

第5期末 (2020年2月20日)

基準価額	11,313円
純資産総額	269億円
騰落率	6.3%
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:2019年2月21日～2020年2月20日

第5期(決算日 2020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5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。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

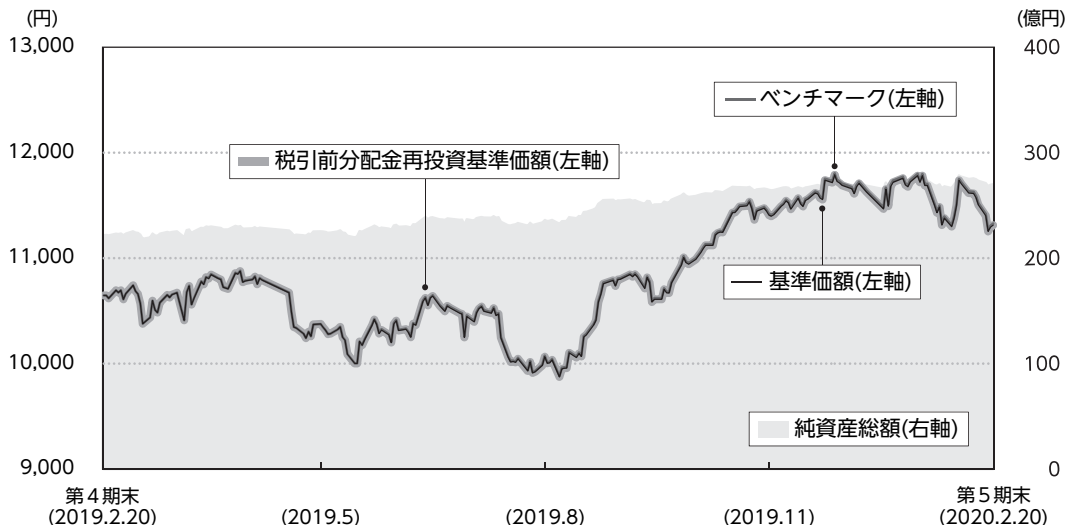
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年2月21日～2020年2月20日

基準価額等の推移



第5期首	10,646円	既払分配金	0円
第5期末	11,313円	騰落率(分配金再投資ベース)	6.3%

(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す。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(配当込み)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

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った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは後掲の「国内株式市況」をご参照ください。

1万口当たりの費用明細

項目	第5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.159%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,823円です。</p>
(投信会社)	(7)	(0.068)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(7)	(0.069)	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)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p>
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
その他費用	0	0.001	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(0)	(0.001)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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	18	0.162	

(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まず。

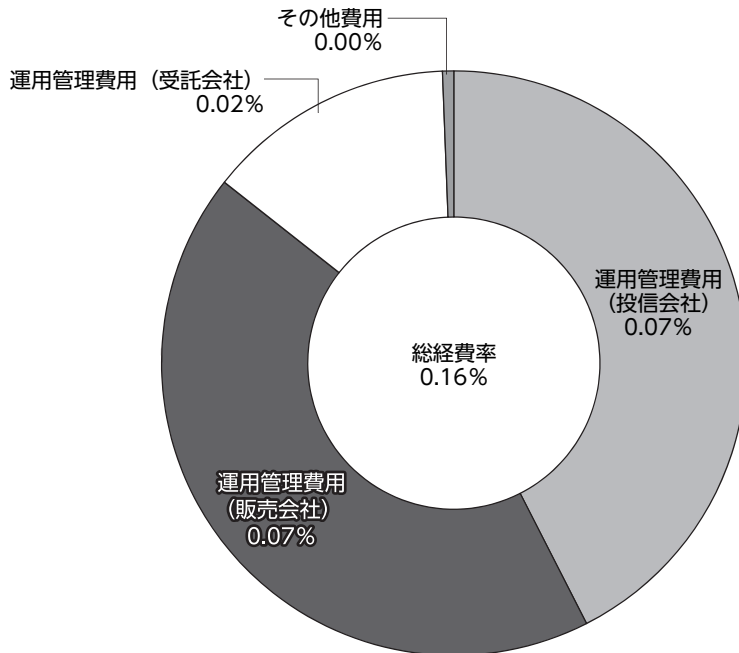
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

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



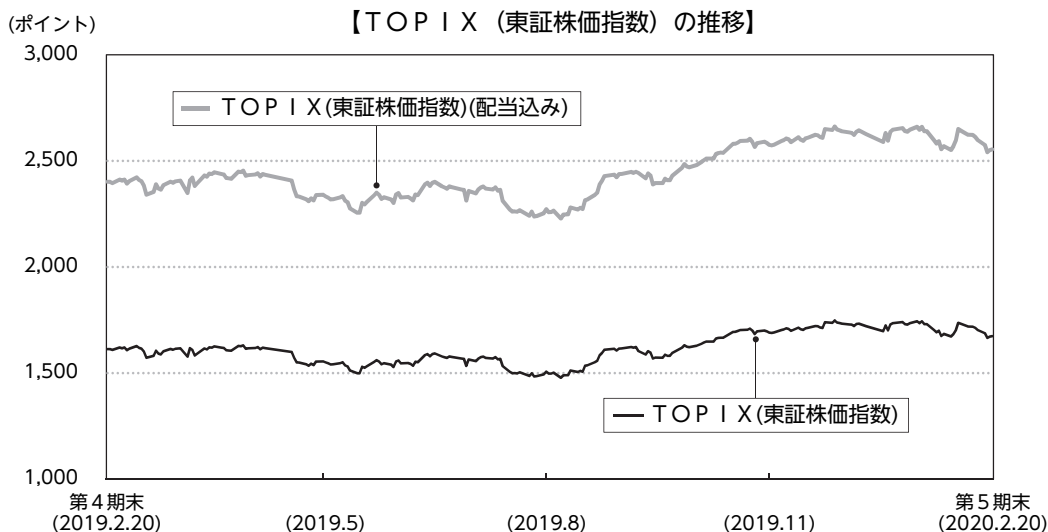
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

国内株式市場



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを急がないとの観測が広がったことや中国が景気対策を表明したことなどから、4月末にかけて株価は底堅く推移しました。

5月に入ると米国が中国に対し制裁関税の引き上げを発表したことで米中貿易摩擦再燃への懸念が高まり、株価は下落に転じました。さらに米国による中国通信機器最大手の華為技術（ファーウェイ）への制裁措置やメキシコに追加関税を課す方針が示され、貿易摩擦の長期化や拡大が世界の景気減速につながるなどの懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、株価は弱含みました。

6月末の20カ国・地域首脳会議（G20サミット）で米中貿易摩擦の解決が期待されたことや金融緩和観測などから株価は上昇傾向となりましたが、8月初旬には米中貿易摩擦再燃への懸念から下落しました。

9月に入ると米中貿易協議の進展期待が高まったことに加えて、香港情勢やイギリスの政治混乱を巡る懸念が後退したことなどを受けて株価は上昇しました。

2020年1月には米軍によるイラン革命防衛隊の司令官殺害を巡り米国とイランの対立が激化するとの懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落する場面もありましたが、トランプ米大統領の演説が報復には言及せず抑制的であったことから両国対立激化への懸念が後退しました。

期末にかけては中国で発生した新型コロナウイルスによる肺炎の感染拡大が警戒され、投資家の市場心理が悪化し株価は下落する場面がありましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

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

■マザーファンド

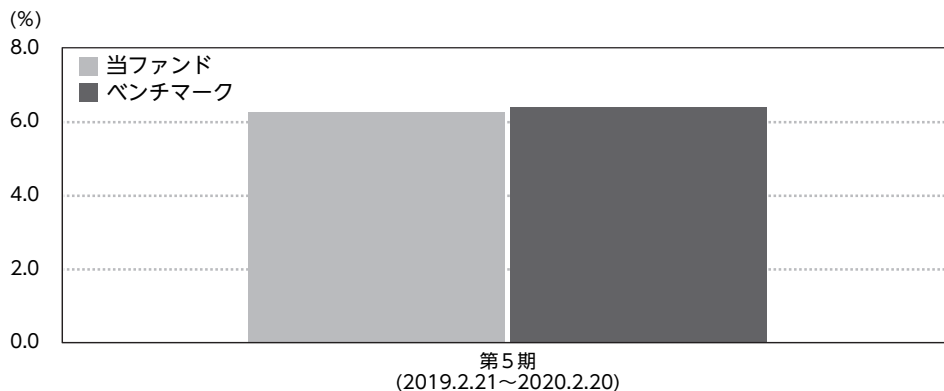
当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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

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

*ベンチマークはTOP I X（東証株価指数）（配当込み）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+6.3%となり、ベンチマーク騰落率（+6.4%）にほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。
 なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期
	2019年2月21日～2020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	2,054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。

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5期末 2020年2月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

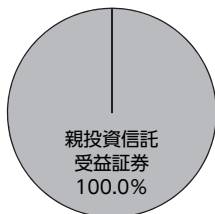
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

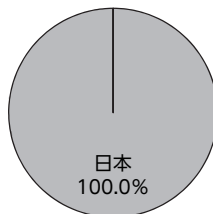
項目	第5期末 2020年2月20日
純資産総額	26,990,919,445円
受益権総口数	23,858,248,588口
1万口当たり基準価額	11,313円

(注) 当期間中における追加設定元本額は12,769,128,233円、同解約元本額は9,736,662,386円です。

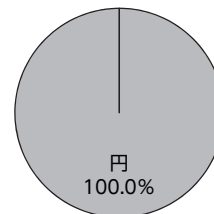
■資産別配分



■国別配分



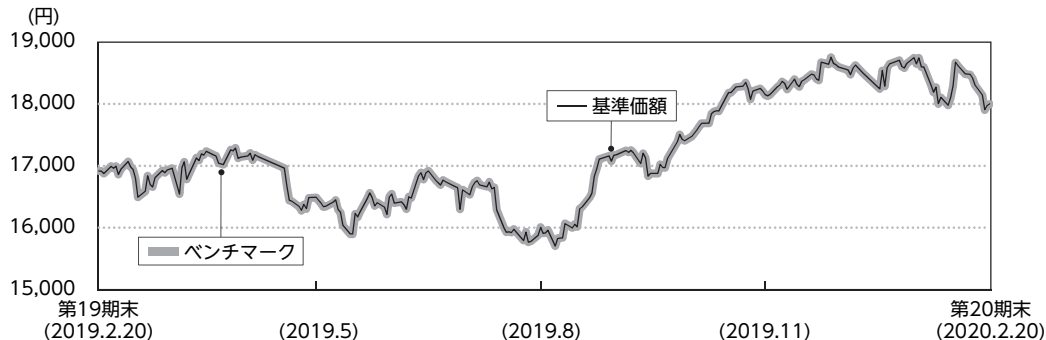
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2020年2月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

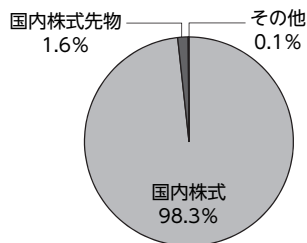
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.6%
ソニー	円	2.0
ソフトバンクグループ	円	1.8
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.6
日本電信電話	円	1.5
キーエンス	円	1.4
武田薬品工業	円	1.4
リクルートホールディングス	円	1.3
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.1
KDDI	円	1.0
組入銘柄数		1,860

■ 1万口当たりの費用明細

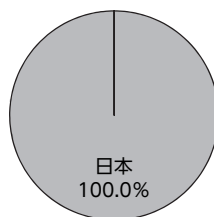
2019.2.21~2020.2.20

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

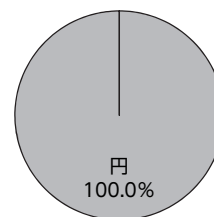
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2020年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金					
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	百万円
2015年4月27日	10,000	—	—	10,000	10,000	—	—	—	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
3期(2018年2月20日)	11,396	0	16.0	11,396	11,492	16.3	98.2	1.9	15,003
4期(2019年2月20日)	10,646	0	△6.6	10,646	10,754	△6.4	98.4	1.5	22,172
5期(2020年2月20日)	11,313	0	6.3	11,313	11,442	6.4	98.3	1.6	26,990

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 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	騰落率		ベンチ マーク	騰落率		株式 組入比率	株式 先物比率
	円		%		%	%	%	%
(期首)2019年2月20日	10,646		—	10,754	—	98.4	1.5	
2月末	10,611		△0.3	10,718	△0.3	98.2	1.7	
3月末	10,618		△0.3	10,728	△0.2	97.1	3.1	
4月末	10,792		1.4	10,905	1.4	97.4	2.7	
5月末	10,090		△5.2	10,194	△5.2	95.0	4.9	
6月末	10,365		△2.6	10,475	△2.6	96.1	3.9	
7月末	10,456		△1.8	10,571	△1.7	97.5	2.5	
8月末	10,102		△5.1	10,214	△5.0	97.4	2.5	
9月末	10,713		0.6	10,831	0.7	97.3	2.7	
10月末	11,247		5.6	11,372	5.7	98.0	2.0	
11月末	11,465		7.7	11,593	7.8	97.9	2.3	
12月末	11,629		9.2	11,761	9.4	97.9	2.1	
2020年1月末	11,379		6.9	11,509	7.0	96.4	3.5	
(期末)2020年2月20日	11,313		6.3	11,442	6.4	98.3	1.6	

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2019年2月21日～2020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	8,029,862	13,850,155	6,145,379	10,750,529

(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	14,228,479千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	60,936,570千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.23

(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

2019年2月21日～2020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

2020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	13,107,204	14,991,687	26,991,033

(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37,895,533千口です。

投資信託財産の構成

2020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	26,991,033	99.3
コール・ローン等、その他	190,688	0.7
投資信託財産総額	27,181,721	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	27,181,721,977円
コール・ローン等	19,716,436
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	26,991,033,759
未収入金	170,971,782
(B)負債	190,802,532
未払解約金	170,394,433
未払信託報酬	20,263,430
その他未払費用	144,669
(C)純資産総額(A-B)	26,990,919,445
元本	23,858,248,588
次期繰越損益金	3,132,670,857
(D)受益権総口数	23,858,248,588口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,313円

(注) 期首元本額	20,825,782,741円
期中追加設定元本額	12,769,128,233円
期中一部解約元本額	9,736,662,386円

損益の状況

当期(2019年2月21日～2020年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 4,925円
受取利息	1,231
支払利息	△ 6,156
(B)有価証券売買損益	1,365,891,460
売買益	1,811,031,377
売買損	△ 445,139,917
(C)信託報酬等	△ 39,264,477
(D)当期損益金(A+B+C)	1,326,622,058
(E)前期繰越損益金	△ 130,977,945
(分配準備積立金)	(772,863,164)
(繰越欠損金)	(△ 903,841,109)
(F)追加信託差損益金*	1,937,026,744
(配当等相当額)	(3,539,812,654)
(売買損益相当額)	(△ 1,602,785,910)
(G)合計(D+E+F)	3,132,670,857
次期繰越損益金(G)	3,132,670,857
追加信託差損益金	1,937,026,744
(配当等相当額)	(3,559,954,707)
(売買損益相当額)	(△ 1,622,927,963)
分配準備積立金	1,340,736,449
繰越欠損金	△ 145,092,336

- (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	567,873,285円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	3,559,954,707円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	772,863,164円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	4,900,691,156円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,054.09円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

お知らせ

■約款変更

信託報酬率の上限引き下げに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

(2019年6月27日)

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 20 期

(計算期間：2019年2月21日～2020年2月20日)

運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



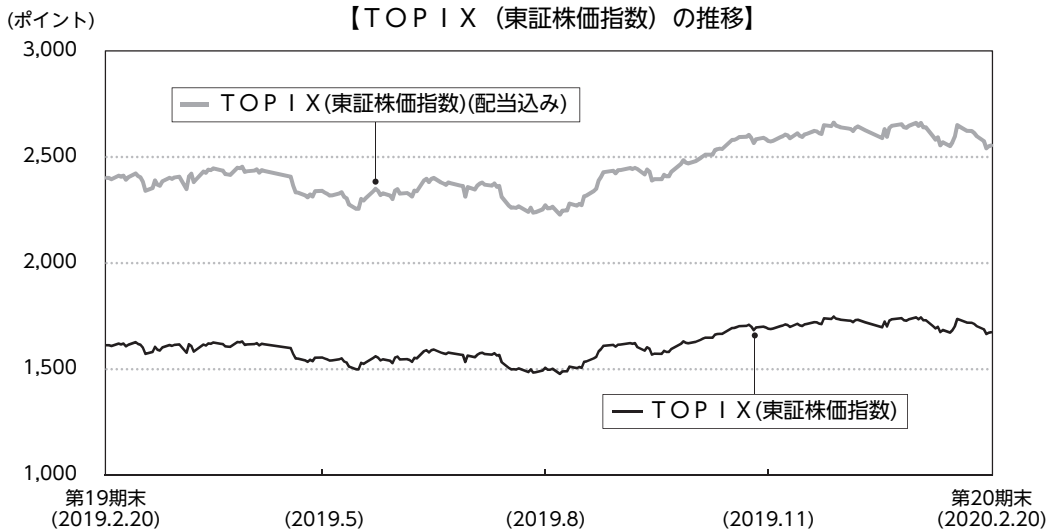
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年2月21日～2020年2月20日

国内株式市況



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを急がないとの観測が広がったことや中国が景気対策を表明したことなどから、4月末にかけて株価は底堅く推移しました。

5月に入ると米国が中国に対し制裁関税の引き上げを発表したことで米中貿易摩擦再燃への懸念が高まり、株価は下落に転じました。さらに米国による中国通信機器最大手の華為技術（ファーウェイ）への制裁措置やメキシコに追加関税を課す方針が示され、貿易摩擦の長期化や拡大が世界の景気減速につながるとの懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、株価は弱含みました。

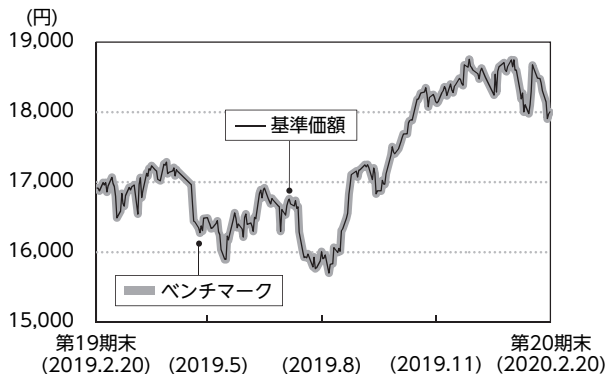
6月末の20カ国・地域首脳会議（G20サミット）で米中貿易摩擦の解決が期待されたことや金融緩和観測などから株価は上昇傾向となりましたが、8月初旬には米中貿易摩擦再燃への懸念から下落しました。

9月に入ると米中貿易協議の進展期待が高まったことに加えて、香港情勢やイギリスの政治混乱を巡る懸念が後退したことなどを受けて株価は上昇しました。

2020年1月には米軍によるイラン革命防衛隊の司令官殺害を巡り米国とイランの対立が激化すると懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落する場面もありましたが、トランプ米大統領の演説が報復には言及せず抑制的であったことから両国対立激化への懸念が後退しました。

期末にかけては中国で発生した新型コロナウイルスによる肺炎の感染拡大が警戒され、投資家の市場心理が悪化し株価は下落する場面がありましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

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成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率		ベンチマーク	期中騰落率		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		円	%		%	%			
16期(2016年2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137		
17期(2017年2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998		
18期(2018年2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868		
19期(2019年2月20日)	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5	58,316		
20期(2020年2月20日)	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6	68,225		

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入比率	株式先物比率
		円	%		%	%		
(期首)2019年2月20日	16,916	—	17,088	—	98.4	1.5		
2月末	16,861	△0.3	17,032	△0.3	98.2	1.7		
3月末	16,874	△0.2	17,047	△0.2	97.1	3.1		
4月末	17,153	1.4	17,329	1.4	97.4	2.7		
5月末	16,039	△5.2	16,198	△5.2	95.0	4.9		
6月末	16,478	△2.6	16,646	△2.6	96.1	3.9		
7月末	16,626	△1.7	16,798	△1.7	97.5	2.5		
8月末	16,065	△5.0	16,231	△5.0	97.4	2.5		
9月末	17,038	0.7	17,211	0.7	97.3	2.7		
10月末	17,891	5.8	18,071	5.7	98.0	2.0		
11月末	18,239	7.8	18,422	7.8	97.9	2.3		
12月末	18,502	9.4	18,689	9.4	97.9	2.1		
2020年1月末	18,107	7.0	18,289	7.0	96.4	3.5		
(期末)2020年2月20日	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6		

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2019年2月21日～2020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（17,210円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2019年2月21日～2020年2月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 6,147 (663)	千円 10,595,452	千株 2,150	千円 3,633,027

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	16,730	16,589	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2019年2月21日～2020年2月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
武田薬品工業	90	383,095	4,219	KDDI	37	107,867	2,891
トヨタ自動車	46	323,925	7,026	ソフトバンクグループ	15	83,624	5,538
ソフトバンクグループ	29	164,865	5,607	ソニー	12	77,542	6,355
NTTドコモ	55	155,069	2,819	キーエンス	1	75,307	68,461
ソニー	24	150,016	6,024	田辺三菱製薬	34	68,702	1,997
三菱UFJフィナンシャル・グループ	279	148,690	531	ソフトバンク	42	64,079	1,497
ソフトバンク	102	140,517	1,377	NTTドコモ	24	63,025	2,583
任天堂	3	133,473	39,256	オリエンタルランド	3	53,199	16,121
日本電信電話	30	128,193	4,273	本田技研工業	17	52,565	3,038
キーエンス	2	116,852	55,643	トヨタ自動車	6	52,152	7,666

(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

2020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	1	1	1	3,920
日本水産	33	38	38	23,546
マルハニチロ	4	5	5	14,364
カネコ種苗	1	1	1	1,855
サカタのタネ	4	4	4	15,341
ホクト	2	2	2	5,724
鉱業(0.3%)				
住石ホールディングス	6	12	12	1,801
日鉄鉱業	0.800	0.900	0.900	3,807
三井松島ホールディングス	1	0.900	0.900	1,008
国際石油開発帝石	135	154	154	165,945
石油資源開発	4	5	5	13,990
K&Oエナジーグループ	1	1	1	3,127
建設業(2.8%)				
ヒノキヤグループ	0.800	1	1	2,038

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
ショーボンドホールディングス	2	6	6	25,410
ミライト・ホールディングス	9	11	11	17,365
タマホーム	1	2	2	2,971
ファーストコーポレーション	2	3	3	1,844
ベステラ	-	1	1	1,443
スペースバリューホールディングス	4	4	4	2,505
ダイセキ環境ソリューション	0.500	1	1	1,684
安藤・間	21	23	23	19,688
東急建設	9	11	11	8,463
コムシスホールディングス	12	13	13	39,990
ミサワホーム	2	-	-	-
ピーアールホールディングス	-	4	4	2,066
高松コンストラクショングループ	2	2	2	6,225
東建コーポレーション	1	1	1	9,840
ソネック	2	-	-	-
ヤマウラ	1	1	1	1,784

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
大成建設	27	29	120,879	
大林組	83	89	109,503	
清水建設	85	90	97,812	
飛鳥建設	2	2	3,517	
長谷工コーポレーション	34	34	48,852	
松井建設	3	3	2,499	
銭高組	0.300	0.400	1,584	
鹿島建設	65	70	89,460	
不動テトラ	1	2	3,774	
大木建設	1	1	1,808	
鉄建建設	1	1	5,044	
西松建設	6	6	16,732	
三井住友建設	20	21	13,115	
大豊建設	1	2	5,254	
前田建設工業	19	22	23,794	
佐田建設	3	4	1,764	
ナカノフドー建設	3	3	1,717	
奥村組	4	4	13,579	
東鉄工業	3	3	11,666	
浅沼組	1	1	5,150	
戸田建設	32	37	26,344	
熊谷組	4	4	13,079	
青木あすなろ建設	1	-	-	
北野建設	0.600	0.700	1,757	
植木組	0.700	0.700	1,745	
矢作建設工業	3	3	3,256	
ピーエス三菱	2	2	1,902	
日本ハウスホールディングス	5	6	2,696	
大東建託	9	10	132,894	
新日本建設	3	3	3,268	
N I P P O	7	7	19,832	
東亜道路工業	0.500	0.600	2,016	
前田道路	8	9	31,960	
日本道路	0.800	0.900	6,444	
東亜建設工業	2	2	4,942	
日本国土開発	-	6	3,841	
若築建設	1	1	2,558	
東洋建設	10	10	5,020	
五洋建設	33	35	23,227	
世紀東急工業	4	4	3,796	
福田組	0.900	1	4,415	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
住友林業	19	22	38,872	
日本基礎技術	4	4	1,633	
巴コーポレーション	3	4	1,715	
大和ハウス工業	77	88	291,060	
ライト工業	5	5	7,471	
積水ハウス	85	97	225,956	
日特建設	2	2	1,941	
北陸電気工事	1	-	-	
ユアテック	4	5	3,248	
四電工	0.600	0.700	1,806	
中電工	3	3	8,787	
関電工	12	12	12,738	
きんでん	18	21	38,011	
東京エネシス	2	3	2,508	
トーエネック	0.800	0.900	3,267	
住友電設	1	2	6,152	
日本電設工業	4	4	10,897	
協和エクシオ	10	13	35,491	
新日本空調	2	2	4,749	
九電工	5	6	19,719	
三機工業	6	6	8,761	
日揮ホールディングス	24	27	42,497	
中外炉工業	0.800	1	1,700	
ヤマト	3	2	2,105	
太平電業	1	2	5,572	
高砂熱学工業	7	7	14,322	
三晃金属工業	0.500	0.700	1,824	
朝日工業社	0.600	0.600	1,881	
明星工業	5	5	4,564	
大気社	3	4	14,792	
ダイダン	1	2	5,743	
日比谷総合設備	2	2	5,550	
東芝プラントシステム	6	-	-	
OSJBホールディングス	12	14	3,722	
東洋エンジニアリング	3	3	2,127	
千代田化工建設	20	-	-	
レイズネクスト	5	4	6,172	
食料品(3.8%)				
日本製粉	8	8	13,686	
日清製粉グループ本社	28	32	62,983	
昭和産業	2	2	7,891	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
鳥越製粉	2	2	2,065
中部飼料	3	3	5,701
フィード・ワン	16	19	3,360
東洋精糖	1	1	1,782
日本甜菜製糖	1	1	2,770
三井製糖	2	2	5,205
塩水港精糖	6	7	1,762
日新製糖	1	1	2,811
森永製菓	6	6	31,423
中村屋	0.600	0.700	2,810
江崎グリコ	7	8	40,035
名糖産業	1	1	1,946
井村屋グループ	1	1	2,280
不二家	1	1	3,705
山崎製パン	20	21	42,949
モロゾフ	0.400	0.500	2,460
亀田製菓	1	1	7,640
寿スピリッツ	2	2	16,983
カルビー	11	13	39,650
森永乳業	5	5	21,571
六甲バター	1	1	2,935
ヤクルト本社	18	19	105,644
明治ホールディングス	17	18	133,623
雪印メグミルク	6	6	17,043
プリマハム	3	4	11,191
日本ハム	10	10	50,794
丸大食品	2	3	6,003
S Foods	2	2	6,060
柿安本店	-	1	3,105
伊藤ハム米久ホールディングス	16	18	12,180
サッポロホールディングス	9	9	23,988
アサヒグループホールディングス	52	59	287,992
キリンホールディングス	113	120	274,019
宝ホールディングス	18	21	20,372
オエノンホールディングス	7	7	2,910
養命酒製造	0.800	0.900	1,737
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19	20	58,740
サントリー食品インターナショナル	16	19	88,910
ガイドーグループホールディングス	1	1	5,902
伊藤園	7	8	47,589
キーコーヒー	2	2	6,300

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清オイリオグループ	3	3	13,727
不二製油グループ本社	6	7	19,236
かどや製油	0.300	0.500	1,900
J-オイルミルズ	1	1	6,375
キッコーマン	16	20	120,540
味の素	55	63	125,181
キューピー	13	15	34,216
ハウス食品グループ本社	9	10	36,808
カゴメ	10	10	28,771
アリアケジャパン	2	2	19,500
ピエトロ	0.900	1	1,805
エバラ食品工業	0.700	0.800	1,744
ニチレイ	13	13	38,012
東洋水産	12	14	66,958
イートアンド	0.900	1	1,839
大冷	0.900	0.900	1,756
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3	1	1,828
日清食品ホールディングス	10	12	107,690
永谷園ホールディングス	1	1	2,969
一正蒲鉾	-	1	1,806
フジッコ	2	3	5,840
ロック・フィールド	2	3	4,251
日本たばこ産業	144	164	373,374
ケンコーマヨネーズ	1	1	3,539
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,486
なとり	1	1	2,710
ピッグルスコーポレーション	0.700	-	-
北の達人コーポレーション	9	10	6,280
ユーグレナ	10	12	10,052
ミヨシ油脂	1	1	1,608
理研ビタミン	1	1	5,154
繊維製品(0.6%)			
片倉工業	3	4	5,328
グンゼ	1	2	8,270
東洋紡	10	11	16,500
ユニチカ	7	8	2,861
富士紡ホールディングス	1	1	4,446
倉敷紡績	2	2	6,445
シキボウ	1	1	1,512
日本毛織	8	9	9,310
帝国繊維	2	3	6,764

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
帝人	19	22	45,649
東レ	189	201	141,050
サカイオーベックス	0.800	1	1,903
住江織物	0.700	0.800	1,865
日本フェルト	3	3	1,794
イチカワ	1	1	1,860
アツギ	2	2	1,888
セーレン	6	6	10,778
ソトー	1	1	1,841
東海染工	1	1	1,796
小松マテーレ	4	4	3,634
ワコールホールディングス	7	7	20,440
ホギメディカル	3	3	10,576
クラウドディアホールディングス	3	3	1,744
T S I ホールディングス	9	9	4,603
マツオカコーポレーション	0.800	0.900	1,844
ワールド	2	3	9,063
三陽商会	1	1	2,132
オンワードホールディングス	14	16	10,220
ゴールドウイン	2	5	35,850
デサント	5	5	8,818
ヤマトインターナショナル	3	4	1,782
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	1	1	7,191
王子ホールディングス	109	116	69,431
日本製紙	11	12	21,168
三菱製紙	4	4	1,760
北越コーポレーション	16	18	9,083
中越パルプ工業	-	1	1,773
大王製紙	11	12	17,580
阿波製紙	3	1	569
レンゴー	25	26	21,539
トーモク	1	1	2,900
ザ・パックス	1	2	8,746
化学(7.1%)			
クラレ	41	43	55,275
旭化成	173	184	188,928
共和レザー	1	-	-
昭和電工	16	19	52,569
住友化学	191	204	90,389
住友精化	1	1	3,798

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産化学	15	15	78,780
ラサ工業	1	-	-
クレハ	2	2	14,280
多木化学	0.700	0.800	3,540
テイカ	2	2	3,262
石原産業	4	5	4,115
片倉コープアグリ	1	1	1,846
日東エフシー	2	-	-
日本曹達	3	4	13,017
東ソー	37	43	70,563
トクヤマ	7	8	21,720
セントラル硝子	5	5	12,967
東亜合成	15	17	21,437
大阪ソーダ	2	2	7,644
関東電化工業	5	6	6,600
デンカ	9	10	30,018
信越化学工業	43	47	657,011
日本カーバイド工業	0.900	1	1,779
堺化学工業	1	1	3,934
第一稀元素化学工業	2	3	2,553
エア・ウォーター	20	25	39,601
大陽日酸	20	26	58,579
日本化学工業	0.800	0.900	2,390
日本パーカラライジング	13	14	15,428
高圧ガス工業	3	4	3,308
四国化成工業	4	4	5,211
戸田工業	0.700	-	-
ステラ ケミファ	1	1	4,845
保土谷化学工業	0.800	1	4,345
日本触媒	4	4	26,015
大日精化工業	2	2	6,572
カネカ	6	7	23,832
三菱瓦斯化学	25	26	47,892
三井化学	22	25	64,287
J S R	24	25	54,959
東京応化工業	4	4	21,216
大阪有機化学工業	2	2	4,459
三菱ケミカルホールディングス	163	186	146,437
K H ネオケム	3	4	11,926
ダイセル	37	38	38,214
住友ベークライト	4	4	15,818

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
積水化学工業	53	59	108,058
日本ゼオン	22	25	30,345
アイカ工業	7	8	28,842
宇部興産	12	14	30,540
積水樹脂	4	5	11,865
タキロンシーアイ	5	6	3,750
旭有機材	1	1	2,566
日立化成	11	12	59,404
ニチバン	1	1	2,520
リケンテクノス	6	7	3,248
大倉工業	1	1	2,119
積水化成成品工業	3	3	2,504
群栄化学工業	0.600	0.700	1,714
タイガースポリマー	2	3	1,772
ミライアル	1	-	-
ダイキョーニシカワ	5	5	4,277
竹本容器	1	2	1,795
森六ホールディングス	1	1	3,223
日本化薬	15	17	22,119
カーリットホールディングス	2	3	1,720
日本精化	2	2	2,996
扶桑化学工業	2	2	9,576
トリケミカル研究所	0.500	0.600	5,730
ADEKA	12	12	19,801
日油	9	10	38,955
新日本理化	7	8	1,702
ハリマ化成グループ	2	2	2,417
花王	60	68	579,700
第一工業製薬	0.900	1	4,290
石原ケミカル	0.900	-	-
日華化学	0.900	2	1,631
ニイタカ	1	0.800	2,084
三洋化成工業	1	1	8,219
有機合成薬品工業	6	6	2,884
大日本塗料	2	3	3,320
日本ペイントホールディングス	20	23	115,230
関西ペイント	27	31	79,220
中国塗料	8	7	7,370
日本特殊塗料	1	2	2,496
藤倉化成	3	3	2,014
太陽ホールディングス	2	2	9,500

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
D I C	11	11	34,538
サカタインクス	5	6	7,051
東洋インキSCホールディングス	5	5	14,112
T & K T O K A	1	2	2,024
富士フイルムホールディングス	51	54	292,338
資生堂	49	56	394,652
ライオン	34	36	73,763
高砂香料工業	1	1	4,156
マンダム	5	6	16,326
ミルボン	3	3	22,344
ファンケル	11	11	35,305
コーセー	4	5	75,684
コタ	1	1	2,218
シーボン	0.600	0.700	1,718
ポーラ・オルビスホールディングス	10	12	27,382
ノエビアホールディングス	1	2	13,743
アジupanコスメジャパン	1	1	1,776
エステー	1	1	2,881
アグロ カネシヨウ	1	1	1,690
コニシ	4	4	7,186
長谷川香料	3	3	8,272
星光PMC	1	2	1,768
小林製薬	7	8	68,560
荒川化学工業	2	2	3,876
メック	1	2	3,084
日本高純度化学	0.700	0.800	2,128
タカラバイオ	6	7	16,642
J C U	3	3	10,070
新田ゼラチン	2	2	1,728
デクセリアルズ	6	7	6,679
アース製薬	1	2	12,726
北興化学工業	2	2	1,812
大成ラミック	0.800	0.900	2,523
クミアイ化学工業	10	11	9,746
日本農薬	6	5	2,815
アキレス	1	2	3,898
有沢製作所	3	4	4,095
日東電工	18	19	117,600
レック	2	3	3,495
三光合成	-	5	1,742
藤森工業	2	2	8,212

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
前澤化成工業	1	1	2,019
未来工業	1	1	3,043
J S P	1	1	3,032
エフピコ	2	3	22,048
天馬	1	1	3,638
信越ポリマー	4	5	4,845
東リ	6	7	2,073
ニフコ	10	10	29,660
バルカー	2	2	5,331
ユニ・チャーム	52	54	216,186
医薬品(6.2%)			
協和キリン	31	28	77,506
武田薬品工業	157	236	984,133
アステラス製薬	229	249	478,058
大日本住友製薬	18	21	36,334
塩野義製薬	32	36	234,461
田辺三菱製薬	26	-	-
わかもと製薬	5	7	1,953
あすか製薬	3	3	3,555
日本新薬	6	7	68,228
ビオフェルミン製薬	-	0.800	1,899
中外製薬	26	29	357,716
科研製薬	4	4	28,518
エーザイ	29	34	304,912
ロート製薬	12	14	47,742
小野薬品工業	58	65	165,927
久光製薬	7	7	42,028
持田製薬	1	3	16,614
参天製薬	47	52	103,366
扶桑薬品工業	0.900	1	1,955
ツムラ	7	8	24,666
日医工	6	8	10,528
キッセイ薬品工業	4	5	14,290
生化学工業	4	5	6,704
栄研化学	4	5	10,855
日水製薬	1	1	1,846
鳥居薬品	1	1	6,489
J C R ファーマ	1	2	22,060
東和薬品	1	3	8,596
富士製薬工業	1	1	2,354
沢井製薬	5	5	40,832

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	4	5	10,140
第一三共	71	81	627,229
キョーリン製薬ホールディングス	5	6	13,412
大幸薬品	1	1	5,753
ダイト	1	1	5,780
大塚ホールディングス	47	54	242,963
大正製薬ホールディングス	5	6	43,440
ペプチドリーム	12	14	74,736
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	21	24	1,824
昭和シェル石油	23	-	-
ニチレキ	3	3	4,736
ユシロ化学工業	1	1	2,136
ビーピー・カストロール	1	1	1,783
富士石油	6	3	835
M O R E S C O	0.700	1	1,736
出光興産	19	32	92,896
J X T Gホールディングス	418	427	200,198
コスモエネルギーホールディングス	7	8	16,400
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	14	16	33,280
T O Y O T I R E	12	16	26,406
ブリヂストン	76	87	347,715
住友ゴム工業	22	25	31,897
藤倉コンポジット	1	-	-
オカモト	1	1	6,588
フコク	1	2	1,788
ニッタ	2	3	9,219
住友理工	4	5	4,576
三ツ星ベルト	3	3	6,389
バンドー化学	4	5	4,085
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	3	4	21,210
A G C	24	28	97,788
日本板硝子	11	13	7,711
石塚硝子	0.700	-	-
日本山村硝子	1	1	1,785
日本電気硝子	10	11	23,472
オハラ	1	1	1,783
住友大阪セメント	5	5	22,518
太平洋セメント	15	17	52,733

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ヒューム	2	2	2,133
日本コンクリート工業	5	6	1,872
三谷セキサン	1	1	4,927
アジアパイルホールディングス	3	4	2,164
東海カーボン	22	29	30,276
日本カーボン	1	1	6,000
東洋炭素	1	1	3,422
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	6,672
TOTO	19	20	93,380
日本碍子	30	34	65,305
日本特殊陶業	21	22	42,719
MARUWA	0.900	1	8,536
品川リフラクトリーズ	0.700	0.700	2,048
黒崎播磨	0.500	0.600	3,792
ヨータイ	2	2	1,817
イソライト工業	-	3	1,723
ニッカトー	1	2	1,817
フジインコーポレーテッド	2	2	7,637
クニミネ工業	-	1	1,446
エーアンドエーマテリアル	1	-	-
ニチアス	6	7	19,858
ニチハ	3	4	10,116
鉄鋼(0.7%)			
日本製鉄	114	125	170,836
神戸製鋼所	45	51	23,387
中山製鋼所	3	3	1,762
合同製鐵	1	1	4,131
ジェイエフイーホールディングス	66	75	84,097
東京製鐵	13	13	10,946
共英製鋼	2	3	6,012
大和工業	5	6	14,994
東京鐵鋼	1	1	1,669
大阪製鐵	1	1	2,380
淀川製鋼所	3	3	7,512
丸一鋼管	8	9	26,016
モリ工業	0.700	0.800	2,096
大同特殊鋼	4	4	19,573
日本高周波鋼業	2	4	1,741
日本冶金工業	20	2	4,634
山陽特殊製鋼	3	1	2,753
愛知製鋼	1	1	5,360

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日立金属	26	30	51,358
日本金属	0.600	2	1,771
大洋洋金属	1	1	4,533
新日本電工	14	18	3,095
栗本鐵工所	1	1	2,955
三菱製鋼	1	2	2,058
日亜鋼業	5	5	1,761
日本精線	0.400	0.300	1,077
シンニッタン	4	4	1,724
非鉄金属(0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	4	4	3,040
日本軽金属ホールディングス	67	71	15,286
三井金属鋅業	6	7	22,199
東邦亜鉛	1	1	2,574
三菱マテリアル	16	18	51,391
住友金属鉱山	33	35	109,961
DOWAホールディングス	5	7	27,974
古河機械金属	4	5	6,680
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	3,749
東邦チタニウム	4	5	4,225
UACJ	3	4	9,094
CKサンエツ	0.600	0.600	2,013
古河電気工業	7	8	22,376
住友電気工業	92	105	153,288
フジクラ	29	33	13,051
昭和電線ホールディングス	2	3	4,296
東京特殊電線	-	0.100	257
タツタ電線	4	5	3,242
カナレ電気	0.800	1	1,785
平河ヒューテック	1	1	1,712
リョービ	3	3	5,827
アーレスティ	3	3	1,850
アサヒホールディングス	4	4	13,244
金属製品(0.6%)			
稲葉製作所	1	1	2,134
宮地エンジニアリンググループ	0.700	0.900	1,838
トーカロ	6	7	8,775
アルファ	1	1	1,645
SUMCO	27	33	62,798
川田テクノロジーズ	0.500	0.600	3,714
RS Technologies	0.600	0.800	2,229

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋製鐵グループホールディングス	15	17	35,567
ホッカインホールディングス	1	1	2,721
コロナ	1	1	1,783
横河ブリッジホールディングス	4	5	11,533
三和ホールディングス	25	27	29,862
文化シャッター	7	8	6,938
三協立山	3	3	4,708
アルインコ	2	2	2,182
L I X I L グループ	36	41	79,140
日本フィルコン	2	3	1,785
ノーリツ	5	5	7,574
長府製作所	2	2	6,498
リンナイ	4	5	44,935
ダイニチ工業	2	2	1,726
日東精工	3	3	2,051
三洋工業	—	0.900	1,779
岡部	5	5	4,856
ジーテクト	2	3	5,110
東プレ	4	5	8,346
高周波熱錬	4	5	4,395
東京製綱	1	2	1,892
サンコール	1	1	767
モリテックスチール	3	5	1,698
パイオラックス	3	4	7,589
エイチワン	2	2	1,867
日本発条	24	30	27,391
アドバネクス	1	—	—
立川ブラインド工業	1	1	1,698
三益半導体工業	2	2	4,897
機械(5.0%)			
日本製鋼所	7	8	15,470
三浦工業	10	12	46,848
タクマ	9	9	11,780
ツガミ	5	5	5,672
オークマ	3	3	16,500
東芝機械	2	3	10,176
アマダホールディングス	38	35	38,770
アイダエンジニアリング	6	7	6,497
滝澤鉄工所	1	1	1,799
F U J I	7	12	23,098
牧野フライス製作所	2	3	13,414

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーエスジー	12	13	23,127
ダイジェット工業	—	1	1,792
旭ダイヤモンド工業	6	7	4,225
DMG森精機	15	17	27,198
ソディック	5	6	5,392
ディスコ	3	3	94,012
日東工器	1	1	3,660
日進工具	0.700	0.800	2,254
パンチ工業	2	4	1,676
豊和工業	1	2	1,768
〇 K K	1	2	1,740
石川製作所	1	—	—
東洋機械金属	2	3	1,753
エンシュウ	—	1	1,112
島精機製作所	3	4	8,676
オプトラン	2	3	10,121
NCホールディングス	1	2	1,684
イワキ	—	1	1,603
フリーユー	2	2	3,126
ヤマシンフィルタ	4	6	4,221
日阪製作所	3	3	3,276
やまびこ	4	5	5,421
平田機工	1	1	7,579
ペガサスミシン製造	2	3	1,778
ナプテスコ	13	16	53,867
三井海洋開発	2	3	5,970
レオン自動機	2	2	3,752
S M C	7	8	438,147
ヤマモーターロボティクスホールディングス	3	2	2,169
ホソカワミクロン	0.900	1	5,380
ユニオンツール	1	1	2,986
オイレス工業	3	3	5,558
日精イー・エス・ビー機械	0.700	0.900	3,699
サトーホールディングス	3	4	10,976
技研製作所	1	2	11,037
日本エアータック	2	1	1,958
カワタ	1	1	1,807
日精樹脂工業	2	2	2,229
オカダアイオン	1	1	1,620
小松製作所	112	128	296,010
住友重機械工業	14	16	43,455

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日立建機	10	11	33,652
日工	0.700	3	3,026
巴工業	1	1	2,550
井関農機	2	2	3,805
TOWA	-	2	3,221
丸山製作所	1	1	1,775
北川鉄工所	1	1	2,575
ローツェ	1	1	4,758
タカキタ	2	3	1,795
クボタ	133	150	242,335
荏原実業	0.700	0.900	1,801
三菱化工機	1	1	1,913
月島機械	4	5	7,004
帝国電機製作所	1	2	3,362
新東工業	5	6	6,030
澁谷工業	2	2	6,837
アイチコーポレーション	4	4	3,405
小森コーポレーション	6	7	6,645
鶴見製作所	1	2	4,133
荏原製作所	11	11	33,111
石井鐵工所	0.800	-	-
西島製作所	2	2	2,438
北越工業	2	2	3,761
ダイキン工業	34	36	559,109
オルガノ	0.900	1	6,890
トーヨーカネツ	0.900	1	2,944
栗田工業	13	15	49,819
椿本チエイン	3	4	13,202
木村化工機	4	3	1,782
アネスト岩田	3	4	4,505
ダイフク	13	14	101,065
サムコ	1	0.900	1,728
加藤製作所	1	1	2,328
油研工業	0.800	1	1,843
タダノ	12	13	13,891
フジテック	9	10	17,510
CKD	6	7	15,531
キトー	1	2	3,532
平和	6	7	17,775
理想科学工業	2	2	4,820
SANKYO	6	6	24,538

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本金銭機械	2	3	2,418
マースグループホールディングス	1	1	3,585
フクシマガリレイ	1	1	7,245
ダイコク電機	1	1	1,797
竹内製作所	4	4	9,172
アマノ	7	7	21,319
JUKI	3	4	3,208
サンデンホールディングス	3	3	2,308
蛇の目ミシン工業	3	4	1,794
マックス	3	4	8,630
グローリー	6	7	23,068
新晃工業	2	2	4,326
大和冷機工業	3	4	4,391
セガサミーホールディングス	24	28	46,812
日本ピストンリング	0.900	1	1,861
リケン	1	1	4,426
T P R	3	3	6,266
ツバキ・ナカシマ	3	5	6,948
ホシザキ	7	8	86,984
大豊工業	2	2	1,762
日本精工	51	53	48,578
NTN	53	65	19,345
ジェイテクト	23	27	31,640
不二越	2	2	10,452
日本トムソン	7	8	3,603
THK	15	16	45,573
ユースン精機	1	2	1,977
前澤給装工業	1	1	2,198
イーグル工業	3	3	3,269
日本ピラー工業	2	2	4,376
キッツ	10	11	8,188
マキタ	30	37	153,223
日立造船	19	22	9,540
三菱重工業	41	47	179,071
IHI	19	20	56,108
スター精密	4	4	5,843
電気機器(14.6%)			
日清紡ホールディングス	13	18	19,618
イビデン	15	17	47,606
コニカミノルタ	54	62	40,613
ブラザー工業	32	34	74,327

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
ミネベアミツミ	46	52	114,464	
日立製作所	112	136	571,798	
三菱電機	248	284	445,042	
富士電機	16	17	57,883	
東洋電機製造	1	1	1,671	
安川電機	28	30	114,291	
シンフォニア テクノロジー	3	3	4,384	
明電舎	4	5	10,301	
オリジン	-	1	1,783	
山洋電気	1	1	7,196	
デンヨー	2	2	4,898	
東芝テック	3	3	14,976	
芝浦メカトロニクス	0.400	0.500	1,695	
マブチモーター	6	7	32,864	
日本電産	30	34	481,365	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	-	-	
トレックス・セミコンダクター	1	1	2,379	
東光高岳	1	1	1,827	
ダブル・スコープ	3	4	3,352	
ダイヘン	2	3	10,245	
ヤーマン	3	4	2,884	
JVCケンウッド	19	23	5,821	
ミマキエンジニアリング	2	3	1,796	
第一精工	1	1	2,922	
日新電機	5	6	7,510	
大崎電気工業	5	5	3,431	
オムロン	26	25	171,360	
日東工業	4	4	9,013	
I D E C	3	4	7,597	
不二電機工業	-	1	1,807	
ジー・エス・ユアサ コーポレーション	9	9	20,301	
サクサホールディングス	0.800	1	1,839	
メルコホールディングス	1	1	2,537	
日本電気	32	34	165,427	
富士通	24	27	346,062	
沖電気工業	10	11	15,295	
電気興業	1	1	4,613	
サンケン電気	2	3	8,999	
アイホン	1	1	2,681	
ルネサスエレクトロニクス	25	135	105,788	
セイコーエプソン	30	35	59,692	

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
ワコム	18	19	7,410	
アルバック	5	5	18,798	
E I Z O	2	2	8,206	
ジャパンディスプレイ	58	82	5,829	
日本信号	6	7	9,777	
京三製作所	5	6	3,718	
能美防災	3	3	8,869	
ホーチキ	1	2	2,887	
星和電機	3	-	-	
エレコム	2	3	12,245	
パナソニック	284	324	385,949	
シャープ	24	32	49,053	
アンリツ	16	18	37,020	
富士通ゼネラル	7	7	18,741	
ソニー	167	179	1,351,703	
T D K	13	13	156,865	
帝国通信工業	1	1	1,845	
タムラ製作所	9	9	5,453	
アルプスアルパイン	25	25	46,083	
池上通信機	1	1	1,725	
パイオニア	41	-	-	
日本電波工業	3	3	1,776	
鈴木	2	2	1,833	
日本トリム	0.500	0.400	1,546	
ローランド ディー・ジー	1	1	2,936	
フォスター電機	2	3	4,635	
クラリオン	2	-	-	
S M K	0.700	0.700	1,982	
ヨコオ	1	1	5,317	
ホシデン	7	7	8,533	
ヒロセ電機	3	4	56,716	
日本航空電子工業	5	6	12,486	
T O A	2	3	3,075	
マクセルホールディングス	5	6	8,619	
古野電気	3	3	3,918	
ユニデンホールディングス	0.700	0.900	1,845	
スミダコーポレーション	2	2	2,450	
アイコム	1	1	4,126	
リオン	1	1	3,385	
船井電機	2	2	2,050	
横河電機	24	26	50,607	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新電元工業	0.900	1	3,420
アズビル	16	17	52,572
東亜ディーケーケー	2	1	1,758
日本光電工業	11	11	41,067
共和電業	4	4	1,732
日本電子材料	2	1	1,598
堀場製作所	4	5	38,304
アドバンテスト	17	21	118,371
小野測器	2	3	1,749
エスパック	2	2	5,460
キーエンス	12	25	985,595
日置電機	1	1	5,542
シスメックス	19	20	151,113
日本マイクロニクス	4	4	5,326
メガチップス	2	2	4,680
OBARA GROUP	1	1	4,635
澤藤電機	0.500	0.900	1,755
原田工業	-	1	1,818
コーセル	3	3	4,343
イリソ電子工業	2	2	9,744
オプテックスグループ	4	4	7,111
千代田インテグレ	1	1	2,753
アイ・オー・データ機器	1	1	1,727
レーザーテック	5	12	70,375
スタンレー電気	17	20	58,400
岩崎電気	-	1	1,797
ウシオ電機	15	16	24,337
岡谷電機産業	4	4	1,778
ヘリオス テクノ ホールディング	2	4	1,698
エノモト	-	1	1,692
日本セラミック	2	2	7,142
遠藤照明	2	2	1,783
古河電池	2	2	1,680
双信電機	4	-	-
山一電機	1	2	3,941
図研	1	1	4,366
日本電子	4	5	18,844
カシオ計算機	22	25	52,710
ファナック	23	27	552,690
日本シイエムケイ	6	6	3,752
エンプラス	1	1	4,190

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ローム	12	12	103,698
浜松ホトニクス	17	20	94,146
三井ハイテック	2	3	4,994
新光電気工業	8	9	12,929
京セラ	37	40	298,880
太陽誘電	11	12	43,911
村田製作所	26	83	525,131
ユーシン	3	-	-
双葉電子工業	4	4	5,332
北陸電気工業	1	1	1,665
ニチコン	7	9	8,419
日本ケミコン	1	2	3,929
KOA	3	4	5,095
市光工業	3	4	3,007
小糸製作所	14	17	79,135
ミツバ	4	5	3,775
SCREENホールディングス	4	4	30,429
キャノン電子	2	3	6,081
キャノン	134	153	426,487
リコー	74	72	80,325
象印マホービン	4	8	15,902
MUTOHホールディングス	0.800	1	1,688
東京エレクトロン	16	18	475,618
輸送用機器(7.7%)			
トヨタ紡織	8	8	13,479
芦森工業	1	1	1,652
ユニプレス	4	5	7,128
豊田自動織機	20	23	145,820
モリタホールディングス	4	5	8,830
三櫻工業	3	3	3,650
デンソー	54	62	279,634
東海理化電機製作所	6	7	13,635
三井E&Sホールディングス	9	10	9,043
川崎重工業	19	22	49,039
名村造船所	7	9	2,235
日本車輛製造	0.900	1	2,870
三菱ロジスネクスト	3	3	6,380
近畿車輛	0.700	1	1,764
日産自動車	293	335	169,024
いすゞ自動車	78	82	93,575
トヨタ自動車	277	317	2,458,159

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日野自動車	31	35	35,855
三菱自動車工業	92	105	42,606
エフテック	1	0.900	664
武蔵精密工業	6	6	8,460
日産車体	4	5	5,901
新明和工業	11	7	9,902
極東開発工業	5	5	7,340
日信工業	4	5	12,992
トピー工業	2	2	3,956
ティラド	0.900	1	1,770
曙ブレーキ工業	13	15	3,712
タチエス	4	4	5,884
NOK	13	15	23,929
フタバ産業	6	7	4,898
K Y B	2	3	8,720
大同メタル工業	4	5	3,607
プレス工業	12	14	4,963
ミクニ	3	5	1,760
太平洋工業	5	5	7,628
ケーヒン	5	6	16,815
河西工業	3	3	2,812
アイシン精機	20	23	91,377
マツダ	78	83	75,072
今仙電機製作所	2	2	2,220
本田技研工業	210	223	680,271
スズキ	45	56	273,055
S U B A R U	77	88	257,764
安永	1	1	1,713
ヤマハ発動機	35	37	72,196
ショーワ	5	6	15,316
T B K	3	4	1,708
エクセディ	3	3	8,685
豊田合成	8	9	23,009
愛三工業	3	4	3,049
盟和産業	1	-	-
日本プラスト	2	2	1,771
ヨロズ	2	2	3,904
エフ・シー・シー	4	4	9,816
シマノ	10	10	164,830
ティ・エス テック	5	6	20,394
ジャムコ	1	1	1,815

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
精密機器(2.4%)			
テルモ	35	80	309,057
クリエートメディック	1	1	1,766
日機装	7	8	9,426
日本エム・ディ・エム	1	1	3,068
島津製作所	32	34	97,818
J M S	-	2	2,016
長野計器	2	2	2,049
ブイ・テクノロジ	0.600	1	5,798
東京計器	1	1	1,706
インターアクション	1	1	4,141
オーバル	6	7	1,732
東京精密	4	5	19,762
マニー	3	11	28,792
ニコン	43	46	54,970
トプコン	13	14	17,546
オリンパス	37	157	331,692
理研計器	2	2	5,575
タムロン	2	2	6,205
HOYA	50	56	578,056
シード	1	1	1,729
ノーリツ鋼機	2	1	2,869
エー・アンド・デイ	2	2	2,620
朝日インテック	10	24	68,203
シチズン時計	27	33	16,217
リズム時計工業	0.800	2	1,760
大研医器	2	1	678
メニコン	3	3	19,617
シンシア	3	-	-
松風	1	1	2,546
セイコーホールディングス	3	4	9,148
ニプロ	17	19	24,428
その他製品(2.2%)			
スノーピーク	1	1	1,446
パラマウントベッドホールディングス	2	3	13,710
トランザクション	2	1	1,931
粧美堂	4	4	1,798
ニホンフラッシュ	1	1	3,313
前田工織	2	3	6,606
永大産業	3	5	1,793
アートネイチャー	2	3	2,199

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	25	29	173,754
共立印刷	7	11	1,837
S H O E I	1	1	7,518
フランスベッドホールディングス	3	4	3,668
パイロットコーポレーション	4	4	19,716
萩原工業	1	1	2,627
トッパン・フォームズ	5	6	7,045
フジシールインターナショナル	5	6	13,491
タカラトミー	10	12	13,449
廣済堂	2	2	1,738
アーク	16	19	1,782
プロネクサス	2	2	2,716
ホクシン	10	11	1,725
大建工業	1	1	3,600
凸版印刷	35	40	81,723
大日本印刷	35	37	109,219
図書印刷	2	-	-
共同印刷	0.800	0.900	2,573
N I S S H A	5	5	5,730
光村印刷	-	1	1,821
TAKARA & COMPANY	1	1	2,317
アシックス	24	23	31,396
ツツミ	0.800	0.900	1,775
小松ウオール工業	0.800	0.900	1,865
ヤマハ	14	16	99,372
河合楽器製作所	0.800	0.900	2,713
クリナップ	2	-	-
ピジョン	15	17	67,596
オリバー	-	0.700	2,607
キングジム	2	2	2,016
リンテック	5	6	17,299
イトーキ	4	6	2,574
任天堂	15	17	697,740
三菱鉛筆	4	4	7,473
タカラスタンダード	5	5	10,124
コクヨ	11	13	21,610
ナカバヤシ	2	-	-
グローブライド	1	1	2,870
オカムラ	8	9	9,959
美津濃	2	2	6,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気・ガス業(1.5%)			
東京電力ホールディングス	198	226	98,884
中部電力	76	86	132,174
関西電力	101	107	136,563
中国電力	34	39	57,771
北陸電力	24	26	21,606
東北電力	58	71	72,491
四国電力	22	25	22,425
九州電力	51	58	49,985
北海道電力	23	26	13,805
沖縄電力	4	5	10,647
電源開発	19	22	57,087
エフオン	1	1	919
イーレックス	4	4	5,920
レノバ	3	4	5,320
東京瓦斯	48	54	129,893
大阪瓦斯	48	55	103,312
東邦瓦斯	12	14	57,260
北海道瓦斯	1	1	2,400
広島ガス	5	5	1,966
西部瓦斯	2	3	7,552
静岡ガス	7	8	7,727
メタウォーター	1	1	5,740
陸運業(4.1%)			
S B Sホールディングス	2	2	4,540
東武鉄道	26	30	107,700
相鉄ホールディングス	8	9	24,633
東急	67	71	133,075
京浜急行電鉄	34	36	66,211
小田急電鉄	39	42	97,459
京王電鉄	13	14	85,848
京成電鉄	18	19	77,517
富士急行	3	3	13,182
新京成電鉄	0.200	0.700	1,673
東日本旅客鉄道	44	50	450,700
西日本旅客鉄道	22	25	220,919
東海旅客鉄道	22	23	489,110
西武ホールディングス	31	38	63,817
鴻池運輸	4	4	6,619
西日本鉄道	6	7	20,540

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハマキョウレックス	1	2	6,974
サカイ引越センター	1	1	9,090
近鉄グループホールディングス	23	26	139,073
阪急阪神ホールディングス	31	35	143,779
南海電気鉄道	10	12	33,984
京阪ホールディングス	10	12	57,060
神戸電鉄	0.600	0.600	2,373
名古屋鉄道	18	22	67,736
山陽電気鉄道	1	1	4,005
日本通運	9	9	55,955
ヤマトホールディングス	41	47	90,954
山九	6	7	38,250
丸全昭和運輸	1	2	6,078
センコーグループホールディングス	13	14	12,831
トナミホールディングス	0.600	0.600	2,913
ニッコンホールディングス	9	9	23,078
日本石油輸送	0.500	0.500	1,547
福山通運	3	3	12,223
セイノーホールディングス	17	20	27,088
エスライン	-	1	1,674
神奈川中央交通	0.600	0.700	2,747
日立物流	5	4	15,239
丸和運輸機関	1	2	5,577
C&Fロジホールディングス	2	2	3,415
九州旅客鉄道	19	24	86,880
S Gホールディングス	22	28	62,857
海運業(0.2%)			
日本郵船	19	22	39,459
商船三井	14	17	43,861
川崎汽船	7	8	12,333
N S ユナイテッド海運	1	1	2,766
飯野海運	11	12	4,569
乾汽船	2	1	1,905
空運業(0.5%)			
日本航空	43	48	145,127
ANAホールディングス	43	49	160,982
パスコ	0.300	0.600	1,159
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.700	0.800	6,224
日新	2	2	3,882
三菱倉庫	8	8	24,718

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井倉庫ホールディングス	2	3	5,387
住友倉庫	8	9	14,256
澁澤倉庫	1	1	3,106
東陽倉庫	5	5	1,798
日本トランスシティ	5	5	2,814
ケイヒン	1	1	1,887
中央倉庫	1	1	1,809
安田倉庫	1	2	2,206
東洋埠頭	1	1	1,784
宇徳	2	3	1,785
上組	14	15	34,896
キューソー流通システム	0.600	0.900	1,694
近鉄エクスプレス	4	5	10,812
東海運	-	5	1,663
エーアイティー	1	1	1,824
日本コンセプト	1	-	-
情報・通信業(9.3%)			
NEC ネットズエスアイ	2	2	10,972
クロスキャット	-	1	1,786
システナ	8	9	16,374
デジタルアーツ	1	1	7,658
日鉄ソリューションズ	3	4	14,007
コア	1	1	1,739
ソフトクリエイトホールディングス	1	1	2,119
T I S	8	9	66,216
電算システム	0.900	1	2,862
グリー	16	17	7,814
コーエーテックホールディングス	5	5	17,556
三菱総合研究所	1	1	4,944
ボルテージ	2	3	1,774
電算	0.700	0.800	1,800
AGS	2	2	1,742
ファインデックス	2	2	2,035
ヒト・コミュニケーションズ	1	-	-
ブレインパッド	0.500	0.700	3,563
K L a b	4	5	4,098
ポルトワイン・ビートルホールディングス	3	3	3,325
ネクソン	62	79	144,746
アイスタイル	6	7	2,730
エムアップ	0.800	0.800	2,184
エイチーム	1	1	1,687

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エニグモ	－	2	1,658
テクノスジャパン	2	3	1,736
コロプラ	7	9	8,617
オルトプラス	－	2	1,923
ブロードリーフ	12	13	7,217
クロス・マーケティンググループ	－	5	2,150
デジタルハーツホールディングス	1	1	1,737
システム情報	－	2	1,672
メディアドウホールディングス	0.800	0.900	2,772
じげん	2	6	3,022
サイバーリンクス	1	－	－
フィックスターズ	2	3	4,047
CARTA HOLDINGS	1	1	1,758
オプティム	0.500	0.700	3,255
セレス	0.900	1	1,792
SHIFT	－	0.700	5,054
ティーガイア	2	2	5,785
セック	0.400	0.500	1,835
豆蔵ホールディングス	1	1	3,573
テクマトリックス	1	2	5,660
プロシップ	1	1	1,804
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	58	6	12,321
GMOペイメントゲートウェイ	4	4	34,730
ザッパラス	4	4	1,668
インターネットイニシアティブ	4	4	13,694
さくらインターネット	3	3	1,845
GMOクラウド	0.500	0.700	1,735
SRAホールディングス	1	1	3,868
MINORISソリューションズ	0.900	－	－
朝日ネット	2	2	1,853
eBASE	－	1	2,898
イバント	－	2	1,922
アドソル日進	1	1	2,442
フリービット	1	2	1,686
コムチュア	1	3	6,999
サイバーコム	－	0.900	1,710
アステリア	－	3	1,639
アイル	－	1	1,826
マークラインズ	－	1	2,797
メディカル・データ・ビジョン	2	2	1,942
gumi	3	3	2,613

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モバイルファクトリー	0.600	1	1,850
テラスカイ	－	1	3,245
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1	1	1,820
PCIホールディングス	0.600	0.800	1,800
パイプドHD	1	－	－
PR TIMES	－	0.500	1,290
ランドコンピュータ	1	1	1,795
ダブルスタンダード	－	0.400	1,608
オープンドア	1	1	1,694
マイネット	0.800	－	－
アカツキ	0.900	1	4,730
Ubicomホールディングス	－	1	1,582
LINE	7	6	34,368
チェンジ	－	0.600	2,556
シンクロ・フード	2	3	1,415
オークネット	1	1	2,024
AOI TYO HOLDINGS	2	2	2,074
マクロミル	4	5	5,916
ビーグリー	1	1	2,108
オロ	－	0.700	2,334
プロトコーポレーション	－	2	3,347
野村総合研究所	15	39	104,280
サイバネットシステム	2	－	－
CEホールディングス	2	3	1,713
日本システム技術	1	－	－
インテージホールディングス	3	3	2,926
東邦システムサイエンス	1	2	1,814
ソースネクスト	9	13	5,306
インフォコム	1	3	8,403
ラクスル	－	1	5,167
FIG	4	6	1,814
イーソル	－	1	1,878
アルテリア・ネットワークス	2	3	5,886
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	－	1	1,707
フォーカスシステムズ	1	1	1,694
クレスコ	0.700	1	3,303
フジ・メディア・ホールディングス	25	26	38,224
オービック	8	9	141,911
ジャストシステム	3	4	23,085
TDCソフト	2	2	2,229
Zホールディングス	159	382	161,966

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トレンドマイクロ	13	12	73,036
I Dホールディングス	1	1	1,791
日本オラクル	4	5	54,492
アルファシステムズ	0.800	0.900	2,546
フューチャー	3	3	6,011
CAC Holdings	1	1	2,295
S Bテクノロジー	1	1	2,363
トーセ	1	1	1,687
オービックビジネスコンサルタント	2	2	11,662
伊藤忠テクノソリューションズ	11	12	42,227
アイティフォー	3	3	2,546
東計電算	-	0.400	1,812
エックスネット	1	1	1,844
大塚商会	13	15	73,235
サイボウズ	2	3	7,421
電通国際情報サービス	1	1	8,423
デジタルガレージ	4	5	20,375
イーエムシステムズ	2	3	3,506
ウェザーニューズ	0.800	0.900	3,460
C I J	1	2	1,810
ビジネスエンジニアリング	0.800	0.500	1,590
日本エンタープライズ	8	6	1,766
WOWOW	1	1	3,461
スカラ	2	2	1,701
IMAGICA GROUP	2	3	1,751
ネットワンシステムズ	8	10	26,150
システムソフト	14	18	1,748
アルゴグラフィックス	1	2	8,820
マーベラス	3	4	2,889
エイベックス	4	4	5,956
日本ユニシス	7	8	32,625
兼松エレクトロニクス	1	1	5,085
東京放送ホールディングス	16	17	32,266
日本テレビホールディングス	22	23	33,971
朝日放送グループホールディングス	2	2	2,016
テレビ朝日ホールディングス	6	7	15,607
スカパーJ S A Tホールディングス	18	18	8,582
テレビ東京ホールディングス	2	2	5,439
日本BS放送	1	1	1,727
ビジョン	0.800	2	2,899
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,852

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワイヤレスゲート	3	-	-
コネクシオ	1	1	2,449
日本通信	21	21	4,665
日本電信電話	167	372	1,034,615
KDD I	215	207	708,390
ソフトバンク	194	253	376,172
光通信	2	2	67,193
NTTドコモ	175	206	644,986
エムティーアイ	2	2	1,749
GMOインターネット	8	11	22,836
KADOKAWA	7	7	12,337
学研ホールディングス	0.800	0.900	6,444
ゼンリン	4	5	8,176
昭文社	3	-	-
インプレスホールディングス	10	10	1,743
アイネット	1	1	2,055
松竹	1	1	24,966
東宝	16	16	64,629
東映	1	1	13,960
エヌ・ティ・ティ・データ	65	74	107,961
ビジネスブレイン太田昭和	0.800	0.600	1,682
D T S	2	6	13,578
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11	11	59,024
シーイーシー	2	3	5,814
カプコン	10	13	45,260
アイ・エス・ビー	0.800	0.900	2,089
ジャステック	1	1	1,879
S C S K	6	6	39,936
日本システムウエア	0.900	0.900	2,060
アイネス	3	2	4,536
T K C	2	2	12,720
富士ソフト	3	3	14,814
N S D	4	9	17,046
コナミホールディングス	10	10	44,187
福井コンピュータホールディングス	0.900	1	3,443
J B C Cホールディングス	1	1	3,661
ミロク情報サービス	2	2	6,625
ソフトバンクグループ	102	221	1,223,457
卸売業(5.0%)			
高千穂交易	1	1	1,793
伊藤忠食品	0.600	0.700	3,409

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エレマテック	1	2	2,555
JALUX	0.700	0.800	1,812
あらた	1	2	9,999
トーマンデバイス	0.600	0.500	1,985
東京エレクトロニクス デバイス	0.900	1	2,780
フィールズ	2	3	1,570
双日	135	154	52,873
アルフレッサ ホールディングス	27	31	67,798
横浜冷凍	6	7	7,308
ラサ商事	1	2	1,806
アルコニックス	2	3	3,711
神戸物産	3	9	43,262
あい ホールディングス	3	4	6,924
ディーブイエックス	1	1	1,744
ダイワボウホールディングス	2	2	15,048
マクニカ・富士エレクトロニクス	6	6	11,490
ラクト・ジャパン	0.500	1	3,940
バイタルケーエスケイ・ホールディングス	4	5	5,549
八洲電機	1	2	1,942
レスターホールディングス	1	2	5,347
ジュテックホールディングス	0.900	1	1,851
大光	2	-	-
OCHIホールディングス	1	1	1,758
TOKAIホールディングス	13	14	14,592
黒谷	-	3	1,728
Cominix	1	2	1,790
三洋貿易	1	2	3,374
ビューティガレージ	0.900	0.900	1,828
ウイン・パートナーズ	1	2	2,122
シップヘルスケアホールディングス	5	4	20,835
明治電機工業	0.900	1	1,728
コメダホールディングス	5	6	13,060
富士興産	2	2	1,827
協栄産業	1	1	1,792
小野建	2	2	3,182
佐鳥電機	1	2	1,808
エコートレーディング	2	-	-
伯東	1	1	2,029
コンドーテック	1	2	2,565
ナガイレーベン	3	4	9,372
三菱食品	2	3	9,089

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松田産業	1	2	2,998
第一興商	3	4	20,139
メディバルホールディングス	26	30	66,591
S P K	0.600	0.700	1,836
萩原電気ホールディングス	0.900	1	2,525
アズワン	1	1	17,233
スズデン	-	1	1,839
シモジマ	1	1	1,876
ドウシシャ	2	2	4,076
小津産業	0.800	1	1,689
高速	1	1	2,043
丸文	2	2	1,728
ハピネット	2	2	2,930
日本ライフライン	7	8	11,644
エクセル	0.900	-	-
マルカ	0.800	1	2,069
I DOM	8	7	4,725
進和	1	1	3,707
ダイトロン	1	1	2,316
シークス	3	3	4,888
田中商事	2	2	1,770
オーハシテクニカ	1	1	2,371
白銅	0.900	1	1,689
伊藤忠商事	171	195	509,700
丸紅	241	291	229,981
高島	-	0.900	1,704
長瀬産業	13	15	22,560
蝶理	1	1	3,780
豊田通商	27	31	115,128
三共生興	4	4	2,305
兼松	9	10	13,374
三井物産	202	246	474,657
日本紙パルプ商事	1	1	6,176
日立ハイテック	7	9	77,794
カメイ	3	3	3,949
東都水産	-	0.600	1,713
OUGホールディングス	0.600	0.700	1,820
スターゼン	0.900	1	4,405
山善	9	10	10,965
椿本興業	0.600	0.500	1,995
住友商事	145	176	291,301

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
内田洋行	1	1	7,224
三菱商事	172	196	560,132
第一実業	1	1	4,942
キャノンマーケティングジャパン	7	8	21,848
西華産業	1	1	2,080
佐藤商事	2	2	2,113
菱洋エレクトロ	2	2	5,384
東京産業	2	3	1,755
ユアサ商事	2	2	8,964
神鋼商事	0.600	0.700	1,673
小林産業	5	-	-
阪和興業	4	5	12,979
正栄食品工業	1	1	6,714
カナデン	2	2	3,006
菱電商事	1	2	3,288
フルサト工業	1	1	2,434
岩谷産業	5	6	22,630
すてきナイスグループ	1	-	-
昭光通商	2	2	1,700
イワキ	3	3	1,861
三愛石油	6	6	7,341
稲畑産業	5	6	8,921
ワキタ	5	6	6,120
東邦ホールディングス	7	9	20,178
サンゲツ	7	7	13,821
ミツウロコグループホールディングス	3	4	4,686
シナネンホールディングス	1	1	2,584
伊藤忠エネクス	5	6	5,704
サンリオ	7	7	15,539
サンワテクノス	1	2	1,782
リョーサン	2	3	7,480
新光商事	2	4	3,484
トーホー	1	1	2,272
三信電気	2	1	2,424
東陽テクニカ	2	3	3,321
モスフードサービス	3	3	11,055
加賀電子	2	2	6,398
ソーダニッカ	2	2	1,687
立花エレテック	1	2	3,614
PALTAC	4	4	22,590
三谷産業	5	5	1,800

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西本Wismettacホールディングス	0.600	0.500	1,572
ヤマシタヘルスケアホールディングス	-	0.800	1,677
国際紙パルプ商事	5	6	1,900
ヤマタネ	1	1	2,066
丸紅建材リース	0.800	1	1,829
日鉄物産	1	2	9,150
泉州電業	0.800	0.900	2,678
トラスコ中山	5	5	13,670
オートバックスセブン	9	10	16,005
モリト	2	2	1,821
加藤産業	3	4	15,246
イノテック	1	1	1,846
イエローハット	2	5	8,718
J Kホールディングス	2	2	1,857
日伝	2	2	4,855
北沢産業	5	6	1,683
杉本商事	1	1	2,838
因幡電機産業	3	8	20,920
バイテックホールディングス	1	-	-
東テク	0.800	0.900	2,207
ミスミグループ本社	30	35	93,401
タキヒヨー	0.800	1	1,825
蔵王産業	1	1	1,740
スズケン	11	11	47,659
ジェコス	1	1	1,964
グローセル	3	-	-
小売業(4.5%)			
ローソン	6	7	44,162
サンエー	1	2	10,488
カワチ薬品	1	2	4,598
エービーシー・マート	3	4	29,788
ハードオフコーポレーション	1	2	1,760
アスクル	2	2	9,758
ゲオホールディングス	3	5	6,125
アダストリア	3	3	8,213
ジーフット	2	2	1,777
くら寿司	1	1	8,100
キャンドウ	1	1	2,120
バルグループホールディングス	1	1	4,802
エディオン	10	12	12,953
サーラコーポレーション	5	5	3,448

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハローズ	0.900	1	3,007
フジオフードシステム	—	2	3,991
あみやき亭	0.500	0.600	2,049
ひらまつ	4	6	1,628
大黒天物産	0.600	0.700	2,334
ハニーズホールディングス	2	2	3,355
アルペン	1	2	3,990
クオールホールディングス	3	4	5,690
ジンズホールディングス	1	1	11,115
ビックカメラ	13	16	17,928
DCMホールディングス	13	15	15,764
ペッパーフードサービス	1	2	1,911
MonotaRO	15	19	52,436
東京一番フーズ	—	3	1,824
DDホールディングス	0.700	1	1,852
きちりホールディングス	2	2	1,782
アークランドサードホールディングス	1	2	4,020
J. フロント リテイリング	31	33	42,919
ドトール・日レスホールディングス	4	4	9,382
マツモトキヨシホールディングス	10	11	44,950
ブロンコビリー	1	1	3,795
ZOZO	26	19	33,081
物語コーポレーション	0.600	0.700	5,887
ココカラファイン	2	2	14,790
三越伊勢丹ホールディングス	45	48	39,168
Hamee	1	0.600	956
ウエルシアホールディングス	6	8	51,875
クリエイトSDホールディングス	3	4	12,769
丸善CHIホールディングス	—	5	1,835
ミサワ	3	2	2,012
ティーライフ	1	2	1,698
チムニー	0.700	0.900	2,002
シュッピン	2	1	1,860
ネクステージ	3	4	4,012
ジョイフル本田	7	8	10,217
鳥貴族	0.800	0.900	2,380
キリン堂ホールディングス	1	1	1,856
ホットランド	1	1	2,454
すかいらーくホールディングス	22	31	58,184
SFPホールディングス	—	1	2,559
綿半ホールディングス	0.900	1	1,830

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エイト・スーパーマーケット・ホールディングス	7	8	7,767
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2	1,804
BEENOS	—	1	1,777
あさひ	2	2	2,656
日本調剤	0.900	0.800	3,080
コスモス薬品	1	1	28,188
オンリー	—	2	1,789
セブン&アイ・ホールディングス	102	109	429,240
薬王堂	1	—	—
クワイエット・レストランズ・ホールディングス	6	7	16,897
ツルハホールディングス	5	6	77,287
サンマルクホールディングス	1	2	4,771
フェリシモ	1	1	1,695
トリドールホールディングス	3	3	9,572
TOKYO BASE	2	3	1,645
JMホールディングス	0.900	1	3,172
サツドラホールディングス	0.800	1	1,815
パロックジャパンリミテッド	2	1	1,865
クスリのアオキホールディングス	2	2	16,400
スシローグローバルホールディングス	2	3	27,280
LIXILビバ	2	2	6,566
メディカルシステムネットワーク	—	3	1,790
ノジマ	4	5	10,685
カッパ・クワイエット	3	3	5,647
ライトオン	2	3	1,767
良品計画	3	37	64,765
三城ホールディングス	3	—	—
アドヴァン	3	4	5,357
アルビス	0.900	1	2,367
コナカ	3	4	1,800
G-7ホールディングス	0.700	1	4,019
イオン北海道	2	2	2,326
コジマ	3	4	2,352
ヒマラヤ	1	2	1,832
コーナン商事	3	4	9,640
エコス	0.900	1	1,838
ワタミ	3	3	3,887
マルシェ	1	2	1,838
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	14	61	120,663
西松屋チェーン	5	6	5,526
ゼンショーホールディングス	11	13	32,990

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
幸楽苑ホールディングス	1	1	3,328
サイゼリヤ	4	4	10,497
V Tホールディングス	8	11	4,802
魚力	1	-	-
ユニテッドアローズ	2	2	7,989
ハイデイ日高	3	4	7,628
京都きもの友禅	2	5	1,787
コロワイド	8	9	20,497
ピーシーデポコーポレーション	3	3	2,157
壱番屋	1	2	10,860
トップカルチャー	5	-	-
P L A N T	1	3	1,763
スギホールディングス	5	5	30,408
薬王堂ホールディングス	-	1	2,616
ヴィア・ホールディングス	3	3	2,230
スクロール	3	5	1,788
ヨンドシーホールディングス	2	2	6,431
ファミリーマート	6	22	56,179
木曽路	3	3	10,533
S R S ホールディングス	2	3	3,425
千趣会	-	5	2,641
ケーヨー	4	5	3,112
上新電機	2	3	6,656
日本瓦斯	4	4	16,412
ロイヤルホールディングス	4	4	10,427
東天紅	-	1	1,751
いなげや	2	3	4,749
島忠	5	5	15,926
チヨダ	2	2	4,231
ライフコーポレーション	1	2	5,436
リンガーハット	3	3	8,183
Mr Max HD	3	3	1,797
テンアライド	3	4	1,783
AOK I ホールディングス	4	5	5,706
オークワ	3	4	6,441
コメリ	3	4	9,498
青山商事	4	5	7,458
しまむら	2	3	25,476
はせがわ	3	4	1,817
高島屋	19	20	22,766

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松屋	4	5	4,345
エイチ・ツー・オー リテイリング	12	13	12,448
近鉄百貨店	0.900	1	3,762
パルコ	2	-	-
丸井グループ	20	25	60,934
アクシアル リテイリング	2	2	8,498
イオン	94	107	247,710
イズミ	5	5	18,952
平和堂	5	5	10,596
フジ	3	3	6,201
ヤオコー	2	3	18,560
ゼビオホールディングス	3	3	3,740
ケーズホールディングス	25	27	35,532
O l y m p i c グループ	2	-	-
Genky DrugStores	1	1	2,336
総合メディカルホールディングス	2	2	6,112
ブックオフグループホールディングス	-	1	1,666
アインホールディングス	3	3	23,052
元気寿司	0.700	0.700	2,034
ヤマダ電機	74	85	50,668
アークランドサカモト	4	4	5,196
ニトリホールディングス	10	12	200,376
グルメ杵屋	1	2	2,322
愛眼	5	7	1,766
吉野家ホールディングス	8	9	23,266
松屋フーズホールディングス	1	1	5,798
サガミホールディングス	3	3	4,895
関西スーパーマーケット	1	2	2,302
王将フードサービス	1	2	13,503
プレナス	2	3	5,983
ミニストップ	1	2	3,196
アークス	4	5	10,915
パローホールディングス	5	6	11,166
藤久	2	-	-
ベルク	1	1	7,826
大 庄	1	1	2,439
ファーストリテイリング	3	3	220,668
サンドラッグ	9	10	34,597
サックスパー ホールディングス	2	2	1,924
やまや	0.700	0.800	1,764

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベルーナ	6	6	3,684
銀行業(5.6%)			
島根銀行	2	2	1,705
じもとホールディングス	16	18	1,946
めぶきフィナンシャルグループ	127	145	34,070
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3	3	4,579
九州フィナンシャルグループ	40	46	18,860
ゆうちょ銀行	69	79	80,035
富山第一銀行	5	6	2,063
コンコルディア・フィナンシャルグループ	156	164	69,216
西日本フィナンシャルホールディングス	15	19	13,026
関西みらいフィナンシャルグループ	11	16	9,282
三十三フィナンシャルグループ	2	2	3,967
第四北越フィナンシャルグループ	4	4	12,475
新生銀行	18	20	34,814
あおぞら銀行	13	16	50,601
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,709	1,929	1,085,753
りそなホールディングス	269	307	135,128
三井住友トラスト・ホールディングス	48	53	212,053
三井住友フィナンシャルグループ	173	193	727,318
千葉銀行	87	96	58,322
群馬銀行	49	55	19,670
武蔵野銀行	3	4	6,959
千葉興業銀行	6	7	2,556
筑波銀行	10	11	2,293
七十七銀行	7	9	14,877
青森銀行	2	2	5,660
秋田銀行	1	1	3,398
山形銀行	2	3	4,237
岩手銀行	1	1	4,577
東邦銀行	22	25	6,099
みちのく銀行	1	1	2,399
ふくおかフィナンシャルグループ	19	23	43,565
静岡銀行	61	69	52,119
十六銀行	3	3	7,248
スルガ銀行	25	28	12,513
八十二銀行	44	67	27,242
山梨中央銀行	3	3	3,026
大垣共立銀行	3	5	12,276
福井銀行	2	2	3,720
北國銀行	2	2	9,077

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
清水銀行	1	1	2,336
富山銀行	0.500	0.800	1,574
滋賀銀行	4	5	14,694
南都銀行	2	4	11,632
百五銀行	22	25	7,963
京都銀行	8	10	42,420
紀陽銀行	8	9	15,731
ほくほくフィナンシャルグループ	16	18	18,849
広島銀行	36	41	21,528
山陰合同銀行	14	16	10,109
中国銀行	15	24	22,822
鳥取銀行	1	1	1,835
伊予銀行	32	40	21,400
百十四銀行	2	3	6,006
四国銀行	3	4	3,943
阿波銀行	4	4	10,911
大分銀行	1	1	3,636
宮崎銀行	1	1	4,466
佐賀銀行	1	1	2,551
十八銀行	1	-	-
沖縄銀行	2	2	8,632
琉球銀行	5	6	6,831
セブン銀行	82	93	29,858
みずほフィナンシャルグループ	3,336	3,808	604,377
山口フィナンシャルグループ	30	35	22,645
長野銀行	0.900	1	1,759
名古屋銀行	2	2	7,774
北洋銀行	37	42	9,579
愛知銀行	0.900	1	3,395
中京銀行	1	1	2,642
大光銀行	0.900	1	1,757
愛媛銀行	3	4	4,304
京葉銀行	10	11	6,783
栃木銀行	12	13	2,619
北日本銀行	0.800	0.900	1,858
東和銀行	4	4	3,792
トモニホールディングス	19	21	7,378
フィデアホールディングス	23	27	3,291
池田泉州ホールディングス	26	32	6,053
証券・商品先物取引業(0.9%)			
F P G	7	8	8,342

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SBIホールディングス	29	31	77,060
ジャフコ	4	4	20,124
大和証券グループ本社	197	224	120,816
野村ホールディングス	432	493	278,362
岡三証券グループ	20	23	9,392
丸三証券	7	8	4,191
東洋証券	8	12	1,788
東証証券フィナンシャル・ホールディングス	29	32	10,368
光世証券	1	3	1,832
水戸証券	7	8	1,798
いちよし証券	5	5	3,198
松井証券	12	16	14,352
だいがう証券ビジネス	0.200	2	1,806
マネックスグループ	22	21	5,296
カブドットコム証券	18	-	-
極東証券	3	3	2,869
岩井コスモホールディングス	2	2	3,294
藍澤証券	4	5	3,465
マネーパートナーズグループ	5	-	-
スパークス・グループ	-	9	2,541
保険業(2.3%)			
かんぽ生命保険	9	9	18,027
SOMPOホールディングス	43	52	230,140
アニコムホールディングス	2	2	8,993
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	64	73	273,995
ソニーフィナンシャルホールディングス	20	23	54,901
第一生命ホールディングス	138	158	258,438
東京海上ホールディングス	89	100	613,825
T&Dホールディングス	75	83	101,817
アドバンスクリエイト	0.500	0.700	1,271
その他金融業(1.2%)			
全国保証	7	7	35,945
日本モーゲージサービス	1	0.800	1,780
アルヒ	2	4	8,136
プレミアグループ	0.500	1	3,088
クレディセゾン	17	19	35,946
芙蓉総合リース	2	2	20,068
みずほリース	4	4	14,168
東京センチュリー	4	5	28,728
日本証券金融	10	12	6,175
アイフル	37	42	12,925

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リコーリース	1	2	9,273
イオンフィナンシャルサービス	15	17	31,286
アコム	49	56	29,388
ジャックス	2	3	7,657
オリエントコーポレーション	66	75	12,144
日立キャピタル	5	6	20,361
アプラスフィナンシャル	18	21	1,746
オリックス	163	175	337,452
三菱UFJリース	55	71	49,698
九州リースサービス	-	3	1,812
日本取引所グループ	66	80	159,192
イー・ギャランティ	2	3	3,885
アサックス	2	2	1,775
NECキャピタルソリューション	1	1	2,678
不動産業(2.6%)			
いちご	31	35	14,137
日本駐車場開発	29	30	4,482
スター・マイカ・ホールディングス	-	1	2,258
ヒューリック	51	59	78,876
三栄建築設計	1	1	1,788
スター・マイカ	1	-	-
野村不動産ホールディングス	16	17	46,767
三重交通グループホールディングス	5	5	3,311
サムティ	3	4	7,444
ディア・ライフ	3	3	2,048
コーセーアールイー	-	2	1,754
日本商業開発	1	1	3,187
プレサンスコーポレーション	3	4	5,874
ユニゾホールディングス	3	4	24,528
THEグローバル社	2	3	1,712
日本管理センター	1	1	2,534
サンセイランディック	1	2	1,640
エストラスト	1	2	1,732
フージャースホールディングス	5	5	3,903
オープンハウス	4	8	25,110
東急不動産ホールディングス	66	76	59,588
飯田グループホールディングス	20	23	38,048
イーブランド	2	2	1,696
ムゲンエステート	1	2	1,544
ハウスドゥ	1	1	1,785
アグレ都市デザイン	2	3	1,809

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジェイ・エス・ビー	－	0.300	1,551
テンポイノベーション	1	1	1,810
パーク24	14	15	39,435
パラカ	0.900	－	－
三井不動産	130	138	406,722
三菱地所	172	196	420,296
平和不動産	4	5	17,493
東京建物	26	30	52,754
ダイビル	7	7	9,950
京阪神ビルディング	4	4	6,637
住友不動産	55	63	251,370
テーオーシー	5	5	4,642
東京楽天地	0.400	0.500	2,795
レオパレス21	30	36	14,826
スターツコーポレーション	3	3	9,830
フジ住宅	3	3	2,171
空港施設	2	3	1,778
明和地所	2	2	1,750
ゴールドクレスト	1	2	4,171
エスリード	1	1	2,068
日神グループホールディングス	3	4	2,185
日本エスコン	4	5	4,569
タカラレーベン	11	12	6,272
AVANTIA	1	1	1,710
イオンモール	12	14	25,564
毎日コムネット	－	1	1,721
ファースト住建	1	1	1,872
カチタス	2	3	13,912
トーセイ	3	3	5,296
穴吹興産	0.500	1	1,637
サンフロンティア不動産	3	3	4,929
エフ・ジェー・ネクスト	2	2	2,661
グランディハウス	3	3	1,719
日本空港ビルデング	7	8	46,013
サービス業(5.2%)			
日本工営	1	1	5,976
LIFULL	9	9	4,816
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	2,907
日本M&Aセンター	17	20	75,440
メンバーズ	－	1	1,754
UTグループ	－	3	8,604

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タケエイ	2	2	2,636
ビーネックスグループ	1	3	3,335
コシダカホールディングス	6	6	9,704
パソナグループ	2	2	3,828
CDS	1	1	1,797
リンクアンドモチベーション	4	6	3,042
GCA	2	3	2,643
エス・エム・エス	8	8	19,731
サニーサイドアップグループ	－	1	1,547
パーソルホールディングス	23	27	47,235
リニカル	1	1	1,688
クックパッド	7	9	2,954
アイ・ケイ・ケイ	2	2	1,852
学情	1	1	2,017
スタジオアリス	1	1	2,563
シミックホールディングス	1	1	2,400
NJS	1	1	1,793
総合警備保障	9	10	59,724
カカコム	17	20	58,017
セントケア・ホールディング	2	3	1,744
ルネサンス	1	1	2,539
ディップ	3	3	12,312
オプトホールディング	1	1	2,908
新日本科学	3	2	1,957
ツクイ	5	6	4,140
ベネフィット・ワン	3	7	14,511
エムスリー	50	59	183,593
ツカダ・グローバルホールディング	2	3	1,721
アウトソーシング	12	15	14,740
ウェルネット	2	2	1,798
ワールドホールディングス	0.700	1	1,953
ディー・エヌ・エー	12	13	20,920
博報堂DYホールディングス	33	37	54,545
ぐるなび	3	4	3,971
タカミヤ	2	2	1,728
ジャパンバストレスキューシステム	1	2	1,806
ファンコミュニケーションズ	6	7	3,270
ライク	1	0.900	1,715
ビジネス・ブレイクスルー	4	4	1,872
エスパール	－	5	4,196
WDBホールディングス	1	1	3,165

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バリユーコマース	1	1	3,648
インフォーマート	13	29	22,230
J Pホールディングス	6	8	2,626
E P Sホールディングス	3	4	5,166
プレステージ・インターナショナル	4	10	10,067
アミューズ	1	1	3,955
ドリームインキュベータ	0.900	-	-
クイック	1	1	2,454
T A C	6	8	1,762
ケネディクス	20	25	17,001
電通グループ	29	28	94,640
ティクアンドギヴ・ニーズ	0.900	-	-
ぴあ	0.700	0.800	3,108
イオンファンタジー	0.800	1	2,222
シーティーエス	2	3	2,250
ネグシィーズグループ	0.800	1	1,720
みらかホールディングス	6	7	21,325
アルプス技研	2	2	4,708
日本空調サービス	2	2	2,108
オリエンタルランド	28	28	398,675
ダスキン	6	7	20,993
明光ネットワークジャパン	3	3	2,931
ファルコホールディングス	1	1	2,896
秀英予備校	3	4	1,772
ラウンドワン	7	7	7,090
リゾートトラスト	10	12	20,001
ビー・エム・エル	3	3	11,567
りらいあコミュニケーションズ	4	4	7,080
リソー教育	12	12	4,736
ユー・エス・エス	29	30	57,273
東京個別指導学院	-	1	1,167
サイバーエージェント	14	15	68,796
楽天	110	126	120,016
クリーク・アンド・リパー社	1	1	1,708
テー・オー・ダブリュー	2	2	1,889
山田コンサルティンググループ	-	1	2,015
セントラルスポーツ	0.900	1	2,976
フルキャストホールディングス	2	2	6,650
エン・ジャパン	2	4	16,728
リソルホールディングス	0.400	0.400	1,658
テクノプロ・ホールディングス	4	5	41,742

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インターワークス	2	3	1,775
アイ・アールジャパンホールディングス	-	1	8,107
K e e P e r 技研	1	1	1,680
三機サービス	-	1	1,791
G u n o s y	1	1	1,970
イー・ガーディアン	1	1	2,679
リブセンス	5	6	1,798
ジャパンマテリアル	6	8	12,591
ベクトル	2	3	4,076
ウチヤマホールディングス	3	3	1,698
チャーム・ケア・コーポレーション	-	2	2,157
キャリアリンク	4	3	1,868
I B J	0.800	1	2,319
アサンテ	1	1	2,062
N・フィールド	1	3	1,686
バリユーHR	-	0.600	2,067
M&Aキャピタルパートナーズ	0.600	1	7,125
ライドオンエクスプレスホールディングス	1	1	1,665
E R Iホールディングス	1	2	1,761
アビスト	0.500	0.700	1,773
シグマクシス	1	1	3,163
ウィルグループ	1	1	1,791
エスコロー・エージェント・ジャパン	5	8	1,823
日本ビューホテル	1	-	-
リクルートホールディングス	170	194	885,364
エラン	1	1	2,630
日本郵政	195	222	223,612
ベルシステム24ホールディングス	4	4	6,786
鎌倉新書	1	2	3,296
一蔵	2	2	1,682
L I T A L I C O	-	0.900	2,228
エアトリ	0.700	1	1,593
アトラエ	-	0.700	1,963
ストライク	0.700	1	4,730
ソラスト	5	7	7,950
セラク	2	1	1,839
インソース	0.800	1	3,760
バイカレント・コンサルティング	1	1	12,608
M S - J a p a n	1	1	1,641
グレイステクノロジー	0.800	1	3,846
ジャパエレベーターサービスホールディングス	1	2	6,426

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フルテック	1	1	1,808
日総工産	0.700	2	1,636
キュービーネットホールディングス	1	1	2,508
RPAホールディングス	-	1	1,854
スプリックス	0.700	1	1,666
リログループ	13	14	38,287
東祥	1	1	3,362
エイチ・アイ・エス	4	4	10,437
ラックランド	0.700	0.800	1,703
共立メンテナンス	3	4	18,180
イチネンホールディングス	2	3	4,125
建設技術研究所	1	1	4,218
スペース	1	1	2,077
燦ホールディングス	0.600	1	1,876
東京テアトル	1	1	1,710
ナガワ	0.700	0.900	5,958
よみうりランド	0.500	0.600	2,457
東京都競馬	1	1	6,615
常磐興産	1	1	1,783
カナモト	3	4	11,677
東京ドーム	8	11	10,637
西尾レントオール	2	2	8,192
トランス・コスモス	2	2	6,895
乃村工藝社	5	11	13,699
藤田観光	0.900	1	2,960
KNT-CTホールディングス	1	1	1,948
日本管財	2	2	5,512
トーカイ	2	2	6,401
白洋舎	0.500	0.700	1,936
セコム	25	28	277,660

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セントラル警備保障	1	1	7,098
丹青社	4	5	5,859
メイテック	3	3	19,176
応用地質	2	2	4,112
船井総研ホールディングス	4	5	16,693
進学会ホールディングス	2	3	1,836
いであ	1	-	-
学究社	1	1	1,755
ベネッセホールディングス	8	9	26,568
イオンディライト	2	3	12,408
ナック	1	1	1,691
ニチイ学館	3	3	5,202
ダイセキ	4	4	13,445
ステップ	1	1	1,812
合計	株数・金額	28,825	33,485 67,041,297
	銘柄数<比率>	1,840	1,860 <98.3%>

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
国内 TOPIX	1,107	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2020年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	67,041,297	97.8
コール・ローン等、その他	1,498,347	2.2
投資信託財産総額	68,539,644	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	68,539,644,735円
コール・ローン等	1,329,651,106
株式(評価額)	67,041,297,600
未収入金	6,565,600
未収配当金	108,315,429
差入委託証拠金	53,815,000
(B)負債	314,337,370
未払金	17,881,300
未払解約金	296,452,837
その他未払費用	3,233
(C)純資産総額(A-B)	68,225,307,365
元本	37,895,533,054
次期繰越損益金	30,329,774,311
(D)受益権総口数	37,895,533,054口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,004円

(注1) 期首元本額 34,475,094,643円
 期中追加設定元本額 14,196,038,295円
 期中一部解約元本額 10,775,599,884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	6,326,072,571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)	4,354,685,255円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,063,446円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,533,145,263円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,401,509,272円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,653,662,525円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	8,430,005円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,457,287円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	33,985,449円
DCニッセイ国内株式インデックス	308,410,353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	14,991,687,269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)	708,282,393円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	95,609,361円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,255,178円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	69,742,388円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	126,906,078円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	31,936,187円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	49,469,361円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,859,103円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	4,160,513円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,135,532円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,585,333円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,339,643円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	9,914,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	7,978,547円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	12,198,373円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	12,051,741円

損益の状況

当期(2019年2月21日~2020年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,509,558,501円
受取配当金	1,509,685,711
受取利息	46,015
その他収益金	911,555
支払利息	△ 1,084,780
(B)有価証券売買損益	2,694,096,667
売買益	6,804,968,518
売買損	△ 4,110,871,851
(C)先物取引等損益	110,770,160
取引益	315,518,540
取引損	△ 204,748,380
(D)信託報酬等	△ 67,872
(E)当期損益金(A+B+C+D)	4,314,357,456
(F)前期繰越損益金	23,841,312,270
(G)追加信託差損益金	10,206,215,225
(H)解約差損益金	△ 8,032,110,640
(I)合計(E+F+G+H)	30,329,774,311
次期繰越損益金(I)	30,329,774,311

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

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