOR REGROUPE	93	99	286	35,366	保険
SEB SA	12	14	210	25,943	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	466	508	823	101,581	銀行
SODEXO	51	55	392	48,356	消費者サービス
SUEZ	201	223	360	44,468	公益事業
TELEPERFORMANCE	34	37	1,029	126,977	商業・専門サービス
THALES SA	61	67	527	65,074	資本財
TOTAL SE	1,378	1,560	5,322	656,505	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	52	57	461	56,899	メディア・娯楽
VALEO SA	140	145	450	55,556	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	312	342	629	77,620	公益事業
VINCI SA	297	327	2,838	350,094	資本財
VIVENDI SA	481	524	1,337	164,954	メディア・娯楽
WENDEL	16	18	168	20,760	各種金融
WORLDLINE SA	73	86	640	78,968	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,426 68	17,062 68	82,444 -	10,168,723 <3.4%>
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>					
ADIDAS AG	103	120	3,391	418,252	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	239	263	5,124	632,030	保険
AROUNDTOWN SA	717	740	409	50,478	不動産
BASF SE	526	579	3,350	413,227	素材
BAYER AG	565	620	2,880	355,284	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	189	209	1,551	191,314	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	33	35	197	24,341	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	57	63	616	76,037	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	87	96	613	75,621	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	23	25	297	36,666	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG	567	622	307	37,906	銀行
CONTINENTAL AG	63	69	768	94,817	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	97	108	502	62,006	素材
DAIMLER AG	525	540	2,977	367,193	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE	65	81	811	100,080	小売
DEUTSCHE BANK AG	1,130	1,240	1,115	137,600	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	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE BOERSE AG	109	119	1,615	199,248	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	134	189	179	22,177	運輸
DEUTSCHE POST AG	575	628	2,458	303,292	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,934	2,113	3,138	387,060	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	208	216	920	113,523	不動産
E.ON SE	1,289	1,425	1,290	159,161	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	116	130	308	37,999	素材
FRAPORT AG	25	30	140	17,387	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	240	263	990	122,200	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	38	42	204	25,203	素材
GEA GROUP AG	89	96	275	33,970	資本財
HANNOVER RUECK SE	34	37	548	67,634	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	84	93	543	67,015	素材
HENKEL AG & CO KGAA	60	66	522	64,417	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	101	110	966	119,252	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	14	16	129	15,990	資本財
INFINEON TECHNOLOGIES AG	718	789	2,137	263,592	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	37	40	273	33,680	資本財
KNORR-BREMSE AG	28	30	327	40,425	資本財
LANXESS	46	51	278	34,306	素材
LEG IMMOBILIEN AG	-	43	517	63,841	不動産
MERCK KGAA	74	81	1,044	128,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG	104	114	92	11,407	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	30	33	657	81,057	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	82	88	2,082	256,901	保険
NEMETSCHKE SE	-	36	232	28,696	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	86	93	529	65,354	自動車・自動車部品
PUMA AG	48	52	442	54,563	耐久消費財・アパレル
RWE AG	334	404	1,377	169,920	公益事業
SAP SE	565	659	6,554	808,451	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	20	22	831	102,507	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 AG	-	67	436	53,777	メディア・娯楽
SIEMENS AG	440	482	5,302	654,059	資本財
SIEMENS ENERGY AG	-	241	584	72,047	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	86	94	350	43,216	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	74	81	852	105,126	素材
TEAMVIEWER AG	-	82	314	38,791	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>(ユーロ/ドイツ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		564	700	163	20,109	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		238	261	123	15,282	素材
UNIPER SE		115	127	357	44,078	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		59	67	221	27,302	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG		20	22	358	44,156	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		105	116	1,775	218,950	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		299	327	1,895	233,801	不動産
WIRECARD AG		67	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE		80	95	756	93,304	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,383 57	16,313 61	70,017 -	8,635,912 <2.9%>	
<b>(ユーロ/ポルトガル)</b>						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,476	1,765	785	96,893	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		287	313	276	34,067	エネルギー
JERONIMO MARTINS		142	154	215	26,598	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,906 3	2,233 3	1,277 -	157,559 <0.1%>	
<b>(ユーロ/スペイン)</b>						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		147	170	435	53,669	資本財
AENA SME SA		40	43	627	77,340	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		247	284	1,692	208,801	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		3,818	4,178	1,492	184,072	銀行
BANCO DE SABADELL SA		3,211	-	-	-	銀行
BANCO SANTANDER SA		9,532	10,489	2,437	300,677	銀行
BANCO SANTANDER SA - RIGHTS		-	10,489	104	12,937	銀行
BANKIA SA		689	-	-	-	銀行
BANKINTER SA		383	425	179	22,164	銀行
CAIXABANK		2,048	2,215	485	59,824	銀行
CELLNEX TELECOM SAU		146	201	1,045	128,896	電気通信サービス
ENAGAS SA		144	155	310	38,298	公益事業
ENDESA SA		183	201	498	61,480	公益事業
FERROVIAL S.A.		287	313	723	89,243	資本財
FERROVIAL SA-RTS		287	-	-	-	資本財
FERROVIAL SA-RTS		-	313	7	920	資本財
GRIFOLS SA		171	188	474	58,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		3,544	3,744	4,253	524,660	公益事業
INDITEX SA		627	685	1,849	228,163	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>(ユーロ/スペイン)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
MAPFRE SA		615	649	102	12,647	保険
NATURGY ENERGY GROUP SA		170	187	357	44,113	公益事業
RED ELECTRICA DE ESPANA		247	272	450	55,593	公益事業
REPSOL SA		817	941	729	89,956	エネルギー
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		137	150	415	51,215	資本財
TELEFONICA SA		2,715	3,105	1,075	132,676	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,219	39,409	19,749	2,435,866	
		23	22	-	<0.8%>	
<b>(ユーロ/イタリア)</b>						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		630	696	980	120,955	保険
ATLANTIA SPA		290	316	463	57,159	運輸
DIASORIN SPA		-	15	271	33,486	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA		4,689	5,136	4,193	517,253	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		1,455	1,598	1,291	159,281	エネルギー
FINECOBANK SPA		348	383	477	58,926	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		-	156	162	20,067	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO		8,588	10,386	1,925	237,515	銀行
LEONARDO SPA		229	245	139	17,216	資本財
MEDIOBANCA SPA		357	395	299	36,894	銀行
MONCLER SPA		103	121	495	61,067	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		-	237	363	44,868	ソフトウェア・サービス
PIRELLI & C SPA		233	252	105	13,066	自動車・自動車部品
POSTE ITALIANE SPA		312	347	302	37,355	保険
PRYSMIAN SPA		140	151	385	47,521	資本財
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		60	65	301	37,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA		1,183	1,282	599	73,931	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		8,564	8,642	311	38,373	電気通信サービス
TERNA SPA		814	892	563	69,555	公益事業
UNICREDIT SPA		1,148	1,336	1,122	138,490	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,152	32,663	14,757	1,820,161	
		17	20	-	<0.6%>	
<b>(ユーロ/フィンランド)</b>						
ELISA OYJ		83	91	415	51,285	電気通信サービス
FORTUM OYJ		257	280	493	60,845	公益事業
KONE OYJ		196	214	1,511	186,426	資本財
NELES OYJ		60	-	-	-	資本財
NESTE OYJ		242	266	1,433	176,837	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/フィンランド)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ		3,250	3,566	1,159	142,996	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		71	–	–	–	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		60	65	261	32,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		257	297	1,089	134,373	保険
STORA ENSO OYJ		326	363	496	61,267	素材
UPM-KYMMENE OYJ		303	336	891	109,965	素材
WARTSILA OYJ		254	284	221	27,360	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,363 12	5,768 10	7,974 –	983,573 <0.3%>	
<b>(ユーロ/オーストリア)</b>						
ANDRITZ AG		42	46	157	19,443	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		173	177	421	52,005	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		38	43	242	29,955	公益事業
OMV AG		83	89	253	31,284	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		84	92	146	18,063	銀行
VOESTALPINE AG		66	73	190	23,449	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	488 6	523 6	1,412 –	174,203 <0.1%>	
<b>(ユーロ/その他)</b>						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		122	134	957	118,049	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	122 1	134 1	957 –	118,049 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	112,639 235	130,238 240	255,430 –	31,504,773 <10.5%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	634,904 1,246	692,436 1,212	– –	285,514,371 <94.9%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	8	9	905	94,055
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	23	26	4,428	460,032
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	7	1,305	135,632
PROLOGIS INC	42	46	4,661	484,208
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	84	91	721	74,907
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	8	1,505	156,404
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	6	596	61,933
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	9	10	427	44,392
DUKE REALTY CORP	20	23	897	93,203
EQUITY RESIDENTIAL	21	23	1,402	145,656
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	4	1,040	108,138
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	4	408	42,440
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28	33	1,035	107,577
WELLTOWER INC	23	26	1,719	178,596
HOST HOTELS AND RESORTS INC	40	44	642	66,782
KIMCO REALTY CORP	24	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	7	902	93,794
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12	14	495	51,500
PUBLIC STORAGE	9	9	2,264	235,242
REGENCY CENTERS CORP	9	10	509	52,897
SIMON PROPERTY GROUP INC	17	19	1,557	161,754
SL GREEN REALTY CORP	4	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	5	6	866	90,059
UDR INC	16	18	722	75,036
VENTAS INC	21	23	1,143	118,826
VORNADO REALTY TRUST	9	10	407	42,350
WP CAREY INC	9	10	761	79,068
REALTY INCOME CORP	18	21	1,318	136,935
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9	10	661	68,702
EXTRA SPACE STORAGE INC	7	8	919	95,475
DIGITAL REALTY TRUST INC	12	16	2,423	251,730
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29	33	643	66,852
IRON MOUNTAIN INC	16	18	475	49,393
AGNC INVESTMENT CORP	32	36	548	56,997
AMERICAN TOWER REIT INC	25	28	6,677	693,655
EQUINIX INC	4	5	4,084	424,321
VEREIT	61	67	498	51,738
SBA COMMUNICATIONS CORP	6	7	2,099	218,065
INVITATION HOMES INC	31	34	963	100,054



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
		千口	千口	千米ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>					
VICI PROPERTIES INC		27	29	765	79,503
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	763 40	816 38	53,406 -	5,547,918 <1.8%>
<b>(カナダ)</b>				千カナダ・ドル	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		4	4	118	9,444
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		4	5	260	20,667
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		8	-	-	-
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	9	169	13,495
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		6	6	105	8,408
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	33 5	26 4	654 -	52,015 <0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		68	76	754	57,048
GPT GROUP		124	133	610	46,166
GOODMAN GROUP		98	107	2,010	152,014
STOCKLAND		147	155	700	52,950
MIRVAC GROUP		244	272	734	55,542
VICINITY CENTRES		213	259	434	32,866
SCENTRE GROUP		322	337	937	70,875
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,219 7	1,342 7	6,183 -	467,464 <0.2%>
<b>(香港)</b>				千香港ドル	
LINK REIT		120	131	9,104	121,993
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	120 1	131 1	9,104 -	121,993 <0.0%>
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		170	193	575	44,446
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		154	-	-	-
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		148	284	562	43,490
SUNTEC REIT		112	121	184	14,244
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		-	166	330	25,531
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		123	136	273	21,153
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	707 5	903 5	1,926 -	148,867 <0.0%>
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		50	56	268	37,019
LAND SECURITIES GROUP PLC		39	44	304	41,903
SEGRO PLC		61	74	680	93,723
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	152 3	175 3	1,253 -	172,646 <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	11	12	221	27,342
GECINA SA	2	2	367	45,330
COVIVIO	2	3	235	29,050
ICADE	1	2	129	16,030
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7	8	491	60,659
小計	口数・金額	26	29	1,446
	銘柄数<比率>	5	5	—
合計	口数・金額	3,023	3,424	—
	銘柄数<比率>	66	63	—

(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	6,173	—
国 FTSE 100	609	—
DJ EURO STOXX 50	1,535	—

(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

2020年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	285,514,371	94.4
投資信託証券	6,689,318	2.2
コール・ローン等、その他	10,407,347	3.4
投資信託財産総額	302,611,037	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103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1香港ドル13.40円、1シンガポール・ドル77.26円、1ニュージーランド・ドル71.77円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シケル31.04円、1スイス・フラン114.09円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1ユーロ123.34円です。

(注2) 外貨建純資産 (298,461,197千円) の投資信託財産総額 (302,611,037千円) に対する比率は98.6%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

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>306,891,719,190円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,040,961,296
株 式(評価額)	285,514,371,822
投 資 信 託 証 券(評価額)	6,689,318,591
未 収 入 金	4,823,966,528
未 収 配 当 金	314,895,056
差 入 委 託 証 拠 金	4,508,205,897
<b>(B)負債</b>	<b>5,967,885,625</b>
未 払 金	4,320,272,953
未 払 解 約 金	1,647,606,579
そ の 他 未 払 費 用	6,093
<b>(C)純 資 産 総 額(A-B)</b>	<b>300,923,833,565</b>
元 本	145,169,780,539
次 期 繰 越 損 益 金	155,754,053,026
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>145,169,780,539口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>20,729円</b>

- (注1) 期首元本額 131,943,832,341円  
 期中追加設定元本額 28,609,736,237円  
 期中一部解約元本額 15,383,788,039円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペ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) 854,059,755円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 3,771,468,504円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 2,859,153,135円  
 ニッセイ外国株式インデックスSA(適格機関投資家限定) 1,680,106,235円  
 ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定) 2,902,320円  
 ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定) 16,628,124円  
 ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) 20,292,993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) 11,039,104,952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  
 DCニッセイ外国株式インデックス 101,174,107,029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) 986,387,028円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 98,693,841円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 133,359,257円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 98,739,969円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 218,778,176円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 48,776,845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) 52,991,843円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) 5,819,342円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) 5,624,058円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) 1,588,705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) 18,159,475円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2060 26,453,761円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2050 20,935,466円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2040 70,913,550円  
 DCニッセイターゲットデートファンド2030 104,875,929円  
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定) 263,829,859円  
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定) 303,405,272円  
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット) 49,172,147円  
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定) 277,586,748円

### 損益の状況

当期(2020年5月21日~2020年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>2,153,865,118円</b>
受 取 配 当 金	2,153,302,624
受 取 利 息	66,915
そ の 他 収 益	1,586,085
支 払 利 息	△ 1,090,506
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>44,530,857,785</b>
売 買 損 益	55,265,769,048
売 買 損 益	△ 10,734,911,263
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>1,588,745,824</b>
取 引 損 益	1,859,740,408
取 引 損 益	△ 270,994,584
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 57,174,540</b>
<b>(E)当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>48,216,294,187</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>95,734,936,131</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>26,381,333,209</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 14,578,510,501</b>
<b>(I)合計(E+F+G+H)</b>	<b>155,754,053,026</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>155,754,053,026</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。