

| 第2期末 (2017年2月20日) | |
|-------------------|--------|
| 基準価額 | 9,820円 |
| 純資産総額 | 63億円 |
| 騰落率 | 21.3% |
| 分配金 | 0円 |

<購入・換金手数料なし> ニッセイTOPIX インデックスファンド

追加型投信／国内／株式／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間：2016年2月23日～2017年2月20日

第2期 (決算日 2017年2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TOPIXインデックスファンド」は、このたび第2期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ国内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、実質的に国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。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。

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

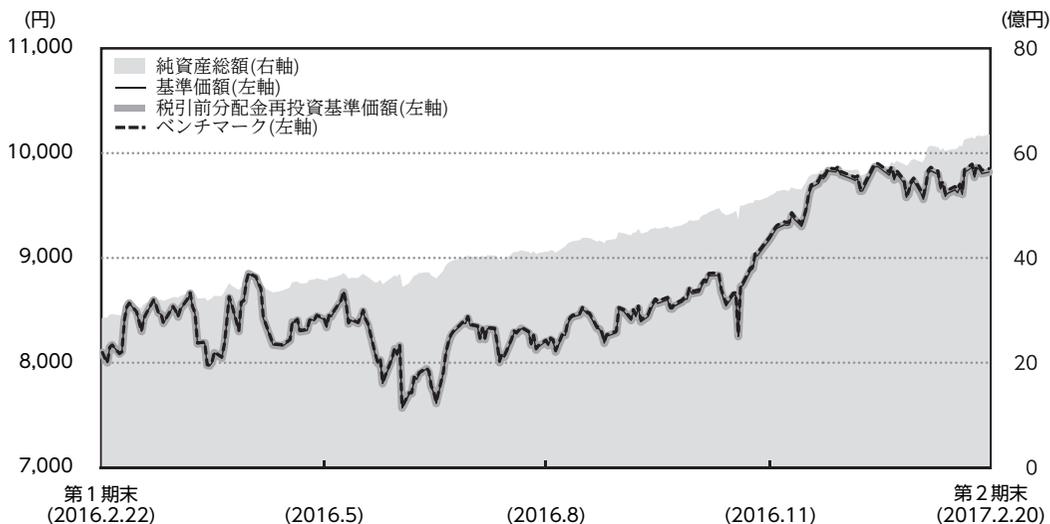
東京都千代田区丸の内1-6-6

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

運用経過

2016年2月23日～2017年2月20日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|--------|----------------|-------|
| 第2期首 | 8,098円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第2期末 | 9,820円 | 騰落率(分配金再投資ベース) | 21.3% |

- (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、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)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。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、投資家のリスク回避姿勢や為替市場の動向を背景に、株価が値動きの荒い展開となったことから一進一退の動きとなりました。6月には、Brexit(イギリスの欧州連合(EU)離脱)に関する国民投票結果を受けて円高が進行したことにより、株価が急落し基準価額は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、11月の米大統領選後には、米国の早期利上げ観測等を背景に株価が上昇したことから基準価額も上昇しました。年明け以降は、為替市場の変動等を背景に株価がもみ合う展開となったことから基準価額も同様の推移となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

1 万口当たりの費用明細

2016年2月23日～2017年2月20日

| 項目 | 第2期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 24円 | 0.277% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は8,684円です。 |
| (投信会社) | (11) | (0.124) | 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) | (11) | (0.124) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 |
| (受託会社) | (3) | (0.029) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | $\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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) | (0.002) | |
| その他費用 | 1 | 0.007 | $\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ |
| (監査費用) | (1) | (0.007) | 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) | (0) | (0.000) | ・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 | 25 | 0.286 | |

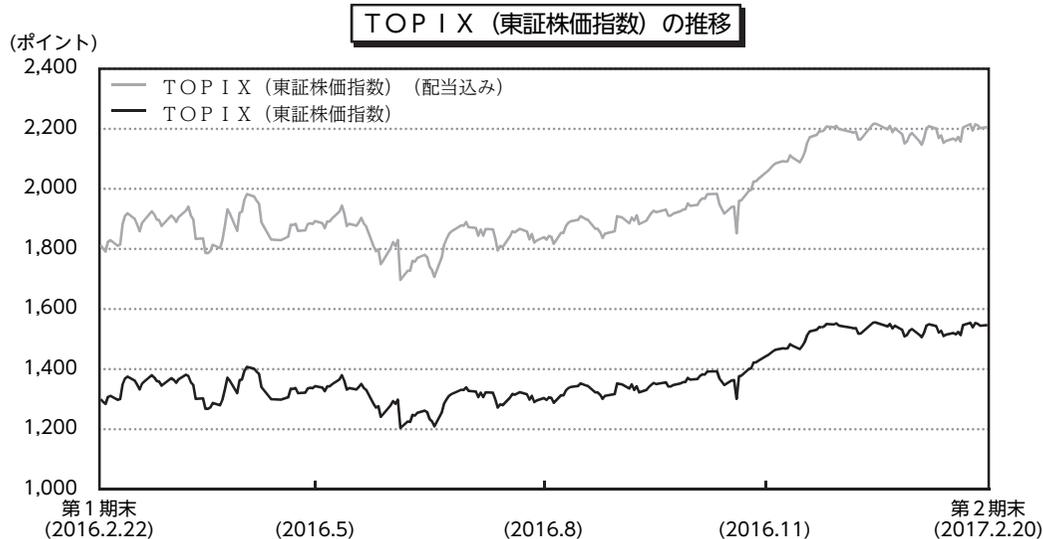
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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。

(注4) 当ファンドでは、信託報酬率の上限の引き下げを行いましたので、上記金額には引き下げ後の信託報酬率が加味されています。

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は、期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、投資家のリスク回避姿勢や、4月末に決定された日銀の追加緩和見送りなどを背景に株価は値動きの荒い展開となりましたが、その後は、徐々に落ち着きを取り戻しました。6月には、Brexitに関する国民投票結果を受けて円高が進行したことから株価は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、10月には、米国の年内利上げ観測を背景に円安となったことや、原油高等による影響から上昇しました。

11月には、米大統領選の結果を受けて株価は一時急落しましたが、米株式市場が上昇したことに加え、トランプ次期大統領の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、米連邦準備制度理事会 (FRB) の利上げ観測を受けて米長期金利が上昇し円安が進行したことから急反発しました。その後も、米国の利上げペースが加速するとの見方から上昇が続き、年明け以降は、為替市場の変動等を背景にもみ合う展開となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOP I Xインデックスファンド

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

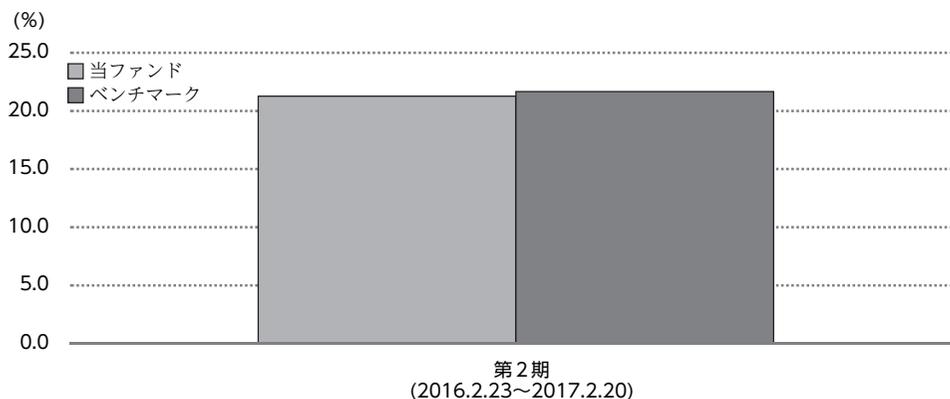
当期も東証一部上場銘柄のうち1,700銘柄程度に分散投資を行いました。

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（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流出入などに対応するため、TOP I X（東証株価指数）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。

ベンチマークとの差異



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+21.3%となり、ベンチマーク騰落率（+21.7%）にはほぼ連動しました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

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（1万円当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2016年2月23日 ～2017年2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 | 843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、実質的に国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

マザーファンド

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

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | | | (ご参考) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 | |
|---------------------|---------------|------------|-----------|----------------|---------------------|------------|------------|------------|-------|
| | | 税引前 分配金 | 期中 騰落率 | 基準価額+ 累計分配金 | ベンチマーク 期中 騰落率 | | | | |
| (設定日) 2015年4月27日 | 円 10,000 | 円 - | % - | 円 10,000 | 10,000 | % - | % - | 百万円 182 | |
| 1期(2016年2月22日) | 8,098 | 0 | △19.0 | 8,098 | 8,120 | △18.8 | 98.3 | 1.7 | 2,843 |
| 2期(2017年2月20日) | 9,820 | 0 | 21.3 | 9,820 | 9,879 | 21.7 | 97.7 | 2.3 | 6,347 |

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(配当込み)としており、設定時を10,000として指数化しています。なおTOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

(注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」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注7) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 |
|--------------------|------------|--------|--------|--------|------------|------------|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期首) 2016年2月22日 | 円 8,098 | % - | 8,120 | % - | % 98.3 | % 1.7 |
| 2月末 | 8,085 | △0.2 | 8,109 | △0.1 | 97.8 | 2.1 |
| 3月末 | 8,469 | 4.6 | 8,501 | 4.7 | 93.8 | 2.5 |
| 4月末 | 8,424 | 4.0 | 8,459 | 4.2 | 97.7 | 2.3 |
| 5月末 | 8,673 | 7.1 | 8,707 | 7.2 | 97.2 | 2.8 |
| 6月末 | 7,841 | △3.2 | 7,872 | △3.1 | 97.4 | 3.7 |
| 7月末 | 8,324 | 2.8 | 8,359 | 2.9 | 98.4 | 1.6 |
| 8月末 | 8,367 | 3.3 | 8,405 | 3.5 | 98.2 | 1.8 |
| 9月末 | 8,390 | 3.6 | 8,434 | 3.9 | 97.9 | 2.2 |
| 10月末 | 8,833 | 9.1 | 8,882 | 9.4 | 97.5 | 2.7 |
| 11月末 | 9,318 | 15.1 | 9,369 | 15.4 | 97.8 | 1.9 |
| 12月末 | 9,639 | 19.0 | 9,695 | 19.4 | 99.2 | 0.9 |
| 2017年1月末 | 9,658 | 19.3 | 9,716 | 19.6 | 98.1 | 1.7 |
| (期末) 2017年2月20日 | 9,820 | 21.3 | 9,879 | 21.7 | 97.7 | 2.3 |

(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。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2016年2月23日～2017年2月20日)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-----------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 4,219,973 | 5,884,933 | 2,361,015 | 3,340,177 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-----------------------|
| | ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 7,751,597千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 35,357,629千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 0.21 |

(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) 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

(2016年2月23日～2017年2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

(2017年2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 |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 2,224,600 | 4,083,558 | 6,347,482 |

(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国内株式インデックスマザーファンド全体の口数は26,374,834千口です。

◆投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 6,347,482 | 99.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 38,807 | 0.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 6,386,290 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年2月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------------|----------------|
| (A)資 産 | 6,386,290,387円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 6,225,730 |
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額) | 6,347,482,695 |
| 未 収 入 金 | 32,581,962 |
| (B)負 債 | 38,910,967 |
| 未 払 解 約 金 | 32,478,615 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 6,271,103 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 161,249 |
| (C)純 資 産 総 額 (A-B) | 6,347,379,420 |
| 元 本 | 6,464,017,336 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 116,637,916 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 6,464,017,336口 |
| 1万口当たり基準価額 (C/D) | 9,820円 |

- (注1) 期首元本額 3,511,316,929円
 期中追加設定元本額 6,672,478,056円
 期中一部解約元本額 3,719,777,649円
- (注2) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は
 116,637,916円です。

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日～2017年2月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|-----------------|
| (A)配 当 等 収 益 | △ 1,238円 |
| 受 取 利 息 | 461 |
| 支 払 利 息 | △ 1,699 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 717,488,868 |
| 売 買 益 | 936,806,700 |
| 売 買 損 | △ 219,317,832 |
| (C)信 託 報 酬 等 | △ 12,065,628 |
| (D)当 期 損 益 金 (A + B + C) | 705,422,002 |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金 | △ 193,687,251 |
| (分 配 準 備 積 立 金) | (6,452,958) |
| (繰 越 欠 損 金) | (△ 200,140,209) |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金 * | △ 628,372,667 |
| (配 当 等 相 当 額) | (26,473,679) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 654,846,346) |
| (G)合 計 (D + E + F) | △ 116,637,916 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | △ 116,637,916 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 628,372,667 |
| (配 当 等 相 当 額) | (33,213,741) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 661,586,408) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 511,734,751 |

- (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 | 85,598,635円 |
| (b)経費控除後の有価証券売買等損益 | 419,683,158円 |
| (c)信託約款に定める収益調整金 | 33,213,741円 |
| (d)信託約款に定める分配準備積立金 | 6,452,958円 |
| (e)分配対象額 (a + b + c + d) | 544,948,492円 |
| (f)分配対象額 (1万口当たり) | 843.05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

代表取締役社長に赤林富二が就任いたしました。 (2016年4月1日)

約款変更

信託報酬率の上限を引き下げたことに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
(2016年11月18日)

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

当ファンドの概要

| | | |
|---------|---|--|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／国内／株式／インデックス型 | |
| 信 託 期 間 | 無期限 | |
| 運 用 方 針 | ニッセイ国内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、実質的に国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | ＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイTOPIX インデックスファンド | ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド受益証券 |
| | ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド | 国内の金融商品取引所上場株式等 |
| 運 用 方 法 | ＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイTOPIX 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。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |
| | 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。 |
| 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。 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

運用報告書



第17期

(計算期間：2016年2月23日～2017年2月20日)

●受益者の皆様へ

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。 株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。 |
| 主要運用対象 | 国内の金融商品取引所上場株式等 |
| 運用方法 | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |

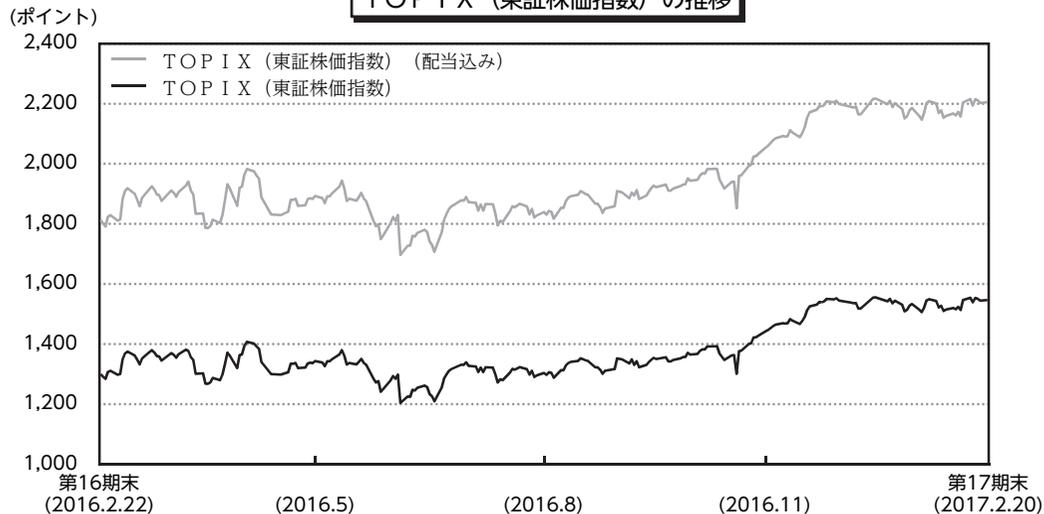


ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

国内株式市況

TOPIX (東証株価指数) 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。

当期の国内株式市場は、期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、投資家のリスク回避姿勢や、4月末に決定された日銀の追加緩和見送りなどを背景に株価は値動きの荒い展開となりましたが、その後は、徐々に落ち着きを取り戻しました。6月には、Brexitに関する国民投票結果を受けて円高が進行したことから株価は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、10月には、米国の年内利上げ観測を背景に円安となったことや、原油高等による影響から上昇しました。

11月には、米大統領選の結果を受けて株価は一時急落しましたが、米株式市場が上昇したことに加え、トランプ次期大統領の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、米連邦準備制度理事会 (FRB) の利上げ観測を受けて米長期金利が上昇し円安が進行したことから急反発しました。その後も、米国の利上げペースが加速するとの見方から上昇が続き、年明け以降は、為替市場の変動等を背景にもみ合う展開となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、投資家のリスク回避姿勢や為替市場の動向を背景に、株価が値動きの荒い展開となったことから一進一退の動きとなりました。6月には、Brexit（イギリスの欧州連合（EU）離脱）に関する国民投票結果を受けて円高が進行したことにより、株価が急落し基準価額は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、11月の米大統領選後には、米国の早期利上げ観測等を背景に株価が上昇したことから基準価額も上昇しました。年明け以降は、為替市場の変動等を背景に株価がもみ合う展開となったことから基準価額も同様の推移となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄のうち1,700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（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+21.6%となり、ベンチマーク騰落率（+21.7%）に連動しました。

今後の運用方針

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中騰落率 | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|
| | | | | | | | |
| | 円 | % | | | % | % | 百万円 |
| 13期(2013年2月20日) | 9,039 | 21.7 | 9,115 | 21.8 | 98.4 | 1.1 | 35,007 |
| 14期(2014年2月20日) | 11,293 | 24.9 | 11,401 | 25.1 | 98.6 | 1.4 | 31,810 |
| 15期(2015年2月20日) | 14,473 | 28.2 | 14,609 | 28.1 | 98.6 | 1.3 | 42,826 |
| 16期(2016年2月22日) | 12,782 | △11.7 | 12,904 | △11.7 | 98.3 | 1.7 | 34,137 |
| 17期(2017年2月20日) | 15,544 | 21.6 | 15,699 | 21.7 | 97.7 | 2.3 | 40,998 |

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

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|------------|--------|------|--------|------|--------|--------|
| | | | | | | |
| (期首) | 円 | % | | | % | % |
| 2016年2月22日 | 12,782 | - | 12,904 | - | 98.3 | 1.7 |
| 2月末 | 12,763 | △0.1 | 12,886 | △0.1 | 97.8 | 2.1 |
| 3月末 | 13,373 | 4.6 | 13,508 | 4.7 | 93.8 | 2.5 |
| 4月末 | 13,304 | 4.1 | 13,442 | 4.2 | 97.7 | 2.3 |
| 5月末 | 13,701 | 7.2 | 13,836 | 7.2 | 97.2 | 2.8 |
| 6月末 | 12,390 | △3.1 | 12,510 | △3.1 | 97.4 | 3.7 |
| 7月末 | 13,157 | 2.9 | 13,283 | 2.9 | 98.4 | 1.6 |
| 8月末 | 13,229 | 3.5 | 13,356 | 3.5 | 98.2 | 1.8 |
| 9月末 | 13,269 | 3.8 | 13,402 | 3.9 | 97.9 | 2.2 |
| 10月末 | 13,973 | 9.3 | 14,114 | 9.4 | 97.5 | 2.7 |
| 11月末 | 14,743 | 15.3 | 14,889 | 15.4 | 97.8 | 1.9 |
| 12月末 | 15,254 | 19.3 | 15,406 | 19.4 | 99.2 | 0.9 |
| 2017年1月末 | 15,286 | 19.6 | 15,439 | 19.6 | 98.1 | 1.7 |
| (期末) | | | | | | |
| 2017年2月20日 | 15,544 | 21.6 | 15,699 | 21.7 | 97.7 | 2.3 |

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆1万口当たりの費用明細

(2016年2月23日～2017年2月20日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------------------------|------------------|------------------------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) | 0円 (0) (0) | 0.002% (0.000) (0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| その他費用 (その他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・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 | 0 | 0.002 | |

(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（13,729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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-----|-------------------|-----------|-------|-----------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上 場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 3,526 (△2,072) | 3,801,023 | 3,608 | 3,950,574 |

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|-------------|-------|-------|-------|-------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 | 株 式 先 物 取 引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 内 | | 7,842 | 7,603 | — | — |

(注) 単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆主要な売買銘柄

(2016年2月23日～2017年2月20日)

| 株 式 | | | | | | | |
|-------------------|-----|---------|-------|-------------------|-----|---------|-------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| トヨタ自動車 | 18 | 103,889 | 5,526 | ソフトバンクグループ | 27 | 176,408 | 6,533 |
| 日本電信電話 | 17 | 83,967 | 4,798 | トヨタ自動車 | 25 | 161,389 | 6,327 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 117 | 55,401 | 471 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 171 | 97,945 | 570 |
| ソフトバンクグループ | 8 | 50,192 | 6,047 | 日本たばこ産業 | 15 | 64,702 | 4,174 |
| 東日本旅客鉄道 | 4 | 45,106 | 9,397 | 日産自動車 | 52 | 55,171 | 1,044 |
| 日本たばこ産業 | 10 | 42,375 | 4,195 | みずほフィナンシャルグループ | 299 | 53,763 | 179 |
| 九州旅客鉄道 | 13 | 40,581 | 3,006 | アステラス製薬 | 31 | 50,371 | 1,584 |
| 本田技研工業 | 14 | 40,145 | 2,787 | 日本電信電話 | 10 | 48,644 | 4,864 |
| みずほフィナンシャルグループ | 252 | 39,770 | 157 | 武田薬品工業 | 9 | 45,117 | 4,851 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 12 | 39,747 | 3,129 | 東京エレクトロン | 5 | 43,407 | 8,511 |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

◆組入有価証券明細表

(2017年2月20日現在)

(1) 国内株式 上場株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業(0.1%) | | | | |
| 極洋 | 8 | 0.800 | 2,280 | |
| 日本水産 | 22 | 25 | 14,499 | |
| マルハニチロ | 4 | 3 | 12,483 | |
| カネコ種苗 | - | 0.800 | 1,148 | |
| サカタのタネ | 2 | 2 | 9,236 | |
| ホクト | 2 | 2 | 4,272 | |
| 鉱業(0.3%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 6 | 2 | 287 | |
| 日鉄鉱業 | 5 | 0.600 | 3,618 | |
| 三井松島産業 | 13 | 1 | 1,812 | |
| 国際石油開発帝石 | 103 | 104 | 117,218 | |
| 日本海洋掘削 | 0.600 | 0.700 | 1,689 | |
| 石油資源開発 | 3 | 3 | 8,656 | |
| K&Oエナジーグループ | 1 | 1 | 2,295 | |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|--------|-----|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 建設業(2.9%) | | | | |
| ショーボンドホールディングス | 2 | 2 | 10,500 | |
| ミライト・ホールディングス | 6 | 6 | 6,528 | |
| サンヨーホームズ | - | 1 | 1,261 | |
| ダイセキ環境ソリューション | - | 0.800 | 1,272 | |
| 安藤・間 | 13 | 14 | 12,155 | |
| 東急建設 | 6 | 7 | 5,928 | |
| コムシスホールディングス | 8 | 7 | 15,795 | |
| ミサワホーム | 2 | 2 | 2,529 | |
| 高松コンストラクショングループ | 1 | 1 | 3,972 | |
| 東建コーポレーション | 0.800 | 0.800 | 6,416 | |
| ヤマウラ | - | 2 | 1,276 | |
| 大成建設 | 102 | 101 | 81,406 | |
| 大林組 | 58 | 59 | 63,580 | |
| 清水建設 | 60 | 61 | 63,562 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------|---------|-----|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 飛鳥建設 | 14 | 19 | | 3,360 |
| 長谷工コーポレーション | 22 | 23 | | 29,881 |
| 松井建設 | 2 | 2 | | 2,336 |
| 銭高組 | 3 | 3 | | 1,284 |
| 鹿島建設 | 92 | 87 | | 64,467 |
| 不動テトラ | 13 | 16 | | 3,268 |
| 鉄建建設 | 12 | 12 | | 4,044 |
| 西松建設 | 23 | 23 | | 13,455 |
| 三井住友建設 | 75 | 76 | | 9,384 |
| 大豊建設 | 8 | 7 | | 3,682 |
| 前田建設工業 | 12 | 12 | | 12,024 |
| 佐田建設 | 2 | 2 | | 1,184 |
| ナカノフドー建設 | 1 | - | | - |
| 奥村組 | 19 | 16 | | 11,296 |
| 東鉄工業 | 2 | 2 | | 7,548 |
| イチケン | 3 | - | | - |
| 浅沼組 | 6 | 7 | | 2,513 |
| 戸田建設 | 23 | 23 | | 15,364 |
| 熊谷組 | 29 | 31 | | 9,889 |
| 青木あすなろ建設 | 1 | 1 | | 1,230 |
| 北野建設 | 4 | 4 | | 1,280 |
| 植木組 | 4 | 5 | | 1,315 |
| 三井ホーム | 3 | 3 | | 1,728 |
| 矢作建設工業 | 2 | 2 | | 2,837 |
| ピーエス三菱 | 2 | 3 | | 1,292 |
| 日本ハウスホールディングス | 4 | 4 | | 2,119 |
| 大東建託 | 7 | 7 | | 115,157 |
| 新日本建設 | 2 | 2 | | 2,229 |
| N I P P O | 5 | 5 | | 10,880 |
| 東亜道路工業 | 4 | 4 | | 1,380 |
| 前田道路 | 6 | 6 | | 12,072 |
| 日本道路 | 6 | 6 | | 2,886 |
| 東亜建設工業 | 17 | 1 | | 3,126 |
| 若築建設 | 11 | 11 | | 1,672 |
| 東洋建設 | 6 | 5 | | 2,416 |
| 五洋建設 | 21 | 22 | | 11,403 |
| 大林道路 | 2 | 2 | | 1,440 |
| 世紀東急工業 | 3 | 2 | | 1,496 |
| 福田組 | 3 | 3 | | 3,132 |
| 住友林業 | 13 | 13 | | 22,015 |
| 日本基礎技術 | 2 | 3 | | 1,270 |
| 日成ビルド工業 | 5 | 6 | | 3,306 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 15 | - | | - |
| 巴コーポレーション | - | 3 | | 1,217 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| パナホーム | 7 | 7 | | 7,399 |
| 大和ハウス工業 | 57 | 58 | | 182,809 |
| ライト工業 | 3 | 3 | | 4,392 |
| 積水ハウス | 65 | 62 | | 112,554 |
| 日特建設 | 2 | 2 | | 1,149 |
| 北陸電気工事 | 1 | 1 | | 1,150 |
| ユアテック | 3 | 3 | | 2,412 |
| 西部電気工業 | - | 0.500 | | 1,147 |
| 四電工 | - | 3 | | 1,275 |
| 中電工 | 2 | 2 | | 5,917 |
| 関電工 | 8 | 8 | | 7,400 |
| きんでん | 11 | 13 | | 19,602 |
| 東京エネシス | 2 | 2 | | 1,902 |
| トーエネック | 3 | 3 | | 1,677 |
| 住友電設 | 1 | 1 | | 1,789 |
| 日本電設工業 | 3 | 3 | | 6,371 |
| 協和エクシオ | 7 | 7 | | 12,417 |
| 新日本空調 | 1 | 1 | | 2,062 |
| ND S | 3 | 0.400 | | 1,168 |
| 九電工 | 4 | 3 | | 11,497 |
| 三機工業 | 4 | 4 | | 4,408 |
| 日揮 | 20 | 18 | | 38,185 |
| 中外炉工業 | 6 | 6 | | 1,440 |
| 太平電業 | 3 | 3 | | 3,156 |
| 高砂熱学工業 | 5 | 5 | | 9,069 |
| 朝日工業社 | 2 | 0.500 | | 1,517 |
| 明星工業 | 3 | 3 | | 2,206 |
| 大気社 | 2 | 2 | | 7,516 |
| ダイダシ | 3 | 3 | | 2,883 |
| 日比谷総合設備 | 2 | 2 | | 3,786 |
| 東芝プラントシステム | 3 | 3 | | 5,155 |
| OS J Bホールディングス | 3 | 6 | | 1,531 |
| 東洋エンジニアリング | 10 | 12 | | 3,240 |
| 千代田化工建設 | 14 | 14 | | 10,080 |
| 新興プランテック | 4 | 4 | | 3,817 |
| 食料品(4.4%) | | | | |
| 日本製粉 | 13 | 5 | | 10,000 |
| 日清製粉グループ本社 | 21 | 21 | | 36,733 |
| 昭和産業 | 8 | 8 | | 4,872 |
| 鳥越製粉 | 1 | 1 | | 1,294 |
| 中部飼料 | 1 | 2 | | 2,538 |
| フィード・ワン | 11 | 12 | | 2,160 |
| 東洋精糖 | 10 | - | | - |
| 日本甜菜製糖 | 10 | 1 | | 2,461 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 三井製糖 | 8 | 1 | 3,721 | |
| 塩水港精糖 | 4 | 4 | 1,228 | |
| 日新製糖 | 0.300 | 0.800 | 1,468 | |
| 森永製菓 | 18 | 3 | 18,369 | |
| 中村屋 | 5 | 0.500 | 2,565 | |
| 江崎グリコ | 4 | 5 | 26,500 | |
| 名糖産業 | 0.900 | - | - | |
| 不二家 | 11 | 11 | 2,453 | |
| 山崎製パン | 14 | 14 | 32,470 | |
| モロゾフ | 3 | 3 | 1,524 | |
| 亀田製菓 | 1 | 1 | 5,461 | |
| 寿スピリッツ | 0.500 | 1 | 3,631 | |
| カルビー | 7 | 8 | 30,375 | |
| 森永乳業 | 18 | 18 | 13,320 | |
| 六甲バター | 0.900 | 0.900 | 2,205 | |
| ヤクルト本社 | 10 | 10 | 67,089 | |
| 明治ホールディングス | 11 | 11 | 102,306 | |
| 雪印メグミルク | 4 | 4 | 12,672 | |
| プリマハム | 12 | 13 | 5,837 | |
| 日本ハム | 14 | 14 | 42,910 | |
| 伊藤ハム | 9 | - | - | |
| 林兼産業 | 11 | 1 | 1,227 | |
| 丸大食品 | 10 | 10 | 4,970 | |
| 米久 | 0.600 | - | - | |
| S Foods | 1 | 1 | 3,564 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | - | 11 | 12,581 | |
| サッポロホールディングス | 30 | 6 | 18,531 | |
| アサヒグループホールディングス | 36 | 37 | 153,303 | |
| キリンホールディングス | 79 | 85 | 163,558 | |
| 宝ホールディングス | 14 | 14 | 15,969 | |
| オエノンホールディングス | 5 | 5 | 1,325 | |
| 養命酒製造 | 0.600 | 0.600 | 1,122 | |
| コカ・コーラウエスト | 6 | 6 | 21,205 | |
| コカ・コーライーストジャパン | 6 | 7 | 18,148 | |
| サントリー食品インターナショナル | 13 | 13 | 63,240 | |
| ダイドーグループホールディングス | 1 | 0.900 | 5,076 | |
| 伊藤園 | 5 | 5 | 21,859 | |
| キーコーヒー | 1 | 1 | 3,954 | |
| ユニカフェ | 0.600 | 1 | 1,268 | |
| 日清オイリオグループ | 10 | 11 | 6,380 | |
| 不二製油グループ本社 | 5 | 5 | 12,820 | |
| J-オイルミルズ | 8 | 0.900 | 3,690 | |
| キッコーマン | 15 | 14 | 47,530 | |
| 味の素 | 42 | 41 | 95,099 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| キュービー | 10 | 10 | 29,714 | |
| ハウス食品グループ本社 | 6 | 7 | 17,700 | |
| カゴメ | 7 | 7 | 20,433 | |
| 焼津水産化学工業 | 1 | - | - | |
| アリアケジャパン | 1 | 1 | 9,984 | |
| ピエトロ | - | 0.700 | 1,158 | |
| エバラ食品工業 | 0.500 | 0.600 | 1,259 | |
| ニチレイ | 21 | 9 | 25,137 | |
| 東洋水産 | 9 | 9 | 39,004 | |
| 日清食品ホールディングス | 8 | 7 | 47,892 | |
| 永谷園ホールディングス | 2 | 2 | 2,850 | |
| 一正蒲鉾 | 1 | 1 | 1,300 | |
| フジッコ | 1 | 1 | 4,655 | |
| ロック・フィールド | 1 | 2 | 3,549 | |
| 日本たばこ産業 | 115 | 110 | 416,272 | |
| ケンコーマヨネーズ | 0.600 | 0.700 | 1,897 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 1 | 1 | 3,063 | |
| なとり | 1 | 1 | 1,865 | |
| ユーグレナ | 6 | 6 | 7,936 | |
| ミヨシ油脂 | 8 | 8 | 1,136 | |
| 理研ビタミン | 0.600 | 0.600 | 2,604 | |
| 繊維製品(0.7%) | | | | |
| 片倉工業 | 2 | 2 | 3,475 | |
| ゲンゼ | 15 | 14 | 5,908 | |
| 東洋紡 | 72 | 74 | 14,578 | |
| ユニチカ | 53 | 51 | 4,590 | |
| 富士紡ホールディングス | 9 | 0.900 | 3,028 | |
| 倉敷紡績 | 19 | 19 | 4,503 | |
| シキボウ | 11 | 10 | 1,530 | |
| 日本毛織 | 6 | 5 | 4,706 | |
| ダイドーリミテッド | 2 | - | - | |
| 帝国繊維 | 1 | 1 | 3,228 | |
| 帝人 | 75 | 15 | 32,816 | |
| 東レ | 133 | 135 | 131,287 | |
| 住江織物 | 5 | 5 | 1,455 | |
| 日本フェルト | 2 | 2 | 1,257 | |
| イチカワ | - | 4 | 1,204 | |
| アツギ | 14 | 15 | 1,905 | |
| セーレン | 4 | 4 | 7,263 | |
| ソトー | - | 1 | 1,282 | |
| 東海染工 | 3 | 9 | 1,323 | |
| 小松精練 | 2 | 2 | 1,911 | |
| ワコールホールディングス | 11 | 11 | 15,620 | |
| ホギメディカル | 1 | 1 | 8,124 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|--------------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| レナウン | 9 | 10 | 1,219 |
| T S Iホールディングス | 8 | 7 | 6,360 |
| 三陽商会 | 10 | 10 | 1,720 |
| オンワードホールディングス | 12 | 12 | 10,296 |
| ゴールドウイン | 0.800 | 0.800 | 4,600 |
| デサント | 4 | 4 | 5,237 |
| キング | 2 | 2 | 1,037 |
| ヤマトインターナショナル | 2 | 3 | 1,239 |
| パルプ・紙(0.2%) | | | |
| 特種東海製紙 | 11 | 1 | 4,625 |
| 王子ホールディングス | 75 | 73 | 37,960 |
| 日本製紙 | 9 | 8 | 16,442 |
| 三菱製紙 | 28 | 2 | 1,976 |
| 北越紀州製紙 | 11 | 10 | 7,810 |
| 中越パルプ工業 | 8 | 7 | 1,694 |
| 大王製紙 | 8 | 7 | 9,583 |
| 阿波製紙 | - | 1 | 848 |
| レンゴー | 16 | 17 | 11,652 |
| トーモク | 6 | 6 | 2,010 |
| ザ・パック | 1 | 1 | 3,997 |
| 化学(6.7%) | | | |
| クラレ | 28 | 31 | 53,742 |
| 旭化成 | 114 | 116 | 127,020 |
| 共和レザー | 1 | 1 | 1,296 |
| 昭和電工 | 122 | 12 | 24,576 |
| 住友化学 | 135 | 137 | 87,406 |
| 日本化成 | 9 | - | - |
| 住友精化 | 4 | 0.800 | 3,780 |
| 日産化学工業 | 11 | 10 | 39,933 |
| ラサ工業 | 10 | 9 | 1,323 |
| クレハ | 14 | 1 | 6,804 |
| テイカ | 3 | 3 | 2,175 |
| 石原産業 | 33 | 3 | 3,696 |
| 日本曹達 | 12 | 11 | 7,370 |
| 東ソー | 49 | 54 | 54,216 |
| トクヤマ | 30 | 29 | 16,617 |
| セントラル硝子 | 20 | 19 | 10,393 |
| 東亜合成 | 11 | 11 | 14,755 |
| 大阪ソーダ | 8 | 8 | 3,960 |
| 関東電化工業 | 4 | 4 | 4,636 |
| デンカ | 38 | 39 | 23,790 |
| 信越化学工業 | 32 | 33 | 329,491 |
| 日本カーバイド工業 | 8 | 8 | 1,296 |
| 堺化学工業 | 7 | 7 | 2,877 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|----------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エア・ウォーター | 15 | 15 | 33,078 |
| 大陽日酸 | 14 | 14 | 20,391 |
| 日本化学工業 | 7 | 7 | 1,687 |
| 日本パーカラライジング | 9 | 9 | 13,376 |
| 高圧ガス工業 | 3 | 2 | 2,142 |
| 四国化成工業 | 3 | 3 | 3,555 |
| 戸田工業 | 4 | 4 | 1,140 |
| ステラ ケミファ | 0.900 | 0.900 | 3,087 |
| 保土谷化学工業 | 6 | 0.600 | 2,190 |
| 日本触媒 | 2 | 2 | 21,663 |
| 大日精化工業 | 7 | 8 | 5,792 |
| カネカ | 25 | 25 | 22,500 |
| 三菱瓦斯化学 | 31 | 17 | 40,222 |
| 三井化学 | 78 | 85 | 47,005 |
| J S R | 17 | 18 | 37,755 |
| 東京応化工業 | 3 | 3 | 13,247 |
| 大阪有機化学工業 | - | 1 | 1,263 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 122 | 125 | 107,670 |
| K Hネオケム | - | 2 | 3,082 |
| 日本合成化学工業 | 4 | - | - |
| ダイセル | 25 | 25 | 35,165 |
| 住友ベークライト | 17 | 16 | 10,640 |
| 積水化学工業 | 41 | 42 | 79,125 |
| 日本ゼオン | 16 | 16 | 20,768 |
| アイカ工業 | 5 | 6 | 17,388 |
| 宇部興産 | 98 | 94 | 26,790 |
| 積水樹脂 | 2 | 2 | 5,457 |
| タキロン | 4 | 4 | 2,176 |
| 旭有機材 | 6 | 6 | 1,452 |
| 日立化成 | 9 | 10 | 33,217 |
| ニチバン | 2 | 2 | 1,860 |
| リケンテクノス | 3 | 4 | 2,188 |
| 大倉工業 | 4 | 4 | 2,256 |
| 積水化成品工業 | 5 | 2 | 2,158 |
| 群栄化学工業 | 5 | 0.400 | 1,514 |
| タイガースポリマー | - | 1 | 1,203 |
| ミライアル | 1 | 1 | 1,128 |
| ダイキアグシス | - | 1 | 1,476 |
| ダイキョーニシカワ | 2 | 3 | 4,798 |
| 日本化薬 | 12 | 12 | 18,972 |
| カーリットホールディングス | 2 | 2 | 1,306 |
| 日本精化 | 1 | 1 | 1,420 |
| 扶桑化学工業 | 1 | 1 | 4,082 |
| A D E K A | 9 | 8 | 12,496 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日油 | 14 | 15 | 18,960 |
| 新日本理化 | 6 | 7 | 1,147 |
| ハリマ化成グループ | 1 | 1 | 1,259 |
| 花王 | 49 | 47 | 270,887 |
| 第一工業製薬 | 4 | 4 | 1,816 |
| 三洋化成工業 | 6 | 1 | 5,652 |
| 大日本塗料 | 10 | 11 | 2,563 |
| 日本ペイントホールディングス | 14 | 14 | 51,768 |
| 関西ペイント | 20 | 19 | 42,900 |
| 中国塗料 | 5 | 5 | 4,526 |
| 日本特殊塗料 | 1 | 1 | 2,278 |
| 藤倉化成 | 2 | 2 | 1,705 |
| 太陽ホールディングス | 1 | 1 | 7,162 |
| D I C | 73 | 7 | 28,835 |
| サカタインクス | 3 | 3 | 6,133 |
| 東洋インキSCホールディングス | 18 | 18 | 9,990 |
| T & K T O K A | 1 | 1 | 1,406 |
| 富士フィルムホールディングス | 41 | 36 | 160,884 |
| 資生堂 | 34 | 35 | 101,416 |
| ライオン | 21 | 23 | 43,102 |
| 高砂香料工業 | 1 | 1 | 4,326 |
| マンダム | 1 | 1 | 9,880 |
| ミルボン | 1 | 1 | 5,290 |
| ファンケル | 4 | 4 | 6,456 |
| コーセー | 3 | 3 | 27,570 |
| シーズ・ホールディングス | 2 | 2 | 7,476 |
| シーボン | 0.400 | 0.200 | 511 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 1 | 1 | 20,748 |
| ノエビアホールディングス | 1 | 1 | 5,136 |
| アジュバンコスメジャパン | 1 | 1 | 1,266 |
| エステー | 1 | 1 | 2,251 |
| アグロ カネシヨウ | 0.900 | 1 | 1,310 |
| コニシ | 1 | 2 | 3,944 |
| 長谷川香料 | 2 | 2 | 4,696 |
| 星光PMC | 1 | 1 | 1,132 |
| 小林製薬 | 2 | 5 | 27,092 |
| 荒川化学工業 | 1 | 1 | 3,267 |
| メック | 1 | 1 | 1,733 |
| 日本高純度化学 | 0.500 | 0.500 | 1,240 |
| タカラバイオ | - | 4 | 6,176 |
| J C U | 0.500 | 0.600 | 4,500 |
| デクセリアルズ | 4 | 4 | 6,311 |
| アース製薬 | 1 | 1 | 6,643 |
| イハラケミカル工業 | 2 | 2 | 2,743 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 北興化学工業 | 3 | - | - |
| 大成ラミック | 0.500 | 0.500 | 1,572 |
| クミアイ化学工業 | 3 | 3 | 2,557 |
| 日本農薬 | 4 | 4 | 2,940 |
| アキレス | 15 | 1 | 2,739 |
| 有沢製作所 | 2 | 3 | 2,445 |
| 日東電工 | 14 | 13 | 127,675 |
| レック | 0.800 | 0.600 | 2,721 |
| きもと | 5 | 5 | 1,245 |
| 藤森工業 | 1 | 1 | 4,228 |
| 前澤化成工業 | 1 | 1 | 1,450 |
| J S P | 1 | 0.900 | 2,325 |
| エフピコ | 1 | 1 | 8,240 |
| 天馬 | 1 | 1 | 2,574 |
| 信越ポリマー | 3 | 3 | 3,006 |
| 東リ | 5 | 4 | 1,817 |
| ニフコ | 3 | 3 | 18,843 |
| 日本バルカー工業 | 7 | 1 | 2,580 |
| ユニ・チャーム | 37 | 37 | 92,157 |
| 医薬品(4.7%) | | | |
| 協和発酵キリン | 21 | 22 | 36,549 |
| 武田薬品工業 | 72 | 69 | 365,367 |
| アステラス製薬 | 204 | 190 | 287,470 |
| 大日本住友製薬 | 12 | 13 | 25,964 |
| 塩野義製薬 | 26 | 25 | 138,348 |
| 田辺三菱製薬 | 21 | 21 | 49,801 |
| わかもと製薬 | 4 | - | - |
| あすか製薬 | 2 | 2 | 3,440 |
| 日本新薬 | 4 | 4 | 26,273 |
| ビオフェルミン製薬 | 0.300 | 0.400 | 1,234 |
| 中外製薬 | 18 | 18 | 71,040 |
| 科研製薬 | 3 | 3 | 20,615 |
| エーザイ | 22 | 22 | 140,010 |
| ロート製薬 | 9 | 9 | 19,965 |
| 小野薬品工業 | 8 | 42 | 106,470 |
| 久光製薬 | 5 | 5 | 31,876 |
| 持田製薬 | 1 | 1 | 10,959 |
| 参天製薬 | 33 | 34 | 55,668 |
| 扶桑薬品工業 | 6 | 0.600 | 1,721 |
| 日本ケミファ | 3 | 0.300 | 1,662 |
| ツムラ | 5 | 6 | 21,018 |
| 日医工 | 4 | 4 | 7,413 |
| キッセイ薬品工業 | 3 | 3 | 9,451 |
| 生化学工業 | 3 | 3 | 5,871 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|-----------------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 栄研化学 | 1 | 1 | 4,864 |
| 日水製薬 | - | 0.300 | 410 |
| 鳥居薬品 | 1 | 1 | 3,781 |
| JCRファーマ | 1 | 1 | 3,998 |
| 東和薬品 | 0.800 | 0.900 | 4,734 |
| 富士製薬工業 | 0.500 | 0.600 | 1,851 |
| 沢井製薬 | 3 | 3 | 19,616 |
| ゼリア新薬工業 | 3 | 3 | 6,482 |
| 第一三共 | 61 | 54 | 140,223 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 4 | 4 | 10,615 |
| 大幸薬品 | 0.900 | 0.900 | 1,617 |
| ダイト | 0.800 | 1 | 2,275 |
| 大塚ホールディングス | 39 | 40 | 206,200 |
| 大正製薬ホールディングス | 4 | 4 | 36,920 |
| ペプチドリーム | 2 | 3 | 17,056 |
| 石油・石炭製品(0.5%) | | | |
| 日本コークス工業 | 14 | 15 | 1,560 |
| 昭和シェル石油 | 18 | 16 | 18,102 |
| ニチレキ | 2 | 2 | 2,104 |
| 東燃ゼネラル石油 | 28 | 30 | 39,510 |
| ユシロ化学工業 | 1 | 1 | 1,452 |
| ピーピー・カストロール | 0.800 | 0.900 | 1,485 |
| 富士石油 | 4 | 4 | 1,694 |
| MORESCO | 0.300 | 0.700 | 1,226 |
| 出光興産 | 9 | 8 | 31,284 |
| JXホールディングス | 216 | 206 | 108,825 |
| コスモエネルギーホールディングス | 5 | 5 | 10,824 |
| ゴム製品(1.0%) | | | |
| 横浜ゴム | 11 | 11 | 24,595 |
| 東洋ゴム工業 | 8 | 9 | 16,728 |
| ブリヂストン | 61 | 62 | 285,677 |
| 住友ゴム工業 | 17 | 17 | 31,511 |
| 藤倉ゴム工業 | 2 | - | - |
| オカモト | 6 | 6 | 6,174 |
| フコク | 0.300 | 0.800 | 751 |
| ニッタ | 2 | 1 | 5,083 |
| 住友理工 | 3 | 3 | 3,940 |
| 三ツ星ベルト | 4 | 5 | 5,025 |
| バンドー化学 | 7 | 3 | 3,610 |
| ガラス・土石製品(1.0%) | | | |
| 日東紡績 | 12 | 15 | 7,590 |
| 旭硝子 | 97 | 92 | 84,456 |
| 日本板硝子 | 89 | 8 | 7,267 |
| 日本山村硝子 | 7 | 8 | 1,632 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|-----------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本電気硝子 | 38 | 38 | 26,790 |
| 住友大阪セメント | 36 | 35 | 16,135 |
| 太平洋セメント | 114 | 112 | 45,808 |
| 日本ヒューム | 1 | 1 | 1,278 |
| 日本コンクリート工業 | 4 | 4 | 1,440 |
| 三谷セキサン | 0.900 | 0.900 | 2,297 |
| アジアパイルホールディングス | 2 | 2 | 1,331 |
| 東海カーボン | 16 | 17 | 8,143 |
| 日本カーボン | 9 | 9 | 2,691 |
| 東洋炭素 | 1 | 1 | 1,953 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 10 | 1 | 2,925 |
| TOTO | 13 | 13 | 57,814 |
| 日本碍子 | 23 | 23 | 57,692 |
| 日本特殊陶業 | 15 | 16 | 41,344 |
| MARUWA | 0.700 | 0.700 | 2,600 |
| 品川リフラクトリーズ | 5 | 5 | 1,510 |
| 黒崎播磨 | 4 | 4 | 1,856 |
| 東京窯業 | 6 | 6 | 1,337 |
| ニッカトー | 2 | 3 | 1,275 |
| フジミインコーポレーテッド | 1 | 1 | 4,142 |
| エーアンドエーマテリアル | 14 | - | - |
| ニチアス | 9 | 10 | 10,990 |
| ニチハ | 2 | 2 | 7,887 |
| 鉄鋼(1.4%) | | | |
| 新日鐵住金 | 82 | 83 | 236,430 |
| 神戸製鋼所 | 336 | 32 | 36,675 |
| 中山製鋼所 | 21 | 2 | 1,640 |
| 合同製鐵 | 10 | 1 | 1,885 |
| ジェイエフイーホールディングス | 50 | 50 | 108,813 |
| 日新製鋼 | 8 | 8 | 13,370 |
| 東京製鐵 | 10 | 9 | 9,804 |
| 共英製鋼 | 1 | 2 | 4,292 |
| 大和工業 | 4 | 3 | 12,284 |
| 東京鐵鋼 | 4 | 4 | 1,896 |
| 大阪製鐵 | 1 | 1 | 2,632 |
| 淀川製鋼所 | 2 | 2 | 8,736 |
| 東洋鋼板 | 4 | 4 | 2,037 |
| 丸一鋼管 | 6 | 6 | 22,289 |
| モリ工業 | - | 0.600 | 1,391 |
| 大同特殊鋼 | 31 | 31 | 17,670 |
| 日本冶金工業 | 13 | 15 | 3,572 |
| 山陽特殊製鋼 | 11 | 11 | 6,754 |
| 愛知製鋼 | 11 | 1 | 5,357 |
| 日立金属 | 20 | 18 | 31,695 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本金属 | 10 | 1 | 1 | 1,306 |
| 大平洋金属 | 13 | 12 | 12 | 5,004 |
| 新日本電工 | 10 | 10 | 10 | 3,538 |
| 栗本鐵工所 | 9 | 0.900 | 0.900 | 2,145 |
| 日本鑄鉄管 | 7 | - | - | - |
| 三菱製鋼 | 13 | 13 | 13 | 3,393 |
| 日亜鋼業 | 3 | 4 | 4 | 1,311 |
| 日本精線 | 2 | 2 | 2 | 1,222 |
| シンニッタン | 0.600 | 0.200 | 0.200 | 142 |
| 新家工業 | 7 | 8 | 8 | 1,432 |
| 非鉄金属(1.0%) | | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 4 | 3 | 3 | 1,593 |
| 日本軽金属ホールディングス | 41 | 42 | 42 | 12,040 |
| 三井金属鉱業 | 47 | 51 | 51 | 19,431 |
| 東邦亜鉛 | 10 | 10 | 10 | 6,350 |
| 三菱マテリアル | 114 | 11 | 11 | 44,544 |
| 住友金属鉱山 | 50 | 48 | 48 | 77,688 |
| DOWAホールディングス | 24 | 21 | 21 | 19,824 |
| 古河機械金属 | 29 | 29 | 29 | 6,902 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 1 | 2 | 2 | 4,128 |
| 東邦チタニウム | 3 | 3 | 3 | 3,081 |
| UACJ | 26 | 24 | 24 | 7,704 |
| 古河電気工業 | 57 | 6 | 6 | 25,451 |
| 住友電気工業 | 73 | 70 | 70 | 131,788 |
| フジクラ | 25 | 24 | 24 | 20,898 |
| 昭和電線ホールディングス | 22 | 22 | 22 | 2,002 |
| 東京特殊電線 | 1 | - | - | - |
| タツタ電線 | 3 | 3 | 3 | 1,613 |
| カナレ電気 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 1,354 |
| 平河ヒューテック | - | 1 | 1 | 1,119 |
| リョービ | 11 | 11 | 11 | 5,621 |
| アーレスティ | 2 | 2 | 2 | 2,596 |
| アサヒホールディングス | 2 | 2 | 2 | 5,544 |
| 金属製品(0.7%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 1 | 1 | 1 | 1,331 |
| トーカロ | 1 | 1 | 1 | 3,266 |
| SUMCO | 14 | 19 | 19 | 34,473 |
| 川田テクノロジーズ | 0.300 | 0.400 | 0.400 | 3,132 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 13 | 13 | 13 | 27,324 |
| ホッカンホールディングス | 5 | 5 | 5 | 2,725 |
| コロナ | 1 | 1 | 1 | 1,280 |
| 横河ブリッジホールディングス | 3 | 3 | 3 | 4,633 |
| 駒井ハルテック | 4 | - | - | - |
| 高田機工 | 5 | 5 | 5 | 1,215 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-----------------|---------|-------|-------|--------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三和ホールディングス | 18 | 18 | 18 | 20,072 |
| 文化シャッター | 5 | 5 | 5 | 4,477 |
| 三協立山 | 2 | 2 | 2 | 4,240 |
| アルインコ | 1 | 1 | 1 | 1,365 |
| LIXILグループ | 25 | 25 | 25 | 71,743 |
| 日本フィルコン | 2 | 2 | 2 | 1,229 |
| ノーリツ | 3 | 3 | 3 | 7,837 |
| 長府製作所 | 2 | 2 | 2 | 5,448 |
| リンナイ | 3 | 3 | 3 | 27,936 |
| ダイニチ工業 | 0.900 | 1 | 1 | 1,244 |
| 日東精工 | 3 | 2 | 2 | 1,241 |
| 岡部 | 3 | 3 | 3 | 3,884 |
| ジーテクト | 1 | 1 | 1 | 4,086 |
| 東プレ | 3 | 3 | 3 | 10,519 |
| 高周波熱錬 | 3 | 3 | 3 | 3,213 |
| 東京製鋼 | 12 | 1 | 1 | 2,364 |
| サンコール | 2 | 2 | 2 | 1,218 |
| モリテックスチール | 4 | 4 | 4 | 1,260 |
| パイオラックス | 0.900 | 0.900 | 0.900 | 7,011 |
| 日本発条 | 17 | 17 | 17 | 22,575 |
| 中央発條 | 4 | - | - | - |
| アドバネクス | - | 0.700 | 0.700 | 1,329 |
| 三益半導体工業 | 1 | 1 | 1 | 2,464 |
| 機械(5.1%) | | | | |
| 日本ドライケミカル | 0.500 | 0.500 | 0.500 | 1,155 |
| 日本製鋼所 | 30 | 6 | 6 | 12,358 |
| 三浦工業 | 8 | 7 | 7 | 13,125 |
| タクマ | 7 | 6 | 6 | 6,132 |
| ツガミ | 5 | 5 | 5 | 3,460 |
| オークマ | 12 | 12 | 12 | 14,580 |
| 東芝機械 | 10 | 11 | 11 | 5,401 |
| アマダホールディングス | 26 | 25 | 25 | 31,600 |
| アイダエンジニアリング | 4 | 5 | 5 | 5,368 |
| 滝澤鉄工所 | 8 | 8 | 8 | 1,496 |
| 富士機械製造 | 6 | 5 | 5 | 8,738 |
| 牧野フライス製作所 | 9 | 9 | 9 | 9,594 |
| オーエスジー | 8 | 8 | 8 | 20,374 |
| ダイジェット工業 | 8 | 7 | 7 | 1,281 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 5 | 5 | 5 | 4,918 |
| DMG森精機 | 10 | 11 | 11 | 18,887 |
| ソディック | 3 | 4 | 4 | 5,099 |
| ディスコ | 2 | 2 | 2 | 37,576 |
| 日東工器 | 1 | 1 | 1 | 2,803 |
| 豊和工業 | 1 | 2 | 2 | 1,334 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|--------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 〇KK | 9 | 10 | 10 | 1,260 |
| 石川製作所 | 14 | 1 | 1 | 1,375 |
| 東洋機械金属 | — | 2 | 2 | 1,489 |
| 津田駒工業 | 10 | 8 | 8 | 1,424 |
| 島精機製作所 | 2 | 2 | 2 | 9,204 |
| NCホールディングス | — | 1 | 1 | 1,218 |
| フリー | — | 0.400 | 0.400 | 1,864 |
| 日阪製作所 | 2 | 2 | 2 | 2,302 |
| やまびこ | 3 | 3 | 3 | 4,930 |
| ベガサスミシン製造 | 2 | 1 | 1 | 1,522 |
| ナブテスコ | 9 | 9 | 9 | 31,185 |
| 三井海洋開発 | 2 | 1 | 1 | 4,636 |
| レオン自動車 | 1 | 1 | 1 | 1,737 |
| SMC | 5 | 5 | 5 | 177,520 |
| 新川 | 2 | 1 | 1 | 1,231 |
| ホソカワミクロン | 3 | 3 | 3 | 2,466 |
| ユニオンツール | 0.800 | 0.800 | 0.800 | 2,876 |
| オイレス工業 | 2 | 2 | 2 | 4,941 |
| 日精エー・エス・ピー機械 | 0.700 | 0.600 | 0.600 | 1,442 |
| サトーホールディングス | 2 | 2 | 2 | 5,747 |
| 日本エアテック | 1 | 1 | 1 | 1,242 |
| 日精樹脂工業 | 1 | 1 | 1 | 1,687 |
| 小松製作所 | 89 | 85 | 85 | 240,325 |
| 住友重機械工業 | 53 | 54 | 54 | 44,442 |
| 日立建機 | 8 | 8 | 8 | 22,102 |
| 日工 | 3 | — | — | — |
| 巴工業 | 0.700 | 0.800 | 0.800 | 1,501 |
| 井関農機 | 19 | 19 | 19 | 4,902 |
| TOWA | 1 | 1 | 1 | 3,120 |
| 丸山製作所 | 6 | 7 | 7 | 1,365 |
| 北川鉄工所 | 8 | 0.900 | 0.900 | 2,214 |
| ローツェ | — | 0.700 | 0.700 | 1,774 |
| クボタ | 87 | 89 | 89 | 165,205 |
| 荏原実業 | 0.800 | 0.900 | 0.900 | 1,233 |
| 三菱化工機 | 6 | 6 | 6 | 1,344 |
| 月島機械 | 3 | 3 | 3 | 4,536 |
| 帝国電機製作所 | 1 | 1 | 1 | 1,465 |
| 新東工業 | 4 | 4 | 4 | 4,355 |
| 澁谷工業 | 1 | 1 | 1 | 4,660 |
| アイチコーポレーション | 2 | 2 | 2 | 2,303 |
| 小森コーポレーション | 4 | 4 | 4 | 6,849 |
| 鶴見製作所 | 1 | 1 | 1 | 2,156 |
| 住友精密工業 | 3 | 3 | 3 | 1,104 |
| 荏原製作所 | 40 | 8 | 8 | 27,593 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 石井鐵工所 | 7 | 0.200 | 0.200 | 357 |
| 西島製作所 | 1 | 1 | 1 | 2,061 |
| 北越工業 | 2 | 2 | 2 | 1,950 |
| ダイキン工業 | 25 | 24 | 24 | 259,424 |
| オルガノ | 3 | 4 | 4 | 1,992 |
| トーヨーカネツ | 10 | 9 | 9 | 2,862 |
| 栗田工業 | 11 | 10 | 10 | 28,717 |
| 椿本チエイン | 10 | 11 | 11 | 10,857 |
| アネスト岩田 | 2 | 3 | 3 | 3,500 |
| ダイフク | 9 | 8 | 8 | 24,083 |
| 加藤製作所 | 4 | 1 | 1 | 3,065 |
| タダノ | 8 | 9 | 9 | 13,578 |
| フジテック | 5 | 5 | 5 | 6,812 |
| CKD | 4 | 5 | 5 | 7,928 |
| キトー | 2 | 2 | 2 | 2,752 |
| 平和 | 5 | 5 | 5 | 16,153 |
| 理想科学工業 | 1 | 1 | 1 | 3,819 |
| SANKYO | 4 | 4 | 4 | 19,428 |
| 日本金銭機械 | 1 | 1 | 1 | 2,406 |
| マースエンジニアリング | 1 | 1 | 1 | 2,297 |
| 福島工業 | 1 | 1 | 1 | 4,086 |
| オーイズミ | 2 | — | — | — |
| ダイコク電機 | 0.800 | 0.700 | 0.700 | 1,306 |
| 竹内製作所 | 2 | 3 | 3 | 7,443 |
| アマノ | 5 | 5 | 5 | 12,529 |
| JUKI | 2 | 2 | 2 | 3,592 |
| サンデンホールディングス | 11 | 11 | 11 | 4,257 |
| 蛇の目ミシン工業 | 1 | 1 | 1 | 1,353 |
| マックス | 3 | 3 | 3 | 4,581 |
| グローリー | 6 | 5 | 5 | 21,717 |
| 新晃工業 | 1 | 1 | 1 | 1,753 |
| 大和冷機工業 | 2 | 2 | 2 | 2,975 |
| セガサミーホールディングス | 18 | 17 | 17 | 29,532 |
| 日本ピストンリング | 0.700 | 0.700 | 0.700 | 1,652 |
| リケン | 8 | 0.800 | 0.800 | 3,428 |
| T P R | 2 | 2 | 2 | 7,320 |
| ツバキ・ナカシマ | 1 | 2 | 2 | 3,888 |
| ホシザキ | 3 | 3 | 3 | 33,969 |
| 大豊工業 | 1 | 1 | 1 | 2,156 |
| 日本精工 | 35 | 36 | 36 | 58,984 |
| NTN | 43 | 41 | 41 | 22,386 |
| ジェイテクト | 18 | 18 | 18 | 35,645 |
| 不二越 | 16 | 18 | 18 | 11,052 |
| 日本トムソン | 6 | 5 | 5 | 3,192 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|--------------------|---------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 千円 |
| THK | 11 | 12 | 37,275 |
| ユーシン精機 | 0.700 | 0.800 | 2,339 |
| 前澤給装工業 | 0.700 | 0.800 | 1,223 |
| イーグル工業 | 2 | 1 | 3,057 |
| 日本ピラー工業 | 1 | 1 | 2,824 |
| キッツ | 8 | 8 | 6,324 |
| 日立工機 | 4 | 4 | 4,161 |
| マキタ | 11 | 11 | 89,784 |
| 日立造船 | 13 | 14 | 9,094 |
| 三菱重工業 | 311 | 298 | 132,639 |
| IHI | 134 | 136 | 46,104 |
| スター精密 | 3 | 3 | 5,180 |
| 電気機器(12.6%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 9 | 9 | 11,444 |
| イビデン | 10 | 12 | 23,795 |
| コニカミノルタ | 43 | 41 | 45,968 |
| ブラザー工業 | 22 | 23 | 47,242 |
| ミネベアミツミ | 28 | 32 | 45,434 |
| 日立製作所 | 445 | 426 | 266,974 |
| 東芝 | 368 | 397 | 73,961 |
| 三菱電機 | 186 | 189 | 318,549 |
| 富士電機 | 53 | 54 | 33,966 |
| 東洋電機製造 | 3 | 0.800 | 1,387 |
| 安川電機 | 21 | 20 | 44,187 |
| シンフォニアテクノロジー | 11 | 11 | 3,366 |
| 明電舎 | 16 | 16 | 6,096 |
| オリジン電気 | 4 | 4 | 1,268 |
| 山洋電気 | 5 | 5 | 4,420 |
| デンヨー | 1 | 1 | 2,856 |
| 東芝テック | 12 | 11 | 6,611 |
| 芝浦メカトロニクス | 5 | 5 | 1,410 |
| マブチモーター | 5 | 5 | 31,150 |
| 日本電産 | 21 | 23 | 245,870 |
| 東光高岳 | 1 | 0.900 | 1,977 |
| ダブル・スコープ | 0.500 | 1 | 3,131 |
| ダイヘン | 10 | 10 | 7,210 |
| 田淵電機 | 2 | 3 | 1,107 |
| ヤーマン | - | 0.200 | 1,232 |
| JVCケンウッド | 12 | 13 | 3,952 |
| ミマキエンジニアリング | 1 | - | - |
| 第一精工 | 0.700 | - | - |
| 日新電機 | 4 | 3 | 4,942 |
| 大崎電気工業 | 3 | 4 | 4,364 |
| オムロン | 20 | 18 | 91,759 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|------------------|---------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 千円 |
| 日東工業 | 2 | 2 | 4,121 |
| IDEC | 2 | 2 | 2,730 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 34 | 34 | 17,034 |
| サクサホールディングス | 5 | 5 | 1,155 |
| メルコホールディングス | 1 | 1 | 3,355 |
| テクノメディカ | 0.400 | - | - |
| 日本電気 | 240 | 244 | 67,344 |
| 富士通 | 168 | 171 | 112,825 |
| 沖電気工業 | 76 | 7 | 12,258 |
| 岩崎通信機 | 14 | 14 | 1,274 |
| 電気興業 | 5 | 5 | 2,810 |
| サンケン電気 | 10 | 10 | 5,140 |
| ナカヨ | - | 3 | 1,260 |
| アイホン | 1 | 1 | 1,858 |
| ルネサスエレクトロニクス | 9 | 9 | 9,374 |
| セイコーエプソン | 26 | 26 | 67,584 |
| ワコム | 13 | 13 | 5,644 |
| アルバック | 3 | 3 | 16,863 |
| アクセル | 1 | - | - |
| EIZO | 1 | 1 | 5,877 |
| ジャパンディスプレイ | 32 | 33 | 9,362 |
| 日本信号 | 4 | 4 | 5,208 |
| 京三製作所 | 4 | 4 | 1,636 |
| 能美防災 | 2 | 2 | 2,984 |
| ホーチキ | 1 | 1 | 1,840 |
| エレコム | 1 | 1 | 3,039 |
| 日本無線 | 4 | 1 | 1,555 |
| パナソニック | 199 | 202 | 253,016 |
| シャープ | 148 | - | - |
| アンリツ | 10 | 12 | 11,223 |
| 富士通ゼネラル | 5 | 6 | 12,960 |
| 日立国際電気 | 4 | 4 | 10,971 |
| ソニー | 123 | 125 | 439,903 |
| TDK | 10 | 10 | 78,400 |
| 帝国通信工業 | - | 7 | 1,316 |
| ミツミ電機 | 6 | - | - |
| タムラ製作所 | 7 | 7 | 3,185 |
| アルプス電気 | 14 | 16 | 56,826 |
| 池上通信機 | - | 3 | 462 |
| パイオニア | 28 | 26 | 6,114 |
| 日本電波工業 | 1 | 1 | 1,438 |
| 鈴木 | - | 2 | 1,380 |
| 日本トリム | 0.500 | 0.400 | 1,616 |
| ローランド ディー. ジー. | 0.900 | 0.900 | 3,195 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|-----------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フォスター電機 | 2 | 2 | 4,029 |
| クラリオン | 9 | 9 | 3,924 |
| SMK | 5 | 5 | 2,110 |
| ヨコオ | — | 1 | 1,716 |
| 東光 | 4 | — | — |
| ティアック | 23 | 26 | 1,170 |
| ホシデン | 5 | 5 | 5,427 |
| ヒロセ電機 | 2 | 2 | 42,920 |
| 日本航空電子工業 | 5 | 6 | 9,234 |
| TOA | 2 | 2 | 2,118 |
| 日立マクセル | 2 | 2 | 5,842 |
| 古野電気 | 2 | 2 | 1,771 |
| ユニデンホールディングス | 9 | 7 | 1,176 |
| アルパイン | 4 | 4 | 7,051 |
| スミダコーポレーション | 1 | 1 | 1,948 |
| アイコム | 1 | 1 | 2,379 |
| リオン | 0.700 | 0.800 | 1,259 |
| 船井電機 | 1 | 2 | 1,900 |
| 横河電機 | 17 | 19 | 33,331 |
| 新電元工業 | 6 | 7 | 3,360 |
| アズビル | 5 | 5 | 19,197 |
| 日本光電工業 | 7 | 7 | 18,374 |
| チノー | — | 1 | 1,340 |
| 共和電業 | — | 3 | 1,391 |
| 日本電子材料 | 2 | 2 | 1,268 |
| 堀場製作所 | 3 | 3 | 21,840 |
| アドバンテスト | 11 | 12 | 23,921 |
| 小野測器 | — | 1 | 1,227 |
| エスベック | 1 | 1 | 2,056 |
| パナソニック デバイスSUNX | 1 | 1 | 1,348 |
| キーエンス | 4 | 8 | 354,000 |
| 日置電機 | 0.900 | 0.900 | 2,005 |
| シスメックス | 13 | 13 | 88,182 |
| 日本マイクロニクス | 2 | 3 | 2,973 |
| メガチップス | 1 | 1 | 4,664 |
| OBARA GROUP | 1 | 1 | 4,995 |
| 澤藤電機 | 5 | 6 | 1,500 |
| コーセル | 2 | 2 | 3,490 |
| イリソ電子工業 | — | 0.600 | 4,284 |
| オプテックスグループ | 1 | 1 | 4,088 |
| 千代田インテグレ | 0.900 | 0.900 | 2,166 |
| レーザーテック | 2 | 2 | 6,066 |
| スタンレー電気 | 12 | 12 | 40,132 |
| 岩崎電気 | 6 | 6 | 1,044 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ウシオ電機 | 10 | 10 | 15,724 |
| 岡谷電機産業 | 2 | 3 | 1,260 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 2 | 2 | 1,403 |
| 日本セラミック | 1 | 1 | 3,643 |
| 遠藤照明 | — | 1 | 1,309 |
| 日本デジタル研究所 | 1 | — | — |
| 古河電池 | — | 2 | 1,518 |
| 双信電機 | 3 | 4 | 1,285 |
| 山一電機 | 1 | 1 | 2,623 |
| 図研 | 1 | 1 | 1,551 |
| 日本電子 | 7 | 6 | 3,222 |
| カシオ計算機 | 17 | 14 | 22,207 |
| ファナック | 17 | 18 | 402,210 |
| 日本シイエムケイ | 3 | 3 | 2,492 |
| エンプラス | 0.900 | 0.800 | 2,820 |
| ローム | 8 | 8 | 63,984 |
| 浜松ホトニクス | 13 | 13 | 46,982 |
| 三井ハイテック | 2 | 2 | 2,047 |
| 新光電気工業 | 6 | 6 | 5,252 |
| 京セラ | 28 | 29 | 181,857 |
| 太陽誘電 | 8 | 8 | 13,158 |
| 村田製作所 | 18 | 18 | 304,854 |
| ユーシン | 2 | 2 | 1,927 |
| 双葉電子工業 | 3 | 2 | 5,852 |
| 北陸電気工業 | 8 | — | — |
| ニチコン | 5 | 5 | 5,952 |
| 日本ケミコン | 14 | 15 | 4,785 |
| KOA | 2 | 2 | 3,327 |
| 市光工業 | 5 | 4 | 2,076 |
| 小糸製作所 | 10 | 10 | 61,692 |
| ミツバ | 3 | 3 | 7,421 |
| SCREENホールディングス | 18 | 3 | 27,504 |
| キャノン電子 | 1 | 1 | 2,857 |
| キャノン | 94 | 95 | 314,428 |
| リコー | 56 | 53 | 53,506 |
| MUTOHホールディングス | — | 5 | 1,340 |
| 東京エレクトロン | 15 | 11 | 131,924 |
| 輸送用機器(9.3%) | | | |
| トヨタ紡織 | 6 | 6 | 15,202 |
| 芦森工業 | 7 | — | — |
| 鬼怒川ゴム工業 | 4 | — | — |
| ユニプレス | 3 | 3 | 7,942 |
| 豊田自動織機 | 15 | 16 | 89,910 |
| モリタホールディングス | 3 | 3 | 4,774 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|--------------|---------|-------|-----------|-------|-----|-----|
| | 株 数 | 株 数 | 評価額 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三櫻工業 | 2 | 2 | 1,987 | | | |
| デンソー | 43 | 43 | 222,723 | | | |
| 東海理化電機製作所 | 5 | 4 | 10,490 | | | |
| 三井造船 | 68 | 64 | 11,392 | | | |
| 川崎重工業 | 136 | 138 | 48,990 | | | |
| 名村造船所 | 5 | 5 | 4,202 | | | |
| サノヤホールディングス | 4 | 4 | 1,341 | | | |
| 日本車輛製造 | 7 | 6 | 1,824 | | | |
| ニチユ三菱フォークリフト | 2 | 2 | 1,434 | | | |
| 近畿車輛 | 3 | - | - | | | |
| 日産自動車 | 245 | 212 | 237,367 | | | |
| いすゞ自動車 | 50 | 51 | 79,335 | | | |
| トヨタ自動車 | 217 | 215 | 1,388,668 | | | |
| 日野自動車 | 24 | 25 | 33,421 | | | |
| 三菱自動車工業 | 69 | 65 | 44,333 | | | |
| エフテック | - | 0.900 | 1,205 | | | |
| レシップホールディングス | 1 | 0.300 | 256 | | | |
| GMB | 1 | 1 | 1,560 | | | |
| ファルテック | 0.700 | 0.900 | 1,268 | | | |
| 武蔵精密工業 | 1 | 2 | 5,913 | | | |
| 日産車体 | 8 | 7 | 8,494 | | | |
| 新明和工業 | 8 | 7 | 8,246 | | | |
| 極東開発工業 | 3 | 3 | 6,247 | | | |
| 日信工業 | 3 | 4 | 7,940 | | | |
| トピー工業 | 14 | 1 | 4,882 | | | |
| ティラド | 7 | 7 | 2,177 | | | |
| 曙ブレーキ工業 | 8 | 8 | 2,328 | | | |
| タチエス | 2 | 3 | 6,303 | | | |
| NOK | 8 | 8 | 21,973 | | | |
| フタバ産業 | 5 | 5 | 4,282 | | | |
| K Y B | 20 | 20 | 12,560 | | | |
| シロキ工業 | 4 | - | - | | | |
| 大同メタル工業 | 2 | 2 | 2,268 | | | |
| プレス工業 | 9 | 9 | 5,282 | | | |
| ミクニ | - | 3 | 1,299 | | | |
| カルソニックカンセイ | 13 | 12 | 15,420 | | | |
| 太平洋工業 | 3 | 3 | 5,212 | | | |
| ケーヒン | 4 | 4 | 8,081 | | | |
| 河西工業 | 2 | 2 | 3,326 | | | |
| アイシン精機 | 17 | 16 | 92,258 | | | |
| マツダ | 55 | 56 | 89,273 | | | |
| ダイハツ工業 | 20 | - | - | | | |
| 今仙電機製作所 | 1 | 1 | 1,612 | | | |
| 本田技研工業 | 157 | 159 | 571,125 | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|-------------------|---------|-------|---------|-------|-----|-----|
| | 株 数 | 株 数 | 評価額 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千株 | 千株 | 千円 |
| スズキ | 36 | 35 | 155,020 | | | |
| 富士重工業 | 55 | 55 | 235,938 | | | |
| 安永 | - | 0.700 | 1,160 | | | |
| ヤマハ発動機 | 24 | 25 | 64,933 | | | |
| ショーワ | 4 | 4 | 4,448 | | | |
| T B K | 2 | 2 | 1,269 | | | |
| エクセディ | 2 | 2 | 7,656 | | | |
| 豊田合成 | 6 | 5 | 16,199 | | | |
| 愛三工業 | 3 | 3 | 3,028 | | | |
| ヨロズ | 1 | 1 | 2,985 | | | |
| エフ・シー・シー | 2 | 2 | 6,536 | | | |
| シマノ | 7 | 7 | 119,304 | | | |
| タカタ | 3 | 3 | 1,753 | | | |
| テイ・エス テック | 4 | 4 | 11,963 | | | |
| ジャムコ | 0.800 | 1 | 2,624 | | | |
| 精密機器(1.5%) | | | | | | |
| テルモ | 26 | 27 | 105,944 | | | |
| クリエートメディック | 1 | - | - | | | |
| 日機装 | 6 | 6 | 7,417 | | | |
| 島津製作所 | 22 | 22 | 43,029 | | | |
| J M S | - | 4 | 1,300 | | | |
| モリテックス | 3 | - | - | | | |
| 長野計器 | 1 | 1 | 1,198 | | | |
| ブイ・テクノロジ | 0.400 | 0.400 | 6,936 | | | |
| 東京計器 | 6 | 6 | 1,440 | | | |
| オーバル | 4 | 3 | 1,033 | | | |
| 東京精密 | 3 | 3 | 13,039 | | | |
| マニー | 1 | 2 | 6,525 | | | |
| ニコン | 32 | 31 | 52,917 | | | |
| トプコン | 5 | 8 | 18,004 | | | |
| オリンパス | 26 | 28 | 111,502 | | | |
| 理研計器 | 1 | 1 | 2,617 | | | |
| タムロン | 1 | 1 | 3,384 | | | |
| HOYA | 40 | 36 | 184,690 | | | |
| ノーリツ鋼機 | 1 | 1 | 1,747 | | | |
| エー・アンド・デイ | 2 | 2 | 1,216 | | | |
| シチズン時計 | 21 | 19 | 14,317 | | | |
| リズム時計工業 | 8 | 7 | 1,309 | | | |
| 大研医器 | 1 | 1 | 1,280 | | | |
| メニコン | 0.900 | 1 | 4,224 | | | |
| 松風 | 0.900 | 0.900 | 1,232 | | | |
| セイコーホールディングス | 11 | 13 | 6,032 | | | |
| ニプロ | 13 | 12 | 16,961 | | | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|--------------------|---------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 千円 |
| その他製品(1.7%) | | | |
| スノーピーク | 0.300 | 0.400 | 1,136 |
| パラマウントベッドホールディングス | 1 | 1 | 7,063 |
| SHO-BI | 2 | 2 | 1,273 |
| ニホンフラッシュ | 1 | 0.900 | 1,154 |
| 前田工織 | 1 | 1 | 2,386 |
| アートネイチャー | 1 | 1 | 1,421 |
| ダンロップスポーツ | 1 | 1 | 1,142 |
| パンダイナムコホールディングス | 18 | 19 | 60,956 |
| 共立印刷 | 3 | 3 | 1,280 |
| SHOEI | 0.800 | 0.800 | 2,044 |
| フランスベッドホールディングス | 2 | 2 | 2,068 |
| パイロットコーポレーション | 3 | 3 | 14,229 |
| 萩原工業 | 0.500 | 0.500 | 1,308 |
| トッパン・フォームズ | 3 | 3 | 3,424 |
| フジシルインターナショナル | 2 | 4 | 9,084 |
| タカラトミー | 5 | 6 | 8,266 |
| 廣済堂 | 3 | 3 | 1,173 |
| As-meエステール | - | 1 | 1,176 |
| アーク | - | 9 | 1,058 |
| タカノ | - | 1 | 1,398 |
| プロネクサス | 1 | 1 | 2,099 |
| ホクシン | 9 | 5 | 1,298 |
| ウッドワン | 4 | - | - |
| 大建工業 | 7 | 1 | 2,611 |
| 凸版印刷 | 49 | 50 | 56,450 |
| 大日本印刷 | 52 | 51 | 60,486 |
| 図書印刷 | 3 | 3 | 1,446 |
| 共同印刷 | 6 | 5 | 1,920 |
| 日本写真印刷 | 2 | 3 | 9,975 |
| 光村印刷 | 5 | 5 | 1,335 |
| 宝印刷 | 0.800 | 0.900 | 1,421 |
| アシックス | 16 | 17 | 34,425 |
| ツツミ | 0.900 | 0.700 | 1,481 |
| 小松ウオール工業 | 0.600 | 0.600 | 1,165 |
| ヤマハ | 12 | 12 | 35,184 |
| 河合楽器製作所 | 0.600 | 0.700 | 1,610 |
| クリナップ | 2 | 2 | 1,751 |
| ピジョン | 9 | 10 | 33,437 |
| キングジム | 1 | 1 | 1,285 |
| リンテック | 4 | 4 | 10,395 |
| イトーキ | 3 | 3 | 2,693 |
| 任天堂 | 10 | 10 | 251,735 |
| 三菱鉛筆 | 1 | 1 | 8,460 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|---------------------|---------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 千円 |
| タカラスタンダード | 7 | 3 | 7,081 |
| コクヨ | 9 | 9 | 14,324 |
| グロープライド | 0.800 | 0.900 | 1,620 |
| 岡村製作所 | 6 | 6 | 6,330 |
| 美津濃 | 9 | 10 | 6,050 |
| アデランス | 3 | - | - |
| 電気・ガス業(1.8%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 148 | 150 | 65,253 |
| 中部電力 | 53 | 58 | 86,784 |
| 関西電力 | 71 | 72 | 90,117 |
| 中国電力 | 24 | 24 | 30,085 |
| 北陸電力 | 17 | 17 | 19,435 |
| 東北電力 | 43 | 44 | 63,936 |
| 四国電力 | 15 | 16 | 17,488 |
| 九州電力 | 38 | 39 | 48,725 |
| 北海道電力 | 16 | 16 | 13,396 |
| 沖縄電力 | 1 | 2 | 6,796 |
| 電源開発 | 14 | 14 | 37,929 |
| エフオン | - | 1 | 1,201 |
| イーレックス | 0.300 | 0.700 | 2,569 |
| 東京瓦斯 | 195 | 190 | 98,078 |
| 大阪瓦斯 | 181 | 172 | 74,218 |
| 東邦瓦斯 | 44 | 45 | 35,730 |
| 北海道瓦斯 | 4 | 4 | 1,112 |
| 広島ガス | 3 | 3 | 1,339 |
| 西部瓦斯 | 20 | 20 | 5,240 |
| 静岡ガス | 5 | 5 | 3,965 |
| メタウォーター | 1 | 1 | 2,945 |
| 陸運業(4.1%) | | | |
| SBSホールディングス | 1 | 1 | 1,499 |
| 東武鉄道 | 93 | 95 | 54,435 |
| 相鉄ホールディングス | 30 | 28 | 15,904 |
| 東京急行電鉄 | 102 | 96 | 79,296 |
| 京浜急行電鉄 | 48 | 49 | 59,829 |
| 小田急電鉄 | 56 | 28 | 63,612 |
| 京王電鉄 | 49 | 50 | 44,150 |
| 京成電鉄 | 26 | 13 | 35,298 |
| 富士急行 | 5 | 5 | 5,055 |
| 新京成電鉄 | 2 | 1 | 420 |
| 東日本旅客鉄道 | 31 | 34 | 353,460 |
| 西日本旅客鉄道 | 16 | 17 | 125,685 |
| 東海旅客鉄道 | 15 | 14 | 275,576 |
| 西武ホールディングス | 13 | 24 | 48,142 |
| 鴻池運輸 | 2 | 2 | 3,562 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|-----------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 西日本鉄道 | 23 | 21 | 10,269 |
| ハマキョウレックス | 1 | 1 | 2,499 |
| サカイ引越センター | 0.700 | 0.600 | 1,860 |
| 近鉄グループホールディングス | 176 | 179 | 75,180 |
| 阪急阪神ホールディングス | 117 | 22 | 84,224 |
| 南海電気鉄道 | 39 | 38 | 20,976 |
| 京阪ホールディングス | 39 | 40 | 28,680 |
| 神戸電鉄 | 4 | 4 | 1,524 |
| 名古屋鉄道 | 64 | 65 | 33,930 |
| 山陽電気鉄道 | 6 | 6 | 3,642 |
| 日本通運 | 68 | 69 | 39,261 |
| ヤマトホールディングス | 32 | 31 | 71,502 |
| 山九 | 23 | 23 | 16,468 |
| 丸全昭和運輸 | 6 | 6 | 2,694 |
| センコー | 8 | 8 | 5,760 |
| トナミホールディングス | 4 | 4 | 1,408 |
| ニッコンホールディングス | 5 | 6 | 14,460 |
| 日本石油輸送 | 4 | - | - |
| 福山通運 | 11 | 11 | 7,139 |
| セイノーホールディングス | 12 | 12 | 15,600 |
| 神奈川中央交通 | 2 | 2 | 1,444 |
| 日立物流 | 3 | 3 | 8,680 |
| 丸和運輸機関 | - | 0.400 | 1,028 |
| C&Fロジホールディングス | 1 | 1 | 2,838 |
| 九州旅客鉄道 | - | 13 | 44,682 |
| 海運業(0.2%) | | | |
| 日本郵船 | 157 | 151 | 37,297 |
| 商船三井 | 86 | 94 | 34,216 |
| 川崎汽船 | 77 | 68 | 20,128 |
| N Sユナイテッド海運 | 8 | 8 | 1,840 |
| 飯野海運 | 9 | 9 | 4,692 |
| 乾汽船 | 1 | 1 | 1,290 |
| 空運業(0.6%) | | | |
| 日本航空 | 33 | 32 | 117,120 |
| ANAホールディングス | 324 | 330 | 108,042 |
| パスコ | 2 | 1 | 412 |
| 倉庫・運輸関連業(0.2%) | | | |
| トランコム | 0.500 | 0.500 | 2,750 |
| 日新 | 7 | 7 | 2,548 |
| 三菱倉庫 | 12 | 12 | 18,984 |
| 三井倉庫ホールディングス | 10 | 10 | 3,350 |
| 住友倉庫 | 13 | 13 | 8,242 |
| 澁澤倉庫 | 5 | 5 | 1,755 |
| 日本トランスシティ | 4 | 4 | 1,844 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|----------------|-------|--------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ケイヒン | 7 | 8 | 1,256 |
| 中央倉庫 | 1 | 1 | 1,205 |
| 安田倉庫 | 1 | 1 | 1,251 |
| 東洋埠頭 | 7 | 2 | 378 |
| 宇徳 | 3 | 2 | 1,187 |
| 上組 | 21 | 21 | 22,155 |
| キューソー流通システム | 0.500 | 0.600 | 1,586 |
| 郵船ロジスティクス | 1 | 1 | 1,883 |
| 近鉄エクスプレス | 3 | 3 | 5,446 |
| エアイテイ | 1 | 1 | 1,314 |
| 内外トランスライン | 0.700 | 1 | 1,314 |
| 情報・通信業(7.8%) | | | |
| NECネットエスアイ | 2 | 1 | 4,035 |
| システナ | 1 | 1 | 2,282 |
| デジタルアーツ | 0.800 | 0.800 | 2,648 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 2 | 2 | 6,626 |
| コア | 0.800 | 1 | 1,385 |
| T I S | 5 | 5 | 15,636 |
| 電算システム | 0.700 | - | - |
| グリー | 10 | 10 | 7,211 |
| コエーテックホールディングス | 4 | 4 | 9,156 |
| 三菱総合研究所 | 0.700 | 0.700 | 2,229 |
| ボルテージ | - | 1 | 1,206 |
| 電算 | 0.400 | 0.500 | 1,216 |
| A G S | 1 | 0.900 | 1,724 |
| ファインデックス | 1 | 1 | 1,251 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 0.600 | 0.800 | 1,340 |
| K L a b | 2 | 3 | 2,666 |
| ポルトウイン・ビクトルホールディングス | 1 | 1 | 1,426 |
| ネクソン | 16 | 19 | 36,960 |
| アイスタイル | 2 | 2 | 2,643 |
| エムアップ | 2 | 2 | 1,802 |
| エイチーム | 0.700 | 1 | 2,136 |
| テクノスジャパン | - | 1 | 1,736 |
| コロプラ | 4 | 4 | 5,022 |
| ブロードリーフ | 1 | 4 | 2,721 |
| ハーツユナイテッドグループ | 0.500 | 0.900 | 1,353 |
| メディアドゥ | - | 0.500 | 858 |
| ブイキューブ | 0.800 | 1 | 1,119 |
| サイバーリンクス | - | 1 | 1,254 |
| オプティム | - | 0.200 | 1,052 |
| ティーガイア | 1 | 1 | 3,172 |
| 豆蔵ホールディングス | - | 1 | 1,150 |
| テクマトリックス | 0.700 | 0.600 | 1,543 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|----------------|-------|--------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カホー・オンライン・エンターテイメント | 30 | 36 | 9,420 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 1 | 1 | 9,072 |
| ザッパラス | 2 | 2 | 1,279 |
| インターネットイニシアティブ | 2 | 2 | 5,267 |
| さくらインターネット | 0.800 | 1 | 1,479 |
| SRAホールディングス | 1 | 0.900 | 2,515 |
| 朝日ネット | - | 2 | 1,312 |
| コムチュア | - | 0.400 | 1,408 |
| gumi | 1 | 1 | 2,257 |
| パイプドHD | 0.900 | 1 | 1,219 |
| LINE | - | 2 | 10,266 |
| AOI TYO HOLDINGS | - | 1 | 1,178 |
| フェイス | 0.800 | - | - |
| 野村総合研究所 | 12 | 13 | 51,024 |
| サイバネットシステム | 1 | 1 | 1,563 |
| CEホールディングス | - | 1 | 1,248 |
| インテージホールディングス | 0.900 | 1 | 2,172 |
| 東邦システムサイエンス | 1 | 1 | 1,164 |
| フォーカスシステムズ | - | 2 | 1,293 |
| クレスコ | 0.600 | 0.500 | 1,246 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 17 | 18 | 28,127 |
| オービック | 5 | 6 | 32,100 |
| ジャストシステム | 3 | 2 | 3,402 |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 0.900 | 1 | 1,370 |
| ヤフー | 123 | 125 | 66,191 |
| トレンドマイクロ | 8 | 9 | 45,012 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 1 | - | - |
| 日本オラクル | 2 | 2 | 18,480 |
| アルファシステムズ | 0.600 | 0.600 | 1,185 |
| フューチャー | 2 | 2 | 2,157 |
| CAC Holdings | 1 | 1 | 1,519 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 0.800 | 0.400 | 1,650 |
| トーセ | 1 | 1 | 1,243 |
| オービックビジネスコンサルタント | 0.900 | 0.900 | 5,004 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 3 | 4 | 12,600 |
| アイティフォー | 2 | 2 | 1,506 |
| 東計電算 | 0.500 | - | - |
| 大塚商会 | 4 | 4 | 27,683 |
| サイボウズ | 3 | 2 | 1,196 |
| 電通国際情報サービス | 1 | 1 | 2,440 |
| デジタルガレージ | - | 2 | 5,567 |
| イーエムシステムズ | 0.400 | 0.700 | 1,138 |
| ウェザーニューズ | 0.600 | 0.600 | 2,139 |
| C I J | 2 | 2 | 1,223 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|----------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 0.700 | 0.800 | 1,236 |
| 日本エンタープライズ | 3 | 4 | 1,208 |
| WOWOW | 0.800 | 0.800 | 2,936 |
| スカラ | - | 1 | 1,285 |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 2 | 1 | 1,429 |
| ネットワンシステムズ | 7 | 7 | 6,710 |
| アルゴグラフィックス | 0.800 | 0.800 | 1,970 |
| マーベラス | 2 | 3 | 2,892 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 3 | 3 | 5,152 |
| 日本ユニシス | 4 | 4 | 7,296 |
| 兼松エレクトロニクス | 1 | 1 | 2,834 |
| 東京放送ホールディングス | 10 | 11 | 23,710 |
| 日本テレビホールディングス | 15 | 16 | 32,320 |
| 朝日放送 | 1 | 1 | 1,326 |
| テレビ朝日ホールディングス | 4 | 4 | 11,102 |
| スカパーJ SATホールディングス | 13 | 11 | 5,700 |
| テレビ東京ホールディングス | 1 | 1 | 3,603 |
| U-NEXT | - | 1 | 1,864 |
| ワイヤレスゲート | - | 0.700 | 1,078 |
| コネクシオ | 1 | 1 | 2,353 |
| 日本通信 | 9 | 14 | 2,646 |
| 日本電信電話 | 133 | 140 | 671,279 |
| KDDI | 175 | 173 | 509,015 |
| 光通信 | 2 | 2 | 23,037 |
| NTTドコモ | 132 | 131 | 352,521 |
| エムティーアイ | 2 | 2 | 1,852 |
| GMOインターネット | 6 | 6 | 9,740 |
| カドカワ | 5 | 5 | 8,262 |
| 学研ホールディングス | 6 | 6 | 1,848 |
| ゼンリン | 2 | 2 | 5,046 |
| 昭文社 | 1 | 1 | 1,278 |
| インプレスホールディングス | 7 | 8 | 1,205 |
| アイネット | 1 | 1 | 1,350 |
| 松竹 | 11 | 12 | 15,828 |
| 東宝 | 12 | 11 | 37,490 |
| 東映 | 6 | 7 | 7,028 |
| AOI Pro. | 1 | - | - |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 10 | 10 | 57,888 |
| DTTS | 1 | 1 | 4,656 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 7 | 6 | 22,813 |
| シーイーシー | 1 | 1 | 1,839 |
| カプコン | 4 | 4 | 9,803 |
| ジャステック | 1 | 1 | 1,138 |
| SCSK | 4 | 4 | 19,992 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------|-------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本システムウエア | — | 0.800 | 1,291 |
| アイネス | 2 | 2 | 2,516 |
| T K C | 1 | 1 | 5,472 |
| 富士ソフト | 2 | 2 | 7,342 |
| N S D | 3 | 3 | 6,478 |
| コナミホールディングス | 7 | 7 | 36,379 |
| 福井コンピュータホールディングス | 1 | 0.500 | 1,415 |
| J B C Cホールディングス | 1 | 1 | 1,289 |
| ミロク情報サービス | 1 | 1 | 2,325 |
| ソフトバンクグループ | 97 | 78 | 693,452 |
| 卸売業(4.6%) | | | |
| 高千穂交易 | 1 | 1 | 1,264 |
| 伊藤忠食品 | 0.500 | 0.400 | 1,806 |
| エレマテック | 0.800 | 0.700 | 1,373 |
| J A L U X | 0.600 | 0.600 | 1,330 |
| あらた | 0.800 | 0.800 | 2,271 |
| トーメンデバイス | 0.600 | 0.600 | 1,296 |
| 東京エレクトロン デバイス | 0.600 | 0.800 | 1,279 |
| フィールズ | 1 | 1 | 1,625 |
| 双日 | 108 | 103 | 30,222 |
| アルフレッサ ホールディングス | 21 | 20 | 41,379 |
| 横浜冷凍 | 4 | 4 | 4,536 |
| 山下医科器械 | 0.600 | — | — |
| ラサ商事 | 1 | 2 | 1,392 |
| アルコニックス | 1 | 1 | 1,779 |
| 神戸物産 | 1 | 0.900 | 3,379 |
| あい ホールディングス | 3 | 3 | 6,971 |
| ダイワボウホールディングス | 16 | 15 | 4,425 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 3 | 3 | 5,392 |
| バイタルケ-エスケ-ホールディングス | 3 | 3 | 3,346 |
| 八洲電機 | — | 1 | 1,223 |
| U K Cホールディングス | 1 | 1 | 2,461 |
| O C H Iホールディングス | 1 | 0.900 | 1,222 |
| T O K A Iホールディングス | 7 | 7 | 6,452 |
| 三洋貿易 | 0.900 | 1 | 1,817 |
| ウイン・パートナーズ | — | 1 | 1,284 |
| シップヘルスケアホールディングス | 3 | 3 | 10,125 |
| コメダホールディングス | — | 2 | 4,620 |
| 富士興産 | — | 2 | 1,287 |
| 協栄産業 | 8 | 8 | 1,376 |
| 小野建 | 1 | 1 | 2,131 |
| 佐鳥電機 | 1 | 1 | 1,276 |
| エコートレーディング | 1 | 1 | 1,267 |
| 伯東 | 1 | 1 | 1,292 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------|-------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| コンドーテック | 1 | 1 | 1,223 |
| ナガイレーベン | 2 | 2 | 6,177 |
| 三菱食品 | 1 | 1 | 6,593 |
| 松田産業 | 1 | 1 | 2,074 |
| 第一興商 | 3 | 2 | 13,731 |
| メディパルホールディングス | 17 | 17 | 32,165 |
| 萩原電気 | — | 0.600 | 1,306 |
| アズワン | 1 | 1 | 7,014 |
| 尾家産業 | 1 | 1 | 1,280 |
| シモジマ | 1 | 1 | 1,318 |
| ドウシシャ | 2 | 2 | 4,473 |
| 小津産業 | 0.500 | — | — |
| 高速 | 1 | 1 | 1,226 |
| 黒田電気 | 3 | 2 | 5,484 |
| 丸文 | 1 | 1 | 1,323 |
| ハピネット | 1 | 1 | 2,187 |
| 橋本総業ホールディングス | 0.600 | 0.800 | 1,201 |
| 日本ライフライン | — | 1 | 3,060 |
| エクセル | 0.800 | 0.800 | 1,199 |
| マルカキカイ | 0.700 | — | — |
| I D O M | 4 | 4 | 3,525 |
| 日本エム・ディ・エム | — | 1 | 1,071 |
| 進和 | 1 | 1 | 1,783 |
| エスケイジャパン | 2 | 4 | 1,228 |
| シークス | 1 | 1 | 5,512 |
| 田中商事 | 1 | 1 | 1,230 |
| オーハシテクニカ | 1 | 1 | 1,439 |
| 白銅 | 1 | 0.800 | 1,428 |
| 伊藤忠商事 | 135 | 128 | 209,163 |
| 丸紅 | 169 | 172 | 125,994 |
| 長瀬産業 | 10 | 10 | 17,314 |
| 蝶理 | 1 | 1 | 2,197 |
| 豊田通商 | 19 | 19 | 65,032 |
| 三共生興 | 2 | 2 | 1,200 |
| 兼松 | 37 | 37 | 7,215 |
| ツカモトコーポレーション | 9 | — | — |
| 三井物産 | 155 | 158 | 269,925 |
| 日本紙パルプ商事 | 9 | 9 | 3,348 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 6 | 6 | 29,371 |
| カメイ | 2 | 2 | 3,116 |
| 東都水産 | 6 | 0.300 | 589 |
| スターゼン | 0.600 | 0.700 | 3,419 |
| 山善 | 6 | 6 | 7,128 |
| 椿本興業 | 3 | — | — |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|-----------------|-------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 住友商事 | 108 | 110 | 164,992 |
| 内田洋行 | 4 | 0.900 | 2,300 |
| 三菱商事 | 129 | 131 | 343,149 |
| 第一実業 | 4 | 4 | 3,132 |
| キャノンマーケティングジャパン | 4 | 5 | 11,400 |
| 西華産業 | 6 | 6 | 2,184 |
| 佐藤商事 | 1 | 1 | 1,408 |
| 菱洋エレクトロ | 2 | 1 | 2,696 |
| 東京産業 | 2 | 2 | 1,232 |
| ユアサ商事 | 1 | 1 | 5,576 |
| 神鋼商事 | 5 | 0.500 | 1,233 |
| 小林産業 | 5 | 4 | 1,301 |
| 阪和興業 | 17 | 18 | 14,022 |
| カナデン | 1 | 1 | 1,781 |
| 菱電商事 | 3 | 3 | 2,205 |
| フルサト工業 | 0.900 | 1 | 1,737 |
| 岩谷産業 | 20 | 19 | 12,635 |
| すてきナイスグループ | 7 | 8 | 1,216 |
| 昭光通商 | 13 | 12 | 1,212 |
| イワキ | 5 | - | - |
| 三菱石油 | 4 | 4 | 4,201 |
| 稲畑産業 | 4 | 4 | 6,346 |
| 明和産業 | - | 3 | 1,317 |
| ワキタ | 3 | 3 | 3,966 |
| 東邦ホールディングス | 5 | 5 | 13,882 |
| サンゲツ | 6 | 6 | 11,574 |
| ミウログループホールディングス | 2 | 2 | 2,083 |
| シナネンホールディングス | 4 | 0.800 | 1,838 |
| 伊藤忠エネクス | 4 | 3 | 3,681 |
| サンリオ | 5 | 5 | 11,826 |
| サンワ テクノス | 1 | 1 | 1,405 |
| リョーサン | 2 | 2 | 9,555 |
| 新光商事 | 2 | 1 | 2,565 |
| トーホー | 0.800 | 0.800 | 2,028 |
| 三信電気 | 2 | 1 | 2,565 |
| 東陽テクニカ | 2 | 2 | 2,343 |
| モスフードサービス | 2 | 2 | 7,659 |
| 加賀電子 | 1 | 1 | 3,267 |
| ソーダニッカ | 2 | 2 | 1,248 |
| 立花エレテック | 1 | 1 | 1,586 |
| PAL TAC | 2 | 2 | 8,778 |
| 三谷産業 | 3 | 3 | 1,250 |
| ヤマタネ | 8 | 0.900 | 1,465 |
| 日鉄住金物産 | 11 | 1 | 7,335 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|-----------------|-------|-------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トラスコ中山 | 2 | 4 | 10,272 |
| オートバックスセブン | 6 | 6 | 11,713 |
| 加藤産業 | 2 | 2 | 7,916 |
| イノテック | 2 | 2 | 1,461 |
| イエローハット | 1 | 1 | 4,741 |
| J Kホールディングス | 2 | 2 | 1,344 |
| 日伝 | 0.700 | 0.700 | 2,450 |
| 北沢産業 | 6 | 6 | 1,335 |
| 杉本商事 | 1 | 1 | 1,558 |
| 因幡電機産業 | 2 | 2 | 10,000 |
| パイテックホールディングス | 1 | 1 | 1,375 |
| ミスミグループ本社 | 19 | 19 | 40,877 |
| タキヒヨー | 3 | 3 | 1,449 |
| スズケン | 7 | 8 | 30,680 |
| ジェコス | 1 | 1 | 1,356 |
| ルネサスイーストン | 2 | 2 | 1,353 |
| 小売業(4.6%) | | | |
| ローソン | 6 | 6 | 48,861 |
| サンエー | 1 | 1 | 6,721 |
| カワチ薬品 | 1 | 1 | 4,195 |
| エービーシー・マート | 2 | 3 | 21,472 |
| ハードオフコーポレーション | 0.800 | - | - |
| アスクル | 2 | 2 | 6,961 |
| ゲオホールディングス | 3 | 2 | 3,958 |
| アダストリア | 1 | 2 | 7,981 |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 12 | - | - |
| くらコーポレーション | 1 | 1 | 5,104 |
| キャンドゥ | 0.900 | 0.900 | 1,632 |
| パルグループホールディングス | 1 | 0.900 | 2,501 |
| エディオン | 7 | 6 | 7,004 |
| サーラコーポレーション | - | 2 | 1,375 |
| ワッツ | 1 | 1 | 1,426 |
| ハローズ | 0.500 | 0.600 | 1,415 |
| あみやき亭 | 0.300 | 0.400 | 1,628 |
| ひらまつ | 2 | 2 | 1,584 |
| ゲンキー | 0.400 | 0.400 | 2,576 |
| 大黒天物産 | 0.400 | 0.400 | 2,012 |
| ハニーズ | 1 | 1 | 1,669 |
| ファーマライズホールディングス | 2 | 2 | 1,236 |
| アルペン | 1 | 1 | 3,142 |
| クオール | 1 | 2 | 3,068 |
| ジェイアイエヌ | 1 | 1 | 7,164 |
| ビックカメラ | 8 | 10 | 10,847 |
| DCMホールディングス | 8 | 10 | 10,525 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| MonotaRO | 6 | 6 | 20,057 |
| ダイヤモンドダイニング | - | 0.900 | 1,509 |
| きちり | 0.100 | 1 | 1,254 |
| アークランドサービスホールディングス | 0.500 | 0.500 | 1,602 |
| J. フロント リテイリング | 21 | 22 | 38,184 |
| ドトール・日レスホールディングス | 3 | 3 | 6,940 |
| マツモトキヨシホールディングス | 3 | 3 | 17,424 |
| ブロンコビリー | 0.700 | 0.900 | 2,523 |
| スタートトゥデイ | 5 | 16 | 39,792 |
| 物語コーポレーション | 0.500 | 0.500 | 2,230 |
| ココカラファイン | 1 | 1 | 8,424 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 34 | 34 | 48,266 |
| ウエルシアホールディングス | 1 | 1 | 10,693 |
| クリエイトSDホールディングス | 2 | 2 | 6,687 |
| チムニー | 0.400 | 0.500 | 1,429 |
| ジョイフル本田 | 2 | 2 | 9,702 |
| 鳥貴族 | - | 0.500 | 1,213 |
| キリン堂ホールディングス | 1 | 1 | 1,194 |
| ホットランド | - | 1 | 1,135 |
| すかいらーく | 5 | 7 | 12,030 |
| 綿半ホールディングス | - | 0.800 | 1,296 |
| ヨシックス | - | 0.900 | 1,188 |
| 3dイット・スーパーマーケット・ホールディングス | 5 | 5 | 5,858 |
| ブックオフコーポレーション | 1 | 1 | 1,285 |
| あさひ | 1 | 1 | 1,704 |
| 日本調剤 | 0.400 | 0.600 | 2,238 |
| コスモス薬品 | 0.900 | 0.900 | 19,089 |
| 一六堂 | 2 | - | - |
| セブン&アイ・ホールディングス | 72 | 73 | 323,033 |
| 薬王堂 | 0.400 | 0.900 | 2,185 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 1 | 4 | 4,845 |
| ツルハホールディングス | 4 | 4 | 41,920 |
| サンマルクホールディングス | 1 | 1 | 3,839 |
| トリドールホールディングス | 2 | 2 | 5,205 |
| クスリのアオキ | 1 | - | - |
| パロックジャパンリミテッド | - | 1 | 1,405 |
| クスリのアオキホールディングス | - | 1 | 7,640 |
| メディカルシステムネットワーク | 2 | 2 | 1,271 |
| 総合メディカル | 0.800 | 0.800 | 3,196 |
| はるやまホールディングス | 1 | 1 | 1,374 |
| ノジマ | - | 2 | 2,812 |
| カッパ・クリエイト | 2 | 2 | 3,197 |
| ライトオン | 1 | 1 | 1,277 |
| ジーンズメイト | - | 4 | 1,087 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|----------------|-------|--------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 良品計画 | 2 | 2 | 51,589 |
| 三城ホールディングス | 2 | 2 | 1,237 |
| アドヴァン | 1 | 1 | 2,086 |
| アルビス | - | 0.500 | 1,627 |
| コナカ | 2 | 2 | 1,320 |
| ハウス オブ ローゼ | 0.700 | 0.800 | 1,240 |
| イオン北海道 | 1 | 2 | 1,234 |
| コジマ | 4 | - | - |
| ヒマラヤ | 1 | 1 | 1,199 |
| コーナン商事 | 2 | 2 | 5,455 |
| エコス | 0.800 | 1 | 1,210 |
| ワタミ | 2 | 2 | 2,402 |
| マルシェ | 1 | 1 | 1,260 |
| ドンキホーテホールディングス | 11 | 11 | 44,465 |
| 西松屋チェーン | 3 | 3 | 4,030 |
| ゼンショーホールディングス | 8 | 9 | 17,235 |
| 幸楽苑ホールディングス | 1 | 1 | 1,844 |
| サイゼリヤ | 2 | 2 | 7,656 |
| VTホールディングス | 5 | 5 | 3,091 |
| 魚力 | - | 0.900 | 1,170 |
| ユナイテッドアローズ | 2 | 2 | 8,038 |
| ハイデイ日高 | 1 | 1 | 4,624 |
| 京都きもの友禅 | 1 | 1 | 1,194 |
| コロワイド | 5 | 5 | 10,822 |
| ピーシーデポコーポレーション | 1 | 2 | 1,285 |
| 壱番屋 | 0.800 | 1 | 6,040 |
| トップカルチャー | 2 | 2 | 1,205 |
| P L A N T | 0.800 | 1 | 1,198 |
| スギホールディングス | 3 | 3 | 20,330 |
| スクロール | 2 | 3 | 1,267 |
| ヨンドシーホールディングス | 1 | 1 | 3,324 |
| エー・ファミリーマートホールディングス | 5 | 7 | 54,285 |
| 木曽路 | 2 | 2 | 4,974 |
| サトレストランシステムズ | 2 | 2 | 1,816 |
| 千趣会 | 3 | 3 | 2,540 |
| ケーヨー | 2 | 3 | 1,755 |
| 上新電機 | 4 | 4 | 4,356 |
| 日本瓦斯 | 2 | 3 | 10,704 |
| ベスト電器 | 8 | - | - |
| ロイヤルホールディングス | 2 | 2 | 5,834 |
| 東天紅 | 7 | 7 | 1,183 |
| いなげや | 1 | 1 | 2,977 |
| 島忠 | 4 | 4 | 12,798 |
| チヨダ | 2 | 2 | 5,768 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ライフコーポレーション | 1 | 1 | 4,309 |
| リンガーハット | 1 | 2 | 4,586 |
| MR MAX | 3 | - | - |
| テナライド | 2 | 3 | 1,260 |
| AOKIホールディングス | 3 | 3 | 4,973 |
| オークワ | 3 | 2 | 2,236 |
| コメリ | 2 | 2 | 7,398 |
| 青山商事 | 3 | 3 | 15,355 |
| しまむら | 2 | 2 | 29,040 |
| はせがわ | - | 2 | 1,206 |
| 高島屋 | 25 | 29 | 29,000 |
| 松屋 | 3 | 3 | 3,826 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 8 | 9 | 16,830 |
| 近鉄百貨店 | 7 | 7 | 2,499 |
| ニッセンホールディングス | 6 | - | - |
| パルコ | 1 | 1 | 1,934 |
| 丸井グループ | 21 | 18 | 28,722 |
| アクシアル リテイリング | 1 | 1 | 6,300 |
| イオン | 70 | 72 | 122,786 |
| ユニグループ・ホールディングス | 16 | - | - |
| イズミ | 3 | 3 | 17,167 |
| 平和堂 | 3 | 3 | 9,648 |
| フジ | 1 | 1 | 4,561 |
| ヤオコー | 2 | 2 | 9,120 |
| ゼビオホールディングス | 2 | 2 | 4,308 |
| ケーズホールディングス | 3 | 8 | 16,912 |
| Olympicグループ | 1 | 1 | 1,210 |
| アインホールディングス | 2 | 2 | 17,913 |
| 元気寿司 | 0.500 | 0.600 | 1,361 |
| ヤマダ電機 | 52 | 58 | 33,812 |
| アークランドサカモト | 2 | 3 | 4,269 |
| ニトリホールディングス | 7 | 7 | 93,100 |
| グルメ杵屋 | 1 | 1 | 1,041 |
| 愛眼 | 4 | 6 | 1,221 |
| ケーユーホールディングス | - | 1 | 1,371 |
| 吉野家ホールディングス | 6 | 6 | 10,162 |
| 松屋フーズ | 0.800 | 0.800 | 3,336 |
| サガミチェーン | 2 | 2 | 3,027 |
| 関西スーパーマーケット | 1 | 1 | 2,147 |
| 王将フードサービス | 1 | 1 | 5,518 |
| プレナス | 1 | 2 | 4,990 |
| ミニストップ | 1 | 1 | 2,815 |
| アークス | 3 | 3 | 8,530 |
| パローホールディングス | 3 | 3 | 10,541 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------|----------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 藤久 | 0.600 | 0.700 | 1,221 |
| ベルク | 0.800 | 0.800 | 3,624 |
| 大 庄 | 0.800 | 0.900 | 1,435 |
| ファーストリテイリング | 3 | 2 | 101,471 |
| サンドラッグ | 3 | 3 | 24,552 |
| サックスパー ホールディングス | 1 | 1 | 2,008 |
| やまや | 0.100 | 0.700 | 1,204 |
| ペルーナ | 4 | 4 | 3,735 |
| 銀行業(8.7%) | | | |
| 島根銀行 | 0.800 | 0.900 | 1,269 |
| じもとホールディングス | 12 | 12 | 2,469 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 12 | 84 | 41,236 |
| 東京TYフィナンシャルグループ | 2 | 2 | 10,000 |
| 九州フィナンシャルグループ | 26 | 28 | 22,787 |
| ゆうちょ銀行 | 33 | 49 | 70,680 |
| 富山第一銀行 | - | 4 | 2,479 |
| コンコディア・フィナンシャルグループ | - | 114 | 70,475 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | - | 11 | 14,982 |
| 新生銀行 | 149 | 167 | 34,903 |
| あおぞら銀行 | 109 | 111 | 46,287 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 1,382 | 1,328 | 1,019,945 |
| りそなホールディングス | 201 | 205 | 129,089 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 360 | 36 | 154,635 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 138 | 140 | 638,679 |
| 第四銀行 | 22 | 21 | 11,277 |
| 北越銀行 | 19 | 1 | 5,213 |
| 西日本シティ銀行 | 56 | - | - |
| 千葉銀行 | 66 | 68 | 53,584 |
| 横浜銀行 | 116 | - | - |
| 常陽銀行 | 62 | - | - |
| 群馬銀行 | 38 | 39 | 26,130 |
| 武蔵野銀行 | 2 | 2 | 10,388 |
| 千葉興業銀行 | 4 | 4 | 3,024 |
| 筑波銀行 | 7 | 7 | 2,576 |
| 七十七銀行 | 27 | 27 | 14,526 |
| 青森銀行 | 13 | 14 | 5,516 |
| 秋田銀行 | 11 | 11 | 4,048 |
| 山形銀行 | 10 | 10 | 4,950 |
| 岩手銀行 | 1 | 1 | 5,263 |
| 東邦銀行 | 15 | 16 | 7,056 |
| 東北銀行 | 9 | 9 | 1,440 |
| みちのく銀行 | 9 | 9 | 1,719 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 75 | 71 | 35,855 |
| 静岡銀行 | 51 | 48 | 48,864 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当期末 | | |
|-----------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 十六銀行 | 22 | 24 | 9,912 |
| スルガ銀行 | 16 | 17 | 45,859 |
| 八十二銀行 | 31 | 33 | 24,437 |
| 山梨中央銀行 | 11 | 11 | 6,127 |
| 大垣共立銀行 | 23 | 23 | 10,419 |
| 福井銀行 | 15 | 15 | 4,260 |
| 北國銀行 | 19 | 19 | 9,101 |
| 清水銀行 | 0.600 | 0.600 | 2,268 |
| 富山銀行 | 0.300 | 0.300 | 1,254 |
| 滋賀銀行 | 16 | 16 | 10,144 |
| 南都銀行 | 17 | 1 | 8,041 |
| 百五銀行 | 15 | 16 | 8,320 |
| 京都銀行 | 33 | 31 | 29,884 |
| 紀陽銀行 | 6 | 6 | 12,691 |
| 三重銀行 | 8 | 0.800 | 2,024 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 117 | 11 | 24,020 |
| 広島銀行 | 51 | 52 | 28,600 |
| 山陰合同銀行 | 10 | 10 | 10,804 |
| 中国銀行 | 12 | 12 | 22,481 |
| 鳥取銀行 | 6 | 0.600 | 1,161 |
| 伊予銀行 | 18 | 18 | 15,745 |
| 百十四銀行 | 19 | 19 | 7,619 |
| 四国銀行 | 13 | 14 | 4,410 |
| 阿波銀行 | 14 | 15 | 11,400 |
| 大分銀行 | 10 | 10 | 4,500 |
| 宮崎銀行 | 11 | 12 | 4,536 |
| 佐賀銀行 | 10 | 11 | 3,443 |
| 十八銀行 | 11 | 11 | 4,004 |
| 沖繩銀行 | 1 | 1 | 7,191 |
| 琉球銀行 | 3 | 3 | 5,986 |
| セブン銀行 | 64 | 65 | 21,746 |
| みずほフィナンシャルグループ | 2,427 | 2,380 | 500,773 |
| 山口フィナンシャルグループ | 16 | 17 | 22,457 |
| 長野銀行 | 6 | 0.700 | 1,415 |
| 名古屋銀行 | 14 | 1 | 6,547 |
| 北洋銀行 | 26 | 28 | 13,699 |
| 愛知銀行 | 0.600 | 0.600 | 4,272 |
| 第三銀行 | 10 | 1 | 1,757 |
| 中京銀行 | 7 | 0.700 | 1,613 |
| 東日本銀行 | 8 | - | - |
| 大光銀行 | 6 | 6 | 1,512 |
| 愛媛銀行 | 10 | 2 | 2,979 |
| トマト銀行 | 7 | - | - |
| みなと銀行 | 16 | 1 | 3,900 |

| 銘柄 | 当期末 | | |
|---------------------------|---------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 京葉銀行 | 14 | 14 | 7,672 |
| 関西アーバン銀行 | 2 | 2 | 3,789 |
| 栃木銀行 | 9 | 9 | 5,752 |
| 北日本銀行 | 0.500 | 0.500 | 1,585 |
| 東和銀行 | 24 | 33 | 4,191 |
| 福島銀行 | 21 | 19 | 1,843 |
| 大東銀行 | 10 | 9 | 1,548 |
| トモニホールディングス | 13 | 14 | 9,417 |
| フィデアホールディングス | 10 | 17 | 3,689 |
| 池田泉州ホールディングス | 18 | 18 | 9,690 |
| 証券、商品先物取引業(1.3%) | | | |
| F P G | 5 | 6 | 7,011 |
| S B Iホールディングス | 20 | 19 | 30,630 |
| ジャフコ | 2 | 2 | 11,426 |
| 大和証券グループ本社 | 161 | 164 | 116,604 |
| 野村ホールディングス | 331 | 358 | 268,800 |
| 岡三証券グループ | 15 | 15 | 11,370 |
| 丸三証券 | 5 | 5 | 5,387 |
| 東洋証券 | 7 | 6 | 1,632 |
| 野村ホールディングス | 19 | 20 | 13,004 |
| 光世証券 | 4 | 7 | 1,337 |
| 水戸証券 | 5 | 5 | 1,684 |
| いちよし証券 | 3 | 3 | 3,510 |
| 松井証券 | 8 | 10 | 9,330 |
| だいこう証券ビジネス | - | 2 | 1,278 |
| マネックスグループ | 20 | 18 | 5,527 |
| カブドットコム証券 | 15 | 13 | 5,122 |
| 極東証券 | 2 | 2 | 4,034 |
| 岩井コスモホールディングス | 1 | 1 | 1,881 |
| 藍澤証券 | 2 | 3 | 2,135 |
| マネースクウェアHD | 1 | - | - |
| マネーパートナーズグループ | 3 | 1 | 902 |
| 保険業(2.8%) | | | |
| かんぽ生命保険 | 5 | 6 | 18,348 |
| SOMPOホールディングス | 38 | 36 | 156,684 |
| アニコムホールディングス | 1 | 1 | 2,712 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 51 | 52 | 201,478 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 16 | 16 | 33,885 |
| 第一生命ホールディングス | 110 | 105 | 233,227 |
| 東京海上ホールディングス | 69 | 71 | 361,319 |
| T&Dホールディングス | 62 | 63 | 115,531 |
| アドバンスクリエイト | - | 0.500 | 1,041 |
| その他金融業(1.3%) | | | |
| 全国保証 | 4 | 4 | 17,738 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|-------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| クレディセゾン | 13 | 13 | 28,927 |
| アクリーティブ | — | 2 | 995 |
| 芙蓉総合リース | 2 | 2 | 10,600 |
| 興銀リース | 3 | 3 | 8,256 |
| 東京センチュリー | 4 | 3 | 13,650 |
| 日本証券金融 | 7 | 7 | 4,866 |
| アイフル | 28 | 29 | 10,437 |
| ポケットカード | 2 | 1 | 728 |
| リコーリース | 1 | 1 | 5,110 |
| イオンフィナンシャルサービス | 11 | 11 | 23,788 |
| アコム | 34 | 35 | 17,388 |
| ジャックス | 10 | 10 | 5,080 |
| オリエントコーポレーション | 74 | 37 | 8,148 |
| 日立キャピタル | 4 | 4 | 12,074 |
| アプラスフィナンシャル | 11 | 10 | 1,249 |
| オリックス | 122 | 124 | 218,664 |
| 三菱UFJリース | 43 | 44 | 27,590 |
| 日本取引所グループ | 50 | 54 | 87,309 |
| イー・ギャランティ | 0.600 | 0.500 | 1,306 |
| NECキャピタルソリューション | 0.700 | 0.700 | 1,276 |
| 不動産業(2.5%) | | | |
| いちご | 14 | 16 | 6,112 |
| 日本駐車場開発 | 18 | 21 | 3,228 |
| ビューリック | 35 | 36 | 39,820 |
| 野村不動産ホールディングス | 11 | 11 | 22,330 |
| 三重交通グループホールディングス | 3 | 3 | 1,209 |
| サムティ | — | 1 | 1,673 |
| 日本商業開発 | 0.600 | 1 | 1,942 |
| プレサンスコーポレーション | 0.600 | 2 | 3,939 |
| ユニゾホールディングス | 1 | 1 | 4,333 |
| THEグローバル社 | — | 2 | 1,225 |
| 日本管理センター | 1 | 1 | 1,803 |
| サンセイランディック | 1 | 1 | 1,288 |
| フージャースホールディングス | 2 | 2 | 1,409 |
| オープンハウス | 2 | 2 | 6,790 |
| 東急不動産ホールディングス | 41 | 42 | 27,772 |
| 飯田グループホールディングス | 16 | 14 | 26,557 |
| シーアールイー | — | 0.800 | 1,346 |
| パーク24 | 8 | 8 | 27,545 |
| パラカ | 0.800 | 0.600 | 1,194 |
| 三井不動産 | 91 | 93 | 243,892 |
| 三菱地所 | 128 | 130 | 293,605 |
| 平和不動産 | 3 | 3 | 5,319 |
| 東京建物 | 18 | 20 | 32,256 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|--------------------|----------------|-------|---------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ダイビル | 4 | 4 | 4,801 |
| 京阪神ビルディング | 2 | 2 | 1,899 |
| 住友不動産 | 41 | 42 | 136,332 |
| 大京 | 33 | 33 | 7,656 |
| テーオーシー | 6 | 6 | 6,555 |
| 東京楽天地 | 3 | 3 | 1,584 |
| レオパレス21 | 20 | 22 | 13,392 |
| スターツコーポレーション | 2 | 1 | 4,379 |
| フジ住宅 | 2 | 2 | 1,641 |
| 空港施設 | 2 | 2 | 1,245 |
| 明和地所 | 1 | 1 | 1,210 |
| 住友不動産販売 | 1 | 1 | 4,555 |
| ゴールドクレスト | 1 | 1 | 3,419 |
| 日本エスリード | 0.900 | 0.900 | 1,372 |
| 日神不動産 | 2 | 2 | 1,267 |
| タカラレーベン | 7 | 7 | 4,567 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 1 | 1 | 1,213 |
| イオンモール | 11 | 11 | 19,571 |
| ファースト住建 | 0.800 | 0.800 | 1,146 |
| トーセイ | 2 | 2 | 1,862 |
| 穴吹興産 | 4 | 0.500 | 1,334 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 10 | 10 | 11,477 |
| サンフロンティア不動産 | 2 | 1 | 1,949 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 2 | — | — |
| ランドビジネス | 3 | 4 | 1,271 |
| グランディハウス | 2 | 2 | 1,212 |
| 日本空港ビルデング | 5 | 5 | 22,148 |
| サービス業(3.6%) | | | |
| 日本工営 | 6 | 1 | 3,280 |
| ネクスト | 5 | 4 | 3,394 |
| ジェイエイシールートメント | — | 1 | 1,701 |
| 日本M&Aセンター | 2 | 5 | 18,549 |
| ノバレーゼ | 1 | — | — |
| アコーディア・ゴルフ | 7 | — | — |
| タケエイ | 1 | 1 | 1,640 |
| トラスト・テック | 0.400 | 0.800 | 1,376 |
| コシダカホールディングス | — | 0.600 | 1,489 |
| パソナグループ | 1 | 1 | 1,299 |
| リンクアンドモチベーション | 8 | 4 | 1,918 |
| GCA | 1 | 1 | 1,528 |
| エス・エム・エス | 2 | 2 | 6,671 |
| テンプホールディングス | 12 | 14 | 27,699 |
| リニカル | 1 | 1 | 1,587 |
| クックパッド | 4 | 4 | 3,997 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 千円 |
| アイ・ケイ・ケイ | 1 | 1 | 1,292 |
| 学情 | 1 | 1 | 1,204 |
| スタジオアリス | 0.800 | 0.800 | 1,799 |
| シミックホールディングス | 0.800 | 0.900 | 1,338 |
| N J S | 0.800 | 0.900 | 1,258 |
| 総合警備保障 | 6 | 6 | 29,444 |
| カカクコム | 13 | 13 | 21,291 |
| ルネサンス | 0.900 | 0.900 | 1,533 |
| ディップ | 2 | 2 | 5,570 |
| オプトホールディング | 1 | 1 | 1,582 |
| 新日本科学 | 2 | 2 | 1,180 |
| ツクイ | 2 | 4 | 3,005 |
| キャリアデザインセンター | 1 | 0.900 | 1,046 |
| エムスリー | 15 | 16 | 45,804 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 1 | 1 | 1,121 |
| アウトソーシング | 0.800 | 1 | 4,108 |
| ウェルネット | 0.700 | 1 | 1,810 |
| ディー・エヌ・エー | 8 | 8 | 20,442 |
| 博報堂DYホールディングス | 25 | 25 | 34,360 |
| ぐるなび | 2 | 2 | 5,985 |
| エスアールジータカミヤ | 3 | 2 | 1,170 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 4 | 5 | 1,265 |
| ファンコミュニケーションズ | 4 | 4 | 3,642 |
| WDBホールディングス | 1 | 1 | 1,368 |
| ティア | 1 | 1 | 1,322 |
| バリューコマース | 2 | - | - |
| インフォマート | 2 | 7 | 4,684 |
| J Pホールディングス | 4 | 5 | 1,367 |
| E P Sホールディングス | 2 | 2 | 3,507 |
| プレステージ・インターナショナル | 1 | 2 | 2,314 |
| アミューズ | 0.500 | 1 | 2,023 |
| ドリームインキュベータ | 0.600 | 0.600 | 1,272 |
| T A C | 5 | 5 | 1,236 |
| ケネディクス | 24 | 24 | 10,980 |
| 電通 | 20 | 20 | 123,579 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 2 | 1 | 1,531 |
| ぴあ | 0.500 | 0.600 | 1,753 |
| イオンファンタジー | 0.600 | 0.500 | 1,560 |
| シーティーエス | - | 0.900 | 1,399 |
| みらかホールディングス | 4 | 4 | 23,829 |
| アルプス技研 | 0.700 | 0.700 | 2,138 |
| ダイオーズ | 1 | 1 | 1,181 |
| 日本空調サービス | 0.900 | 2 | 1,332 |
| オリエンタルランド | 19 | 20 | 126,971 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------|----------------|-------|-----------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評価額 千円 |
| ダスキン | 5 | 4 | 11,716 |
| 明光ネットワークジャパン | 2 | 2 | 2,780 |
| ファルコホールディングス | 0.800 | 0.900 | 1,345 |
| 秀英予備校 | 1 | 2 | 1,346 |
| ラウンドワン | 5 | 5 | 5,104 |
| リゾートトラスト | 7 | 7 | 15,847 |
| ビー・エム・エル | 1 | 2 | 5,944 |
| ワタベウェディング | - | 2 | 1,661 |
| りらいあコミュニケーションズ | 3 | 3 | 3,379 |
| リソー教育 | 3 | 3 | 2,003 |
| ユー・エス・エス | 22 | 22 | 43,492 |
| サイバーエージェント | 4 | 9 | 29,498 |
| 楽天 | 85 | 94 | 97,454 |
| セントラルスポーツ | 0.600 | 0.600 | 2,148 |
| フルキャストホールディングス | 1 | 1 | 2,040 |
| テクノプロ・ホールディングス | 3 | 3 | 11,565 |
| K e e P e r 技研 | - | 0.700 | 1,508 |
| リブセンス | 0.700 | 2 | 1,190 |
| ジャパンマテリアル | 0.800 | 1 | 2,132 |
| ベクトル | 0.600 | 1 | 1,872 |
| ウチヤマホールディングス | - | 2 | 1,229 |
| キャリアリンク | - | 1 | 1,176 |
| I B J | - | 1 | 1,140 |
| アサンテ | 0.700 | 0.700 | 1,215 |
| N・フィールド | - | 0.900 | 1,323 |
| アビスト | 0.500 | 0.300 | 1,188 |
| ウィルグループ | 1 | 1 | 1,205 |
| 日本ビューホテル | - | 0.900 | 1,215 |
| リクルートホールディングス | 36 | 40 | 215,865 |
| 日本郵政 | 40 | 48 | 71,341 |
| ベルシステム24ホールディングス | 2 | 2 | 2,800 |
| リログループ | 0.700 | 0.700 | 11,060 |
| 東祥 | 0.500 | 0.400 | 2,060 |
| エイチ・アイ・エス | 3 | 3 | 8,781 |
| ラックランド | - | 0.600 | 1,198 |
| 共立メンテナンス | 1 | 1 | 10,395 |
| イチネンホールディングス | 1 | 1 | 2,272 |
| 建設技術研究所 | 1 | 1 | 1,312 |
| スペース | 1 | 1 | 1,285 |
| 東京テアトル | 8 | 8 | 1,216 |
| ナガワ | 0.300 | 0.300 | 1,365 |
| よみうりランド | 4 | 4 | 1,848 |
| 東京都競馬 | 12 | 13 | 3,354 |
| 常磐興産 | 7 | 0.800 | 1,291 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | | 千円 |
| カナモト | 2 | 2 | | 7,501 |
| 東京ドーム | 15 | 7 | | 8,095 |
| 西尾レントオール | 1 | 1 | | 4,950 |
| トランス・コスモス | 2 | 2 | | 5,757 |
| 乃村工藝社 | 3 | 4 | | 7,648 |
| 藤田観光 | 7 | 6 | | 2,220 |
| KNT-CTホールディングス | 9 | 10 | | 1,380 |
| 日本管財 | 1 | 1 | | 2,862 |
| トーカイ | 0.800 | 0.800 | | 3,280 |
| 白洋舎 | - | 0.500 | | 1,350 |
| セコム | 19 | 19 | | 158,144 |
| セントラル警備保障 | 0.800 | 0.800 | | 1,518 |
| 丹青社 | 3 | 3 | | 2,774 |
| メイテック | 2 | 2 | | 9,570 |
| アサツー ディ・ケイ | 3 | 3 | | 8,673 |
| 応用地質 | 1 | 1 | | 2,638 |
| 船井総研ホールディングス | 2 | 2 | | 4,699 |
| 進学会 | 1 | 2 | | 1,256 |
| 学究社 | - | 0.800 | | 1,301 |
| ベネッセホールディングス | 6 | 6 | | 20,708 |
| イオンディライト | 1 | 2 | | 7,287 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------|---------|--------|--------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | | 千円 |
| ナック | 1 | 1 | | 1,189 |
| ニチイ学館 | 3 | 3 | | 2,822 |
| ダイセキ | 3 | 3 | | 7,414 |
| ステップ | - | 0.900 | | 1,261 |
| 合 計 | 株数・金額 | 28,896 | 26,741 | 40,065,445 |
| | 銘柄数<比率> | 1,672 | 1,711 | <97.7%> |

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|-----------|-------|-------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国 内 | 百万円 | 百万円 |
| T O P I X | 928 | - |

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 | % |
| | 40,065,445 | 97.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,048,159 | 2.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 41,113,604 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年2月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|-----------------|
| (A)資 産 | 41,104,725,800円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 938,060,227 |
| 株 式 (評 価 額) | 40,065,445,160 |
| 未 収 入 金 | 10,077,600 |
| 未 収 配 当 金 | 66,042,813 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 25,100,000 |
| (B)負 債 | 106,718,372 |
| 未 払 解 約 金 | 106,717,303 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,069 |
| (C)純 資 産 総 額 (A - B) | 40,998,007,428 |
| 元 本 | 26,374,834,259 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 14,623,173,169 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 26,374,834,259口 |
| 1万口当たり基準価額 (C/D) | 15,544円 |

| | |
|---|-----------------|
| (注1) 期首元本額 | 26,708,202,183円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,006,231,236円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,339,599,160円 |
| (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。 | |
| ニッセイTOPIXオープン | 7,816,865,155円 |
| ニッセイ国内株式インデックスSA (適格機関投資家限定) | 6,332,736,059円 |
| ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定) | 14,519,282円 |
| ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定) | 6,437,271円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) | 555,106,395円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) | 2,800,563,440円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) | 2,128,386,619円 |
| ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (債券重視型) SA (適格機関投資家限定) | 46,174,999円 |
| ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (標準型) SA (適格機関投資家限定) | 225,366,268円 |
| ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (成長型) SA (適格機関投資家限定) | 217,749,600円 |
| ニッセイ厚生年金型バランス運用 (現物型) DB (適格機関投資家限定) | 1,897,634,169円 |
| DCニッセイ国内株式インデックス | 33,239,884円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド | 4,083,558,090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) | 216,164,160円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055 | 332,868円 |

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日~2017年2月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|-----------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 779,010,841円 |
| 受 取 配 当 金 | 778,889,457 |
| 受 取 利 息 | 11,057 |
| そ の 他 収 益 金 | 525,339 |
| 支 払 利 息 | △ 415,012 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 6,645,935,503 |
| 売 買 益 | 7,431,372,298 |
| 売 買 損 | △ 785,436,795 |
| (C)先 物 取 引 等 損 益 | 118,811,960 |
| 取 引 益 | 206,500,660 |
| 取 引 損 | △ 87,688,700 |
| (D)信 託 報 酬 等 | △ 29,665 |
| (E)当期損益金 (A + B + C + D) | 7,543,728,639 |
| (F)前 期 繰 越 損 益 金 | 7,429,245,557 |
| (G)追 加 信 託 差 損 益 金 | 3,681,764,874 |
| (H)解 約 差 損 益 金 | △ 4,031,565,901 |
| (I)合 計 (E + F + G + H) | 14,623,173,169 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 14,623,173,169 |

| |
|--|
| (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。 |