

第1期末（2015年11月20日）	
基準価額	10,528円
純資産総額	486百万円
騰落率	5.3%
分配金	0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）

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

交付運用報告書

作成対象期間：2015年8月27日～2015年11月20日

第1期（決算日 2015年11月20日）

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。

 <http://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

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・インデックスバランスファンド（4資産均等型）」は、このたび第1期の決算を行いました。

当ファンドは、基本投資割合に従った4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド）受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後とも是非ご継続頂き、いっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

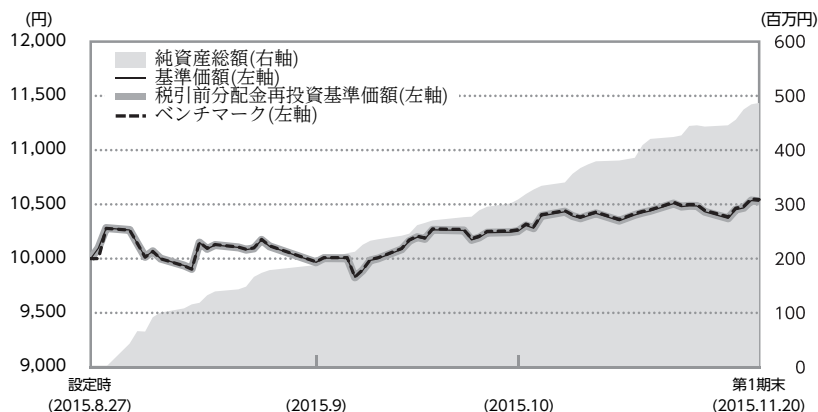
- 当ファンドは、投資信託約款において、運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めています。上記ホームページの「基準価額一覧」等から当ファンドのファンド名称を選択することにより、「商品ページ」において、運用報告書（全体版）をダウンロードすることができます。
- 運用報告書（全体版）は、受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

<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)

運用経過

(2015年8月27日から2015年11月20日まで)

基準価額等の推移



設定時	10,000円
第1期末	10,528円
既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	5.3%

- (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、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかにについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を25%ずつ組み合わせて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社が、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。以下同じです。

■基準価額の主な変動要因

設定時は、中国景気に対する懸念や米国の金融政策をめぐる不透明感等から、内外株式市場は不安定な動きが続きました。その後、中国市場の落ち着き、早期の米利上げ観測の後退、欧州の金融緩和期待などから景気後退懸念が縮小するにつれ、内外株式市場が上昇基調となったことを受けて、基準価額も上昇傾向で当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	25.0%	25.0%	9.3%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	25.0	24.9	0.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	25.0	25.0	11.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	25.0	0.7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

<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)

1 万口当たりの費用明細

項目	第 1 期		項目の概要
	2015年8月27日～2015年11月20日		
	金額	比率	
信託報酬	9円	0.086%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,227円です。
(投信会社)	(4)	(0.039)	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 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
(販売会社)	(4)	(0.039)	
(受託銀行)	(1)	(0.009)	
売買委託手数料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 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)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	2	0.019	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 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 ・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
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(2)	(0.016)	
合計	11	0.108	

(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を乗じたものです。

<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)

最近5年間の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化しています。

決算日		2015年8月27日	2015年11月20日
基準価額 (分配前)	(円)	10,000	10,528
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	0
税引前分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	5.3
ベンチマーク騰落率	(%)	—	5.4
純資産総額	(百万円)	1	486

(注1) 当ファンドの設定日は2015年8月27日です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

投資環境

■国内株式市況

設定時は、中国株式市場の変動や米利上げ時期に対する不透明感などを背景に、国内株式市場も乱高下する展開となりました。10月に入ると、日銀の追加金融緩和への期待や、欧州中央銀行（ECB）のドラギ総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどから、投資家のリスク回避姿勢が後退したため堅調に推移しました。その後も米国において、好調な雇用統計を受けた利上げ観測により円安が進行したことなどから、上昇基調のまま当期末を迎えました。

■国内債券市況

当期の10年国債金利は、軟調な株式市場や日銀の国債買い入れオペによる需給ひっ迫化などを受けて低下基調で始まりました。日銀の追加金融緩和見送りに伴う失望感から反発する場面もありましたが、需給の引き締まりが上昇を抑える要因となりました。10月以降も、米国における利上げ観測の後退を受けた長期金利の低下や、日銀の追加金融緩和観測から下落基調をたどりしました。その後は、早期の追加金融緩和観測が後退したものの、需給による下支え要因が根強く、もみ合い推移で当期末を迎えました。

■海外株式市況

設定時は、中国経済の成長に対する減速懸念が投資家のリスク回避姿勢を強め、海外株式市場は振れ幅の大きな展開となりました。10月初旬以降は、ECB総裁による金融緩和を示唆する発言や、中国人民銀行（中央銀行）による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場は上昇基調で当期末を迎えました。

<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)

■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、設定時、米利上げに対する警戒感から上昇する場面もありましたが、9月の米連邦公開市場委員会（FOMC）において新興国経済への懸念が指摘されたことで低下しました。その後は、米国において雇用統計が軟調であったことを受けた年内利上げ観測の後退が金利の低下要因となる一方、投資家のリスク選好姿勢の強まりが上昇要因となり、横ばい圏で推移しました。10月下旬から期末にかけては、年内の利上げ検討を表明したFOMCや米連邦準備制度理事会（FRB）のイエレン議長の議会証言を受け、利上げ観測が高まったことから金利は上昇し、結局、2.2%台で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、ECBの追加金融緩和観測の高まりなどから低下が進み、結局、0.4%台で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米・ドル／円レートは、前半は、米国において雇用統計が軟調であったことを受けた利上げ観測の後退が下落要因となる一方、中国の政策期待等による投資家のリスク選好姿勢の強まりが上昇要因となり、おおむね横ばい圏で推移しました。後半は、年内の利上げ検討を表明したFOMCやイエレンFRB議長の議会証言を受けた米利上げ観測の高まりなどから上昇し、結局、122円台後半で当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、前半は、ECBの追加金融緩和観測が下落要因となる一方、中国の政策期待等から投資家のリスク回避姿勢がいったん後退したことが上昇要因となり、上下する展開となりました。後半は、ドラギECB総裁の発言などから追加金融緩和観測が一段と強まったことで下落基調で推移し、結局、131円台後半で当期末を迎えました。

<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)

ポートフォリオ

■当ファンド

基本投資割合に従って4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド）受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

当期も東証一部上場銘柄のうち1,600銘柄程度に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場でのウェイトが大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。また資金の流出入などに対応するため、TOPIX先物も一部利用しました。

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

日本を除く世界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。

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

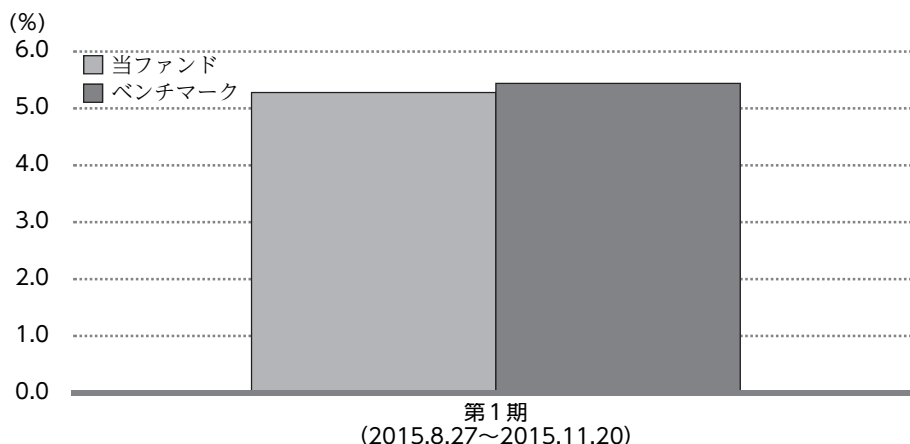
<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

<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)

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+5.3%となり、ベンチマーク騰落率(+5.4%)にほぼ連動しました。

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
	2015年8月27日 ～2015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	527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。

<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)

今後の運用方針

■当ファンド

基本投資割合に従って4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド）受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の証券取引所上場株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

クオンツモデルに基づき、N O M U R A - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<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)

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1期末
	2015年11月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	25.0%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	24.9
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	25.0
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	25.0

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

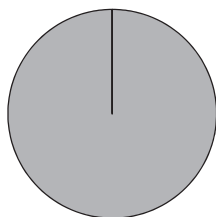
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

項目	第1期末
	2015年11月20日
純資産総額	486,839,871円
受益権総口数	462,426,178口
1万口当たり基準価額	10,528円

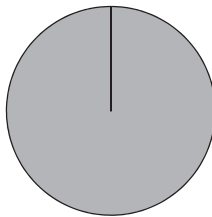
(注) 当期間中における追加設定元本額は490,620,345円、同解約元本額は29,194,167円です。

■資産別配分



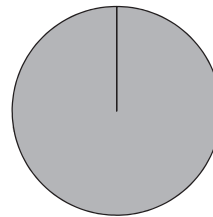
親投資信託受益証券
100.0%

■国別配分



日本
100.0%

■通貨別配分



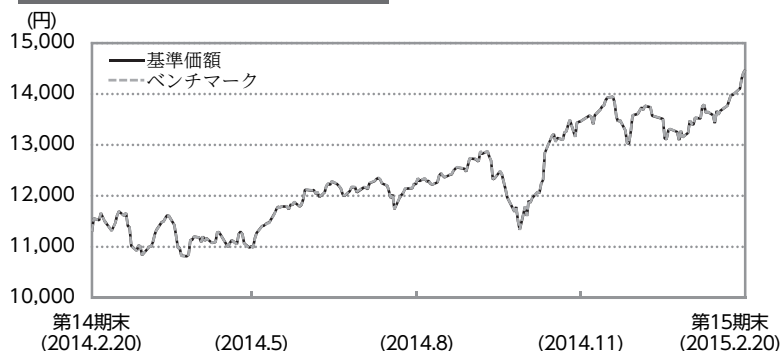
円
100.0%

(注) 資産別・国別・通貨別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

<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)

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



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

■上位銘柄

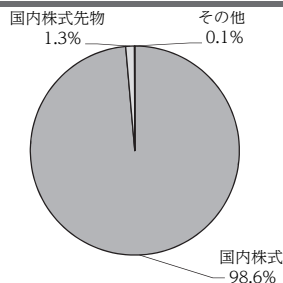
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	5.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.7
ソフトバンク	円	1.6
本田技研工業	円	1.6
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.6
みずほフィナンシャルグループ	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
KDDI	円	1.2
ファナック	円	1.1
武田薬品工業	円	1.1
組入銘柄数		1,625

■1万口当たりの費用明細

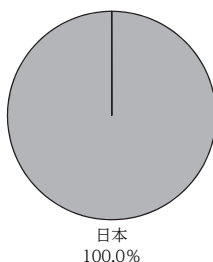
(2014.2.21~2015.2.20)

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

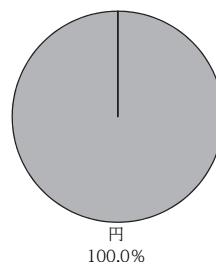
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分

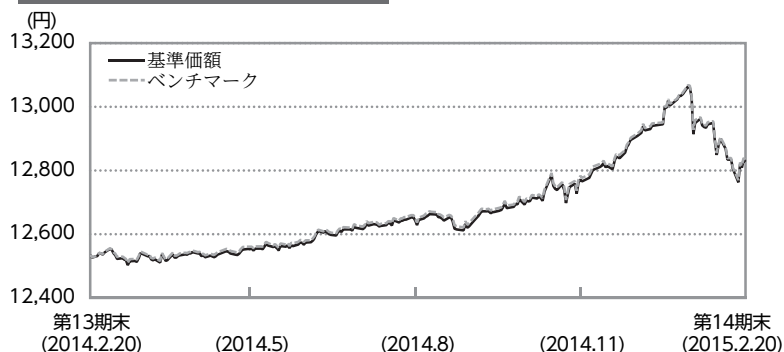


- (注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものです。費用項目については2ページの注記をご参照ください。
- (注2) 上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。
- (注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



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

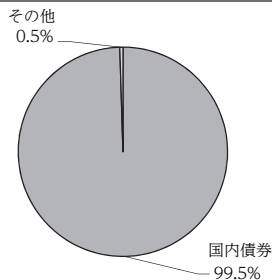
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
第26回 利付国債(30年)	円	7.7%
第117回 利付国債(20年)	円	7.5
第125回 利付国債(20年)	円	7.5
第292回 利付国債(10年)	円	7.5
第72回 利付国債(20年)	円	7.4
第107回 利付国債(5年)	円	6.6
第291回 利付国債(10年)	円	6.3
第96回 利付国債(5年)	円	6.1
第321回 利付国債(10年)	円	5.3
第338回 利付国債(2年)	円	4.4
組入銘柄数	30	

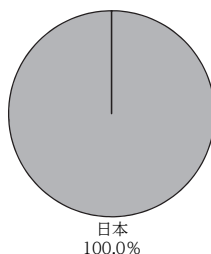
■1万口当たりの費用明細

当期(2014年2月21日～2015年2月20日)における費用はありません。

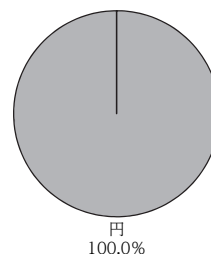
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

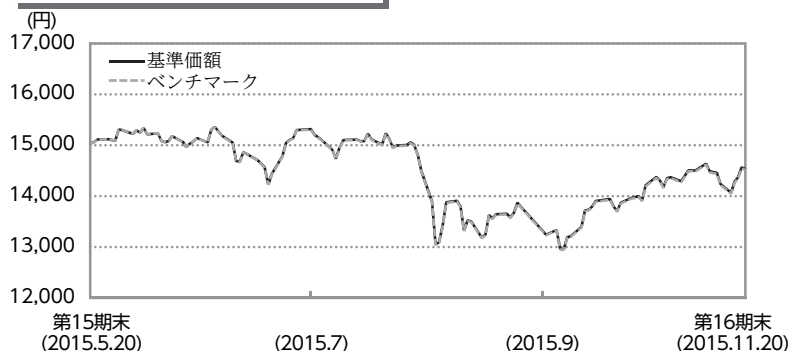
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



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

■上位銘柄

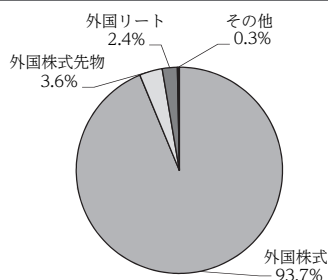
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米・ドル	2.2%
MICROSOFT CORP	米・ドル	1.3
EXXON MOBIL CORP	米・ドル	1.1
GENERAL ELECTRIC CO	米・ドル	1.0
JOHNSON & JOHNSON	米・ドル	0.9
WELLS FARGO & CO	米・ドル	0.9
AMAZON.COM INC	米・ドル	0.8
JPMORGAN CHASE & CO	米・ドル	0.8
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8
ALPHABET INC-CL C	米・ドル	0.7
組入銘柄数	1,315	

■1万口当たりの費用明細

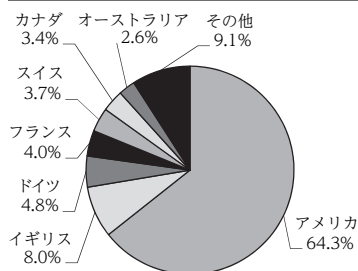
(2015.5.21~2015.11.20)

項目	金額
売買委託手数料	1円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	8
(その他)	(8)
合計	10

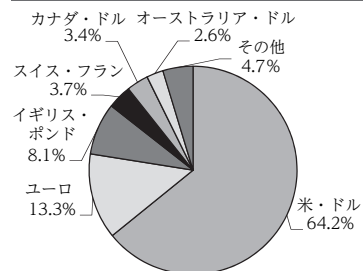
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

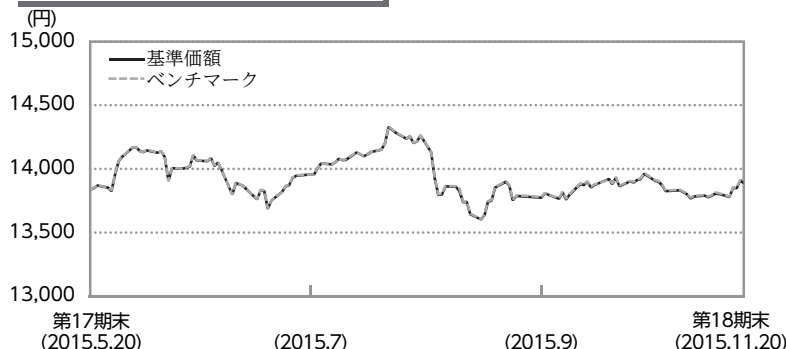
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



(注) ベンチマークはシティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLCは、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。

■上位銘柄

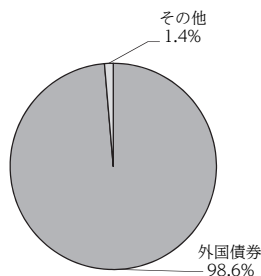
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY N/B 3.125% 2017/1/31	米・ドル	2.4%
US TREASURY N/B 1.25% 2019/10/31	米・ドル	1.1
US TREASURY N/B 0.875% 2017/10/15	米・ドル	0.9
US TREASURY N/B 0.625% 2017/8/31	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 2.375% 2017/7/31	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 3.5% 2018/2/15	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 4.5% 2017/5/15	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 1.625% 2019/12/31	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 0.75% 2017/3/15	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 2.625% 2020/11/15	米・ドル	0.7
組入銘柄数	521	

■1万口当たりの費用明細

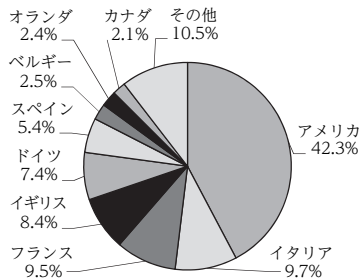
(2015.5.21～2015.11.20)

項目	金額
その他費用 (その他)	4円 (4)
合計	4

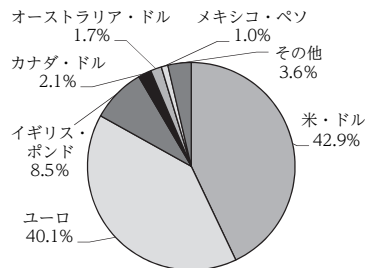
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

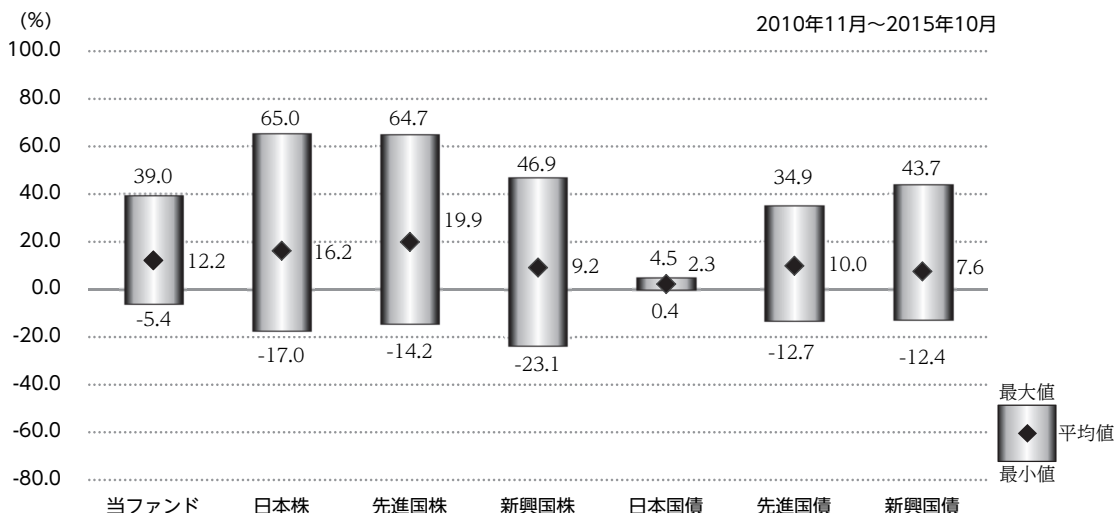
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

参考情報

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- (注1) 上記は、当ファンドの騰落率(税引前分配金再投資基準価額騰落率)と代表的な資産クラスの騰落率を比較したものであり、各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- (注2) 2010年11月～2015年10月の5年間における1年リターンの平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。
- (注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年分に満たないため、設定日以前のデータはファンドのベンチマークを用いて騰落率を算出しています。したがって、すべてがファンドの実績ではありません。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

- すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

- TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

<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)

お知らせ

■自社による当ファンドの設定解約状況

当 設 定 元 本	期 解 約 元 本	当期末残高			取引の理由
		元 本	評価額	比 率	
百万円 1	百万円 －	百万円 1	百万円 1	% 0.2	当初設定時における取得

(注) 元本および評価額の単位未満は切り捨てています。なお当社は自社による当ファンドの保有分を解約することがあります。

■関連会社の実質保有比率

2015年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の主要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32.2%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。

<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)

当ファンドの概要

商 品 分 類		追加型投信／内外／資産複合／インデックス型
信 託 期 間		無制限
運 用 方 針		下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
主要運用対象	<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)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	国内の証券取引所上場株式
	ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド	国内の公社債
	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	日本を除く世界主要先進国の株式
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	日本を除く世界主要先進国の国債
運用方法	<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)	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ25%ずつとします。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ国内債券 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。 ・投資対象資産は、本邦通貨建またはユーロ円建表示であるものに限ります。
	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国債券 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。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針		毎決算時に、原則として経費控除後の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。