

第8期末 (2023年2月20日)

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 14,433円 |
| 純資産総額 | 542億円 |
| 騰落率 | 7.3% |
| 分配金 | 0円 |

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

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

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:2022年2月22日～2023年2月20日

第8期(決算日 2023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8期の決算を行いました。

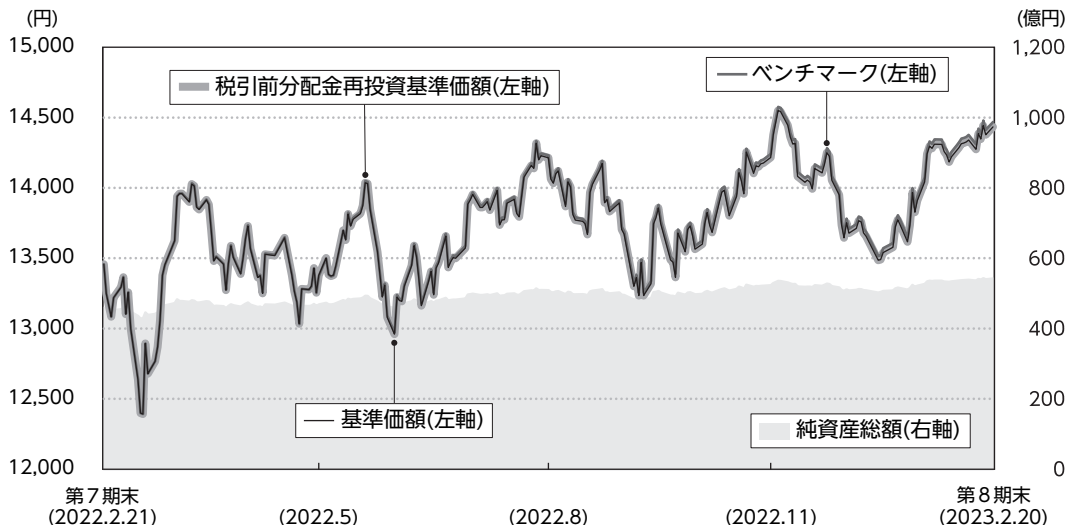
当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

運用経過

2022年2月22日～2023年2月20日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|---------|----------------|------|
| 第8期首 | 13,457円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第8期末 | 14,433円 | 騰落率(分配金再投資ベース) | 7.3% |

(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、ファンドの購入価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8期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 21円 | 0.153% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,734円です。 |
| (投信会社) | (9) | (0.066) | 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) | (9) | (0.066) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 |
| (受託会社) | (3) | (0.022) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | $\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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) | (0.001) | |
| 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) | ・ 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 | 21 | 0.156 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料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。

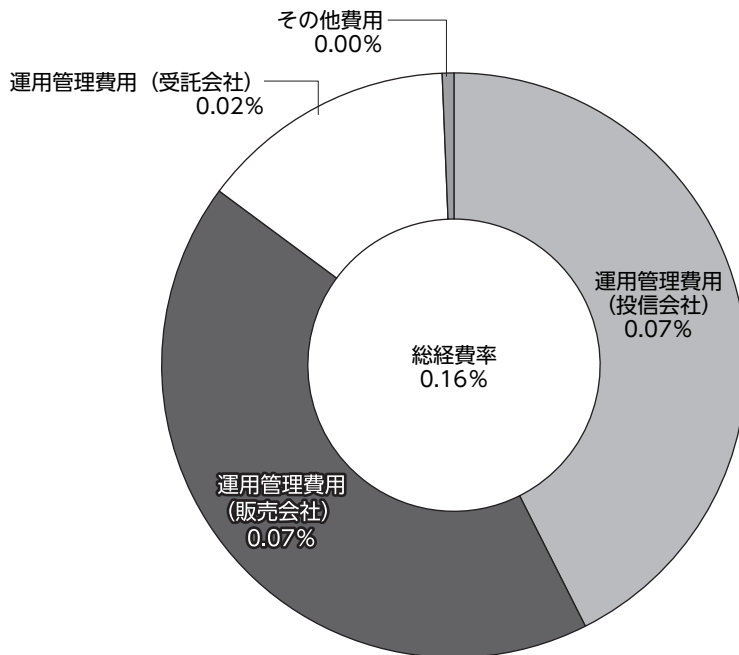
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。



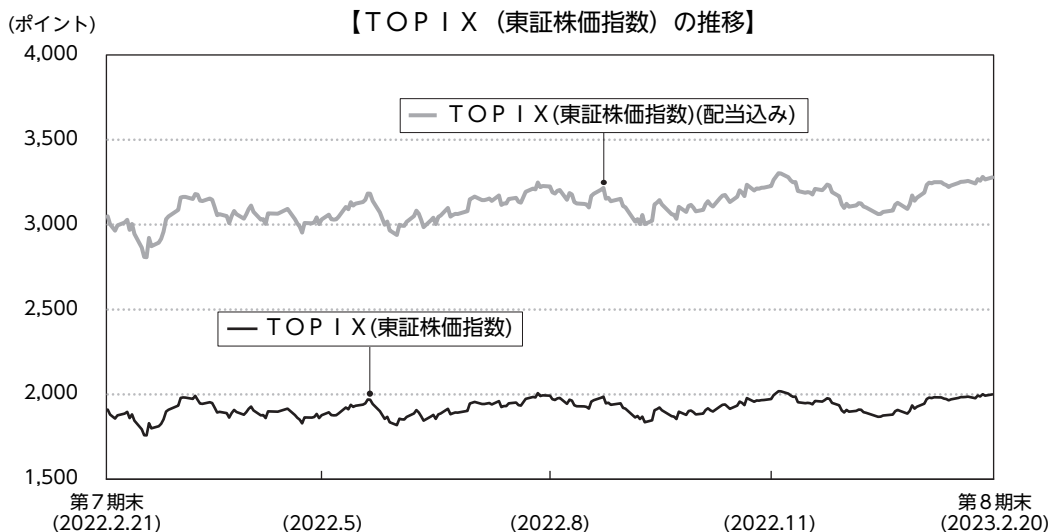
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

国内株式市況



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初より2022年3月上旬にかけては、米金融政策が引き締め姿勢へ転換したことに加えて、ロシアのウクライナ侵攻を背景とした資源高によるインフレリスクの高まりを受けて株価は下落しましたが、3月末にかけては原油価格の上昇が一服したことやロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待感などから上昇しました。4月以降はインフレ加速に伴う米長期金利の上昇や金融引き締め政策に加えて、中国における新型コロナウイルスの感染拡大の影響が警戒され、下落しました。5月中旬以降は国内企業の本決算発表の内容がおおむね想定内であったことや、米長期金利の上昇に一服感が出たことから株価は上昇しましたが、6月中旬以降は米消費者物価指数（CPI）の高い伸びなどを受けてインフレ加速への警戒感が高まり下落しました。

7月以降は米国による対中制裁関税の一部解除検討に関する報道などを受けて米国株が反発に転じたことなどが好感されて上昇しましたが、8月中旬以降は米長期金利の上昇懸念が再び重荷となったことから下落しました。10月から11月にかけては米長期金利の上昇懸念がやや緩和し株価は上昇基調となりましたが、12月になると欧米の金融引き締めに伴う景気後退への警戒感に加えて、下旬に日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことによる長期金利の上昇や円高進行を受けて下落しました。1月中旬には日銀が金融緩和策の現状維持を決定したことから市場に安心感が広がり、その後も円安に転じたことや米金融引き締めへの過度な警戒感がやわらいだことから上昇基調となり、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

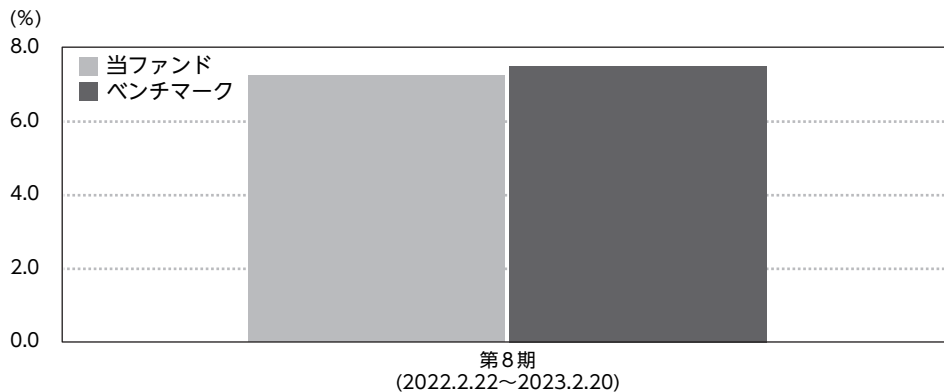
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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した。

*ベンチマークはTOPIX（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+7.3%となり、ベンチマーク騰落率（+7.5%）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 |
|------------|-----------------------|
| | 2022年2月22日～2023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 | 5,148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に運用を行います。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

| | 第8期末 2023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。

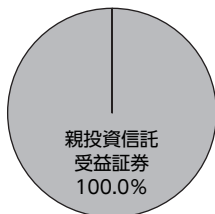
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

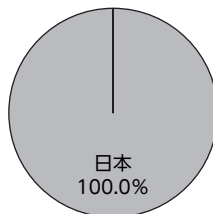
| 項目 | 第8期末 2023年2月20日 |
|------------|--------------------|
| 純資産総額 | 54,208,040,459円 |
| 受益権総口数 | 37,557,259,667口 |
| 1万口当たり基準価額 | 14,433円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は15,303,371,384円、同解約元本額は11,820,413,190円です。

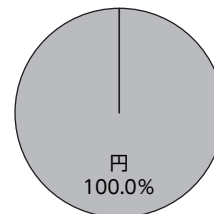
■資産別配分



■国別配分



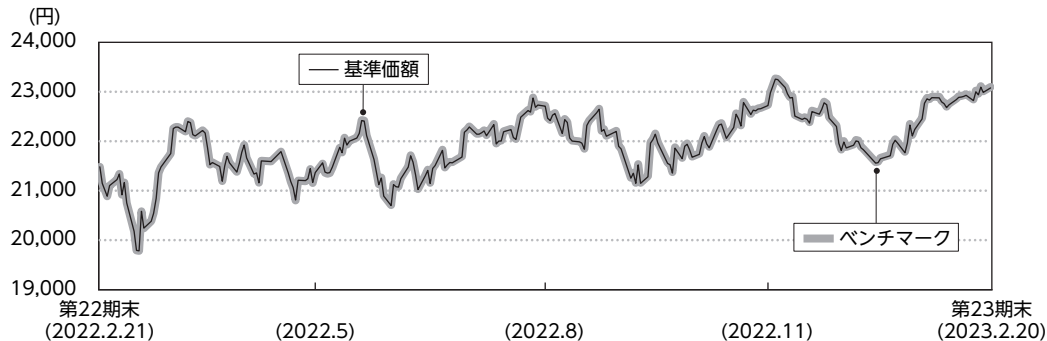
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023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

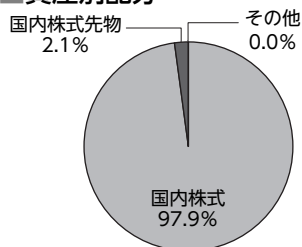
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| トヨタ自動車 | 円 | 3.5% |
| ソニーグループ | 円 | 2.7 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円 | 2.1 |
| TOPIX 先物 0503月 買 | 円 | 2.1 |
| キーエンス | 円 | 2.0 |
| 日本電信電話 | 円 | 1.7 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 円 | 1.5 |
| 武田薬品工業 | 円 | 1.3 |
| 第一三共 | 円 | 1.3 |
| 日立製作所 | 円 | 1.2 |
| 組入銘柄数 | | 1,822 |

■ 1万口当たりの費用明細

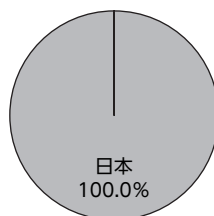
2022.2.22~2023.2.20

| 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 |

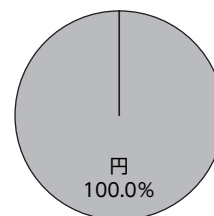
■ 資産別配分



■ 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(2023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。

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 税引前 分配金 | 期中 騰落率 | (ご参考) | ベンチ マーク | 期中 騰落率 | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|---------------|------------|-----------|----------------|------------|-----------|------------|------------|-----------|
| | | | | 基準価額+ 累計分配金 | | | | | |
| | 円 | 円 | % | 円 | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 6期(2021年2月22日) | 13,386 | 0 | 18.3 | 13,386 | 13,566 | 18.6 | 99.3 | 0.7 | 36,858 |
| 7期(2022年2月21日) | 13,457 | 0 | 0.5 | 13,457 | 13,657 | 0.7 | 96.1 | 3.7 | 45,852 |
| 8期(2023年2月20日) | 14,433 | 0 | 7.3 | 14,433 | 14,684 | 7.5 | 97.9 | 2.1 | 54,208 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | ベンチ マーク | 騰落率 | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 |
|----------------|--------|------|------------|------|------------|------------|
| | | | | | | |
| (期首)2022年2月21日 | 13,457 | - | 13,657 | - | 96.1 | 3.7 |
| 2月末 | 13,293 | △1.2 | 13,493 | △1.2 | 96.0 | 4.0 |
| 3月末 | 13,862 | 3.0 | 14,073 | 3.0 | 96.4 | 3.6 |
| 4月末 | 13,527 | 0.5 | 13,735 | 0.6 | 97.2 | 2.8 |
| 5月末 | 13,628 | 1.3 | 13,843 | 1.4 | 97.5 | 2.6 |
| 6月末 | 13,346 | △0.8 | 13,559 | △0.7 | 98.0 | 2.0 |
| 7月末 | 13,841 | 2.9 | 14,064 | 3.0 | 98.3 | 1.7 |
| 8月末 | 14,006 | 4.1 | 14,234 | 4.2 | 97.9 | 1.9 |
| 9月末 | 13,234 | △1.7 | 13,452 | △1.5 | 96.2 | 3.7 |
| 10月末 | 13,903 | 3.3 | 14,137 | 3.5 | 97.5 | 2.5 |
| 11月末 | 14,311 | 6.3 | 14,554 | 6.6 | 97.2 | 2.8 |
| 12月末 | 13,656 | 1.5 | 13,890 | 1.7 | 98.2 | 1.8 |
| 2023年1月末 | 14,258 | 6.0 | 14,505 | 6.2 | 97.8 | 2.2 |
| (期末)2023年2月20日 | 14,433 | 7.3 | 14,684 | 7.5 | 97.9 | 2.1 |

(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

2022年2月22日～2023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 | 9,579,139 | 20,965,395 | 7,433,701 | 16,374,723 |

(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 | 128,054,577千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 163,688,125千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.78 |

(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

2022年2月22日～2023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

2023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 | 21,344,932 | 23,490,370 | 54,208,728 |

(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81,219,744千口です。

投資信託財産の構成

2023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 | 54,208,728 | 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 197,626 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 54,406,355 | 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

(2023年2月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|--------------------------------|-----------------|
| (A)資産 | 54,406,355,267円 |
| コール・ローン等 | 38,298,627 |
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額) | 54,208,728,452 |
| 未収入金 | 159,328,188 |
| (B)負債 | 198,314,808 |
| 未払解約金 | 158,638,958 |
| 未払信託報酬 | 39,394,525 |
| その他未払費用 | 281,325 |
| (C)純資産総額(A-B) | 54,208,040,459 |
| 元本 | 37,557,259,667 |
| 次期繰越損益金 | 16,650,780,792 |
| (D)受益権総口数 | 37,557,259,667口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,433円 |

| | |
|-----------|-----------------|
| (注) 期首元本額 | 34,074,301,473円 |
| 期中追加設定元本額 | 15,303,371,384円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,820,413,190円 |

損益の状況

当期(2022年2月22日～2023年2月20日)

| 項目 | 当期 |
|-----------------|-------------------|
| (A)配当等収益 | △ 6,845円 |
| 受取利息 | 1,188 |
| 支払利息 | △ 8,033 |
| (B)有価証券売買損益 | 3,397,653,674 |
| 売買益 | 3,832,503,127 |
| 売買損 | △ 434,849,453 |
| (C)信託報酬等 | △ 76,309,931 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 3,321,336,898 |
| (E)前期繰越損益金 | 2,844,034,380 |
| (分配準備積立金) | (3,668,364,401) |
| (繰越欠損金) | (△ 824,330,021) |
| (F)追加信託差損益金* | 10,485,409,514 |
| (配当等相当額) | (13,134,580,631) |
| (売買損益相当額) | (△ 2,649,171,117) |
| (G)合計(D+E+F) | 16,650,780,792 |
| 次期繰越損益金(G) | 16,650,780,792 |
| 追加信託差損益金 | 10,485,409,514 |
| (配当等相当額) | (13,172,439,857) |
| (売買損益相当額) | (△ 2,687,030,343) |
| 分配準備積立金 | 6,165,371,278 |

- (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 | 1,222,938,262円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 1,274,068,615円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 13,172,439,857円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 3,668,364,401円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d) | 19,337,811,135円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり) | 5,148.89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

運用部門については、CO-CIO（取締役執行役員、統括部長）の2名体制からCIO（取締役執行役員）1名とCO-CIO（統括部長）1名の体制に変更しました。

新たにCIOが就任し、従来のCO-CIOのうちの1名（統括部長）が、引き続きCO-CIOを務めています。（2022年3月25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 23 期

(計算期間：2022年2月22日～2023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。



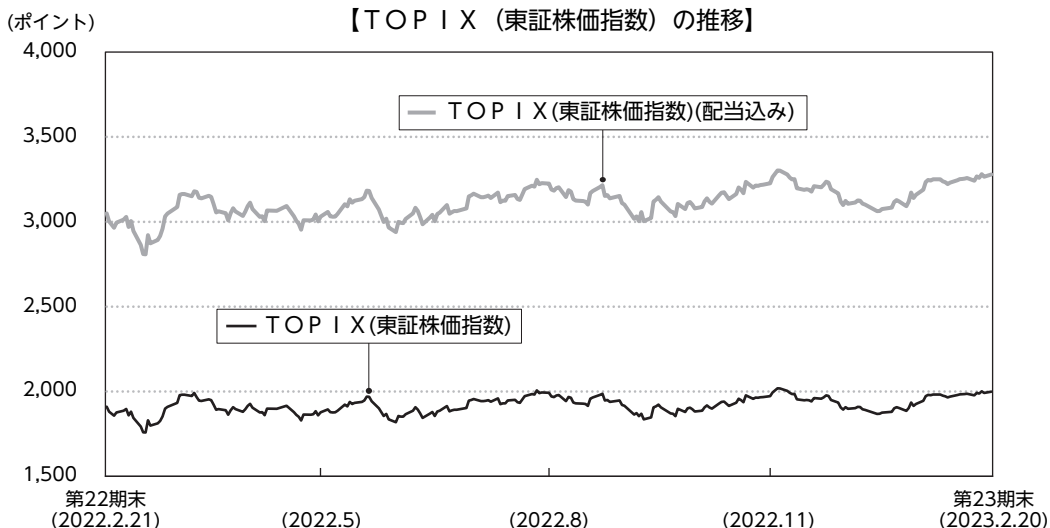
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年2月22日～2023年2月20日

国内株式市況

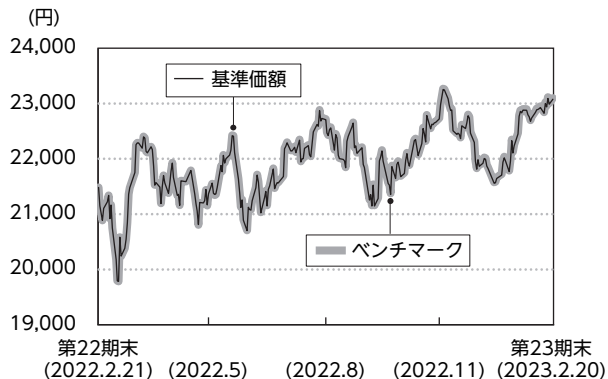


当期の国内株式市場は上昇しました。

期初より2022年3月上旬にかけては、米金融政策が引き締め姿勢へ転換したことに加えて、ロシアのウクライナ侵攻を背景とした資源高によるインフレリスクの高まりを受けて株価は下落しましたが、3月末にかけては原油価格の上昇が一服したことやロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待感などから上昇しました。4月以降はインフレ加速に伴う米長期金利の上昇や金融引き締め政策に加えて、中国における新型コロナウイルスの感染拡大の影響が警戒され、下落しました。5月中旬以降は国内企業の本決算発表の内容がおおむね想定内であったことや、米長期金利の上昇に一服感が出たことから株価は上昇しましたが、6月中旬以降は米消費者物価指数（CPI）の高い伸びなどを受けてインフレ加速への警戒感が高まり下落しました。

7月以降は米国による対中制裁関税の一部解除検討に関する報道などを受けて米国株が反発に転じたことなどが好感されて上昇しましたが、8月中旬以降は米長期金利の上昇懸念が再び重荷となったことから下落しました。10月から11月にかけては米長期金利の上昇懸念がやや緩和し株価は上昇基調となりましたが、12月になると欧米の金融引き締めに伴う景気後退への警戒感に加えて、下旬に日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことによる長期金利の上昇や円高進行を受けて下落しました。1月中旬には日銀が金融緩和策の現状維持を決定したことから市場に安心感が広がり、その後も円安に転じたことや米金融引き締めへの過度な警戒感がやわらいだことから上昇基調となり、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。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

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した。

*ベンチマークはTOPIX（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

当期の基準価額騰落率は+7.4%となり、ベンチマーク騰落率（+7.5%）にほぼ連動しました。

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 | % | | % | % | | | |
| 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 |
| 21期(2021年2月22日) | 21,336 | | 18.5 | 21,558 | | 18.6 | 99.3 | 0.7 | 170,293 |
| 22期(2022年2月21日) | 21,482 | | 0.7 | 21,702 | | 0.7 | 96.1 | 3.7 | 117,060 |
| 23期(2023年2月20日) | 23,077 | | 7.4 | 23,334 | | 7.5 | 97.9 | 2.1 | 187,428 |

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 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)2022年2月21日 | 21,482 | | — | 21,702 | | — | 96.1 | 3.7 |
| 2月末 | 21,222 | | △1.2 | 21,441 | | △1.2 | 96.0 | 4.0 |
| 3月末 | 22,132 | | 3.0 | 22,362 | | 3.0 | 96.4 | 3.6 |
| 4月末 | 21,601 | | 0.6 | 21,826 | | 0.6 | 97.2 | 2.8 |
| 5月末 | 21,765 | | 1.3 | 21,997 | | 1.4 | 97.5 | 2.6 |
| 6月末 | 21,317 | | △0.8 | 21,546 | | △0.7 | 98.0 | 2.0 |
| 7月末 | 22,110 | | 2.9 | 22,348 | | 3.0 | 98.3 | 1.7 |
| 8月末 | 22,377 | | 4.2 | 22,618 | | 4.2 | 97.9 | 1.9 |
| 9月末 | 21,147 | | △1.6 | 21,376 | | △1.5 | 96.2 | 3.7 |
| 10月末 | 22,219 | | 3.4 | 22,465 | | 3.5 | 97.5 | 2.5 |
| 11月末 | 22,873 | | 6.5 | 23,128 | | 6.6 | 97.2 | 2.8 |
| 12月末 | 21,829 | | 1.6 | 22,072 | | 1.7 | 98.2 | 1.8 |
| 2023年1月末 | 22,794 | | 6.1 | 23,049 | | 6.2 | 97.8 | 2.2 |
| (期末)2023年2月20日 | 23,077 | | 7.4 | 23,334 | | 7.5 | 97.9 | 2.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年2月22日～2023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) | 0.001% (0.000) (0.001) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| 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 | 0.001 | |

(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（21,942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

2022年2月22日～2023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 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 41,228 (1,144) | 94,389,662 | 15,136 | 33,664,915 |

(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 | 33,729 | 34,424 | - | - |

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年2月22日～2023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 | 1,881 | 3,930,598 | 2,089 | トヨタ自動車 | 564 | 1,158,068 | 2,051 |
| ソニーグループ | 244 | 2,752,545 | 11,262 | ソニーグループ | 63 | 710,223 | 11,167 |
| 日本電信電話 | 490 | 1,921,328 | 3,915 | ソフトバンクグループ | 104 | 649,181 | 6,200 |
| キーエンス | 34 | 1,655,773 | 48,414 | キーエンス | 9 | 511,535 | 53,845 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 1,959 | 1,455,421 | 742 | 三菱商事 | 122 | 506,757 | 4,153 |
| 任天堂 | 31 | 1,253,174 | 39,657 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 639 | 469,238 | 733 |
| 東京エレクトロン | 23 | 1,228,527 | 51,402 | 日本電信電話 | 114 | 456,957 | 4,001 |
| KDDI | 269 | 1,192,922 | 4,429 | 日立製作所 | 64 | 437,551 | 6,741 |
| 日立製作所 | 180 | 1,184,515 | 6,551 | ダイキン工業 | 16 | 370,817 | 22,204 |
| 武田薬品工業 | 306 | 1,141,626 | 3,721 | KDDI | 83 | 361,799 | 4,322 |

(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

2023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 | 2 | 3 | 12,342 | |
| ニッスイ | 58 | 89 | 48,579 | |
| マルハニチロ | 9 | 13 | 32,491 | |
| 雪国まいたけ | 4 | 7 | 7,753 | |
| カネコ種苗 | 2 | 3 | 5,678 | |
| サカタのタネ | 7 | 11 | 45,708 | |
| ホフト | 4 | 7 | 14,859 | |
| 鉱業(0.3%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 11 | 13 | 5,323 | |
| 日鉄鉱業 | 1 | 3 | 12,708 | |
| 三井松島ホールディングス | 2 | 4 | 15,160 | |
| I N P E X | 234 | 330 | 470,865 | |
| 石油資源開発 | 6 | 10 | 50,388 | |
| K&Oエナジーグループ | 2 | 4 | 8,792 | |

| 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(1.9%) | | | | |
| ヒノキヤグループ | 1 | - | - | |
| ショーボンドホールディングス | 8 | 12 | 64,172 | |
| ミライト・ワン | 18 | 31 | 46,624 | |
| タマホーム | 3 | 6 | 20,254 | |
| ファーストコーポレーション | 4 | 1 | 972 | |
| スペースバリューホールディングス | 6 | - | - | |
| 安藤・間 | 29 | 51 | 45,082 | |
| 東急建設 | 17 | 25 | 17,043 | |
| コムシスホールディングス | 18 | 30 | 75,077 | |
| ピーアールホールディングス | 8 | 14 | 5,061 | |
| 高松コンストラクショングループ | 3 | 5 | 11,495 | |
| 東建コーポレーション | 1 | 2 | 22,040 | |
| ソネット | 2 | 4 | 4,598 | |
| ヤマウラ | 3 | 4 | 5,154 | |

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 |
| オリエンタル白石 | 19 | 32 | 10,143 |
| 大成建設 | 39 | 62 | 272,125 |
| 大林組 | 135 | 223 | 218,485 |
| 清水建設 | 126 | 187 | 137,657 |
| 飛島建設 | 3 | 6 | 7,348 |
| 長谷工コーポレーション | 40 | 64 | 99,265 |
| 松井建設 | 5 | 8 | 5,585 |
| 銭高組 | 0.800 | 1 | 4,438 |
| 鹿島建設 | 98 | 138 | 222,569 |
| 不動テトラ | 2 | 4 | 6,978 |
| 鉄建建設 | 2 | 4 | 8,046 |
| 西松建設 | 8 | 10 | 37,683 |
| 三井住友建設 | 30 | 50 | 21,218 |
| 大豊建設 | 2 | 2 | 10,140 |
| 佐田建設 | 6 | 10 | 5,540 |
| ナカノフドー建設 | 8 | 15 | 4,967 |
| 奥村組 | 8 | 10 | 32,673 |
| 東鉄工業 | 6 | 8 | 23,744 |
| 浅沼組 | 1 | 5 | 16,275 |
| 戸田建設 | 56 | 76 | 54,528 |
| 熊谷組 | 6 | 10 | 29,710 |
| 北野建設 | 1 | - | - |
| 植木組 | 2 | 3 | 4,833 |
| 矢作建設工業 | 6 | 8 | 6,961 |
| ピーエス三菱 | 4 | 7 | 5,071 |
| 日本ハウスホールディングス | 9 | 13 | 5,293 |
| 新日本建設 | 5 | 8 | 7,664 |
| NIPPO | 11 | - | - |
| 東亜道路工業 | 0.700 | 1 | 7,728 |
| 日本道路 | 1 | 1 | 8,788 |
| 東亜建設工業 | 3 | 5 | 14,072 |
| 日本国土開発 | 13 | 18 | 10,322 |
| 若築建設 | 2 | 2 | 8,394 |
| 東洋建設 | 15 | 20 | 18,341 |
| 五洋建設 | 53 | 88 | 58,476 |
| 世紀東急工業 | 6 | 8 | 6,560 |
| 福田組 | 1 | 2 | 10,596 |
| 住友林業 | 34 | 47 | 126,456 |
| 日本基礎技術 | 5 | 8 | 4,341 |
| 巴コーポレーション | 6 | 10 | 4,356 |
| 大和ハウス工業 | 124 | 174 | 543,704 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ライト工業 | 8 | 11 | 23,490 |
| 積水ハウス | 146 | 195 | 498,154 |
| 日特建設 | 4 | 6 | 5,586 |
| 北陸電気工事 | 3 | 7 | 5,606 |
| ユアテック | 7 | 13 | 10,460 |
| 日本リーテック | 2 | 5 | 4,872 |
| 四電工 | 1 | 2 | 5,174 |
| 中電工 | 6 | 9 | 20,651 |
| 関電工 | 21 | 34 | 29,993 |
| きんでん | 30 | 44 | 66,396 |
| 東京エネシス | 4 | 6 | 5,617 |
| トーエネック | 1 | 2 | 7,150 |
| 住友電設 | 3 | 5 | 14,124 |
| 日本電設工業 | 7 | 10 | 15,460 |
| エクシオグループ | 20 | 28 | 69,091 |
| 新日本空調 | 3 | 3 | 6,667 |
| 九電工 | 10 | 15 | 51,756 |
| 三機工業 | 8 | 13 | 20,655 |
| 日揮ホールディングス | 41 | 61 | 108,644 |
| 中外炉工業 | 1 | 3 | 5,349 |
| ヤマト | 4 | 6 | 4,991 |
| 太平電業 | 3 | 3 | 14,917 |
| 高砂熱学工業 | 12 | 15 | 30,683 |
| 三晃金属工業 | 1 | 1 | 3,840 |
| 朝日工業社 | 0.700 | 2 | 5,470 |
| 明星工業 | 8 | 10 | 8,442 |
| 大気社 | 6 | 7 | 26,362 |
| ダイダン | 3 | 4 | 9,233 |
| 日比谷総合設備 | 4 | 5 | 10,848 |
| テスホールディングス | 2 | 6 | 7,209 |
| インフロニア・ホールディングス | 57 | 65 | 67,923 |
| 東洋エンジニアリング | 5 | - | - |
| レイズネクスト | 6 | 9 | 12,132 |
| 食料品(3.4%) | | | |
| ニッポン | 12 | 16 | 26,972 |
| 日清製粉グループ本社 | 48 | 58 | 90,538 |
| 日東富士製粉 | - | 1 | 5,346 |
| 昭和産業 | 4 | 5 | 13,695 |
| 鳥越製粉 | 4 | - | - |
| 中部飼料 | 4 | 8 | 9,013 |
| フィード・ワン | 5 | 9 | 6,283 |

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 |
| 日本甜菜製糖 | 2 | 3 | 5,896 |
| DM三井製糖ホールディングス | 3 | 6 | 12,685 |
| 塩水港精糖 | 14 | 23 | 4,593 |
| ウェルネオシュガー | 2 | 3 | 5,360 |
| 森永製菓 | 10 | 11 | 45,688 |
| 中村屋 | 1 | 1 | 4,880 |
| 江崎グリコ | 11 | 17 | 62,471 |
| 名糖産業 | 1 | 3 | 5,055 |
| 井村屋グループ | 2 | 3 | 7,520 |
| 不二家 | 2 | 4 | 10,719 |
| 山崎製パン | 32 | 42 | 66,654 |
| モロゾフ | 1 | 2 | 6,820 |
| 亀田製菓 | 2 | 4 | 17,280 |
| 寿スピリッツ | 4 | 6 | 57,821 |
| カルビー | 19 | 28 | 83,918 |
| 森永乳業 | 8 | 11 | 54,948 |
| 六甲バター | 3 | 4 | 6,214 |
| ヤクルト本社 | 32 | 44 | 414,876 |
| 明治ホールディングス | 28 | 38 | 249,738 |
| 雪印メグミルク | 10 | 15 | 27,375 |
| プリマハム | 5 | 8 | 18,152 |
| 日本ハム | 16 | 24 | 92,365 |
| 林兼産業 | 5 | 7 | 3,206 |
| 丸大食品 | 4 | 6 | 9,336 |
| S Foods | 3 | 6 | 18,975 |
| 柿安本店 | 1 | 2 | 4,905 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 27 | 48 | 34,869 |
| サッポロホールディングス | 14 | 20 | 64,581 |
| アサヒグループホールディングス | 101 | 144 | 682,623 |
| キリンホールディングス | 158 | 283 | 567,839 |
| 宝ホールディングス | 29 | 42 | 45,667 |
| オエノンホールディングス | 12 | 18 | 4,992 |
| 養命酒製造 | 1 | 2 | 4,938 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 30 | 49 | 69,672 |
| サントリー食品インターナショナル | 28 | 44 | 209,508 |
| ガイドグループホールディングス | 2 | 3 | 17,280 |
| 伊藤園 | 13 | 23 | 104,130 |
| キーコーヒー | 4 | 7 | 14,518 |
| 日清オイリオグループ | 5 | 8 | 29,084 |
| 不二製油グループ本社 | 9 | 14 | 29,170 |
| J-オイルミルズ | 4 | 6 | 9,977 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| キッコーマン | 31 | 41 | 271,232 |
| 味の素 | 95 | 153 | 632,880 |
| ブルドックソース | 1 | 2 | 5,143 |
| キューピー | 22 | 33 | 75,757 |
| ハウス食品グループ本社 | 16 | 19 | 51,628 |
| カゴメ | 16 | 29 | 88,779 |
| アリアケジャパン | 3 | 5 | 26,867 |
| ピエトロ | 1 | - | - |
| エバラ食品工業 | - | 1 | 5,168 |
| ニチレイ | 19 | 28 | 78,064 |
| 東洋水産 | 20 | 31 | 176,569 |
| イートアンドホールディングス | 1 | 2 | 6,277 |
| 大冷 | 1 | - | - |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 4 | 7 | 7,861 |
| 日清食品ホールディングス | 17 | 22 | 251,498 |
| 永谷園ホールディングス | 1 | 3 | 6,494 |
| 一正蒲鉾 | 3 | 6 | 4,306 |
| フジッコ | 4 | 6 | 11,955 |
| ロック・フィールド | 4 | 7 | 12,158 |
| 日本たばこ産業 | 231 | 412 | 1,151,092 |
| ケンコーマヨネーズ | 2 | 4 | 5,542 |
| わらべや日洋ホールディングス | 2 | 4 | 8,671 |
| なとり | 2 | 3 | 7,975 |
| ピッグルスコーポレーション | 2 | - | - |
| ファーマフーズ | 4 | 9 | 14,676 |
| ユーグレナ | 22 | 40 | 38,703 |
| 紀文食品 | 3 | 5 | 4,901 |
| ピッグルスホールディングス | - | 4 | 5,096 |
| ミヨシ油脂 | 2 | 3 | 3,144 |
| 理研ビタミン | 4 | 5 | 10,983 |
| 繊維製品(0.5%) | | | |
| 片倉工業 | 4 | 5 | 10,301 |
| グンゼ | 2 | 4 | 20,952 |
| 東洋紡 | 16 | 27 | 28,897 |
| ユニチカ | 11 | - | - |
| 富士紡ホールディングス | 1 | 2 | 8,060 |
| 倉敷紡績 | 3 | 4 | 11,745 |
| 日本毛織 | 12 | 16 | 16,190 |
| 帝国繊維 | 4 | 7 | 11,469 |
| 帝人 | 39 | 61 | 88,823 |
| 東レ | 305 | 427 | 342,812 |

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 |
| 日本フェルト | 6 | 11 | 4,761 |
| イチカワ | — | 3 | 4,693 |
| アツギ | 5 | 10 | 3,937 |
| セーレン | 8 | 12 | 31,235 |
| ソトー | 3 | 5 | 4,622 |
| 東海染工 | 2 | 1 | 1,723 |
| 小松マテーレ | 6 | 9 | 6,714 |
| ワコールホールディングス | 10 | 12 | 28,720 |
| ホギメディカル | 5 | 8 | 27,735 |
| クラウドIAホールディングス | 12 | — | — |
| T S I ホールディングス | 14 | 22 | 13,007 |
| マツオカコーポレーション | 2 | 4 | 6,518 |
| ワールド | 5 | 8 | 10,955 |
| 三陽商会 | 0.400 | — | — |
| オンワードホールディングス | 25 | 41 | 13,951 |
| ゴールドウイン | 7 | 11 | 129,390 |
| デサント | 8 | 11 | 43,175 |
| ヤマトインターナショナル | 10 | 17 | 4,375 |
| パルプ・紙(0.2%) | | | |
| 特種東海製紙 | 2 | 2 | 8,546 |
| 王子ホールディングス | 176 | 265 | 142,946 |
| 日本製紙 | 20 | 33 | 33,432 |
| 三菱製紙 | 6 | 8 | 2,421 |
| 北越コーポレーション | 27 | 40 | 31,675 |
| 大王製紙 | 20 | 28 | 30,371 |
| 阿波製紙 | 9 | 11 | 8,547 |
| レンゴー | 39 | 58 | 52,464 |
| トーモク | 2 | 3 | 5,675 |
| ザ・パック | 3 | 4 | 13,601 |
| 化学(6.1%) | | | |
| 北の達人コーポレーション | 15 | 26 | 8,984 |
| クラレ | 61 | 101 | 122,592 |
| 旭化成 | 279 | 398 | 380,113 |
| レゾナック・ホールディングス | 36 | 61 | 142,465 |
| 住友化学 | 309 | 473 | 225,716 |
| 住友精化 | 1 | 2 | 11,380 |
| 日産化学 | 22 | 30 | 178,467 |
| ラサ工業 | 1 | 2 | 5,475 |
| クレハ | 3 | 5 | 45,650 |
| 多木化学 | 1 | 2 | 10,825 |
| テイカ | 3 | 4 | 5,043 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 石原産業 | 7 | 11 | 12,247 |
| 片倉コープアグリ | 2 | 1 | 3,553 |
| 日本曹達 | 5 | 6 | 30,668 |
| 東ソー | 60 | 85 | 152,167 |
| トクヤマ | 13 | 20 | 43,589 |
| セントラル硝子 | 6 | 10 | 29,661 |
| 東亞合成 | 24 | 32 | 40,180 |
| 大阪ソーダ | 3 | 3 | 16,017 |
| 関東電化工業 | 9 | 12 | 12,484 |
| デンカ | 15 | 23 | 68,300 |
| 信越化学工業 | 72 | 107 | 2,068,917 |
| 日本カーバイド工業 | 2 | 3 | 4,578 |
| 堺化学工業 | 3 | 4 | 8,824 |
| 第一稀元素化学工業 | 3 | 5 | 5,927 |
| エア・ウォーター | 39 | 60 | 97,524 |
| 日本酸素ホールディングス | 40 | 61 | 146,269 |
| 日本化学工業 | 1 | 2 | 5,535 |
| 日本パーカライジング | 21 | 31 | 29,925 |
| 高圧ガス工業 | 6 | 9 | 6,156 |
| 四国化成ホールディングス | 5 | 7 | 9,750 |
| 戸田工業 | 0.900 | — | — |
| ステラ ケミファ | 2 | 3 | 9,568 |
| 保土谷化学工業 | 1 | 1 | 5,616 |
| 日本触媒 | 7 | 9 | 55,484 |
| 大日精化工業 | 3 | 4 | 7,840 |
| カネカ | 10 | 14 | 50,297 |
| 三菱瓦斯化学 | 39 | 47 | 92,344 |
| 三井化学 | 38 | 53 | 174,200 |
| J S R | 39 | 59 | 185,058 |
| 東京応化工業 | 7 | 11 | 81,088 |
| 大阪有機化学工業 | 3 | 4 | 9,600 |
| 三菱ケミカルグループ | 281 | 430 | 349,781 |
| K H ネオケム | 7 | 10 | 27,825 |
| ダイセル | 60 | 93 | 87,984 |
| 住友ベークライト | 6 | 9 | 42,112 |
| 積水化学工業 | 88 | 130 | 236,335 |
| 日本ゼオン | 38 | 38 | 49,215 |
| アイカ工業 | 11 | 16 | 48,783 |
| U B E | 19 | 32 | 68,070 |
| 積水樹脂 | 6 | 9 | 17,976 |
| タキロンシーアイ | 9 | 13 | 6,908 |

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 |
| 旭有機材 | 2 | 4 | 11,907 |
| ニチバン | 2 | 4 | 7,224 |
| リケンテクノス | 10 | 13 | 7,576 |
| 大倉工業 | 2 | 3 | 5,670 |
| 積水化成成品工業 | 6 | 12 | 4,836 |
| 群栄化学工業 | 1 | 2 | 5,233 |
| ダイキョーニシカワ | 8 | 14 | 8,890 |
| 森六ホールディングス | 2 | 3 | 5,849 |
| 恵和 | 1 | 4 | 6,330 |
| 日本化薬 | 33 | 48 | 58,099 |
| カーリットホールディングス | 2 | 6 | 4,561 |
| 日本精化 | 3 | 3 | 8,884 |
| 扶桑化学工業 | 3 | 5 | 21,505 |
| トリケミカル研究所 | 4 | 8 | 19,660 |
| A D E K A | 19 | 22 | 47,241 |
| 日油 | 14 | 19 | 116,230 |
| 新日本理化 | 11 | 5 | 1,241 |
| ハリマ化成グループ | 3 | 5 | 5,138 |
| 花王 | 95 | 155 | 794,514 |
| 第一工業製薬 | 1 | 2 | 4,875 |
| 石原ケミカル | 2 | 3 | 5,105 |
| 日華化学 | 3 | 5 | 4,653 |
| 三洋化成工業 | 2 | 3 | 16,692 |
| 有機合成薬品工業 | 11 | 15 | 4,597 |
| 大日本塗料 | 5 | 7 | 6,552 |
| 日本ペイントホールディングス | 158 | 282 | 354,851 |
| 関西ペイント | 43 | 58 | 107,748 |
| 中国塗料 | 9 | 11 | 12,391 |
| 日本特殊塗料 | 3 | - | - |
| 藤倉化成 | 6 | 11 | 5,164 |
| 太陽ホールディングス | 6 | 9 | 22,901 |
| D I C | 17 | 24 | 60,482 |
| サカタインクス | 8 | 14 | 14,526 |
| 東洋インキSCホールディングス | 8 | 12 | 23,687 |
| T & K T O K A | - | 5 | 7,250 |
| 富士フィルムホールディングス | 75 | 122 | 786,969 |
| 資生堂 | 80 | 133 | 820,810 |
| ライオン | 52 | 76 | 113,061 |
| 高砂香料工業 | 3 | 4 | 10,762 |
| マンダム | 9 | 13 | 19,789 |
| ミルボン | 5 | 9 | 55,290 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ファンケル | 17 | 27 | 71,451 |
| コーセー | 8 | 13 | 204,490 |
| コタ | 2 | 5 | 8,851 |
| シーボン | 1 | 2 | 4,640 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 18 | 32 | 57,552 |
| ノエビアホールディングス | 3 | 5 | 31,692 |
| アジュバンホールディングス | 2 | 5 | 5,050 |
| 新日本製薬 | - | 3 | 5,126 |
| エステー | 2 | 4 | 7,585 |
| アグロ カネショウ | 2 | 2 | 4,284 |
| コニシ | 7 | 10 | 19,013 |
| 長谷川香料 | 7 | 13 | 38,742 |
| 星光PMC | 4 | 8 | 4,806 |
| 小林製薬 | 12 | 18 | 154,752 |
| 荒川化学工業 | 3 | 5 | 5,313 |
| メック | 3 | 5 | 11,760 |
| 日本高純度化学 | 1 | 2 | 4,908 |
| タカラバイオ | 11 | 17 | 30,478 |
| J C U | 4 | 7 | 22,068 |
| 新田ゼラチン | 5 | 0.500 | 406 |
| O A T アグリオ | - | 2 | 4,037 |
| デクセリアルズ | 11 | 18 | 49,827 |
| アース製薬 | 3 | 5 | 28,188 |
| 北興化学工業 | 4 | 6 | 5,267 |
| 大成ラミック | 1 | 2 | 5,794 |
| クミアイ化学工業 | 16 | 25 | 22,148 |
| 日本農薬 | 7 | 11 | 8,143 |
| アキレス | 2 | 4 | 5,224 |
| 有沢製作所 | 6 | 10 | 14,700 |
| 日東電工 | 26 | 46 | 389,296 |
| レック | 5 | 9 | 8,490 |
| 三光合成 | 7 | - | - |
| きもと | 13 | 5 | 1,100 |
| 藤森工業 | 3 | 5 | 15,375 |
| 前澤化成工業 | 2 | 4 | 5,658 |
| 未来工業 | 1 | 3 | 4,959 |
| J S P | 2 | 4 | 7,155 |
| エフピコ | 7 | 12 | 43,620 |
| 天馬 | 3 | 5 | 12,457 |
| 信越ポリマー | 7 | 11 | 15,918 |
| 東リ | 14 | 20 | 5,643 |

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 |
| ニフコ | 14 | 23 | 79,580 |
| バルカー | 3 | 5 | 17,172 |
| ユニ・チャーム | 83 | 133 | 673,352 |
| 医薬品(5.4%) | | | |
| 協和キリン | 50 | 77 | 227,199 |
| 武田薬品工業 | 338 | 565 | 2,409,873 |
| アステラス製薬 | 373 | 612 | 1,154,420 |
| 住友ファーマ | 26 | 47 | 41,143 |
| 塩野義製薬 | 54 | 81 | 503,272 |
| わかもと製薬 | 5 | 5 | 1,215 |
| 日本新薬 | 11 | 15 | 95,281 |
| 中外製薬 | 134 | 199 | 713,643 |
| 科研製薬 | 6 | 10 | 39,676 |
| エーザイ | 51 | 77 | 606,914 |
| ロート製薬 | 22 | 61 | 159,825 |
| 小野薬品工業 | 98 | 123 | 351,243 |
| 久光製薬 | 11 | 14 | 55,593 |
| 持田製薬 | 5 | 7 | 26,334 |
| 参天製薬 | 80 | 120 | 120,921 |
| 扶桑薬品工業 | 1 | 2 | 4,885 |
| ツムラ | 13 | 20 | 52,863 |
| 日医工 | 13 | - | - |
| キッセイ薬品工業 | 7 | 9 | 24,938 |
| 生化学工業 | 7 | 12 | 9,967 |
| 栄研化学 | 7 | 10 | 16,286 |
| 日水製薬 | 2 | - | - |
| 鳥居薬品 | 2 | 3 | 11,067 |
| JCRファーマ | 12 | 21 | 33,631 |
| 東和薬品 | 6 | 9 | 18,698 |
| 富士製薬工業 | 2 | 4 | 5,068 |
| ゼリア新薬工業 | 7 | 8 | 19,553 |
| 第一三共 | 338 | 556 | 2,379,722 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 8 | 13 | 23,322 |
| 大幸薬品 | 6 | 12 | 5,397 |
| ダイト | 2 | 4 | 11,697 |
| 大塚ホールディングス | 89 | 146 | 608,776 |
| 大正製薬ホールディングス | 10 | 14 | 77,106 |
| ペプチドリーム | 22 | 31 | 58,125 |
| あすか製薬ホールディングス | 4 | 6 | 7,807 |
| サワイグループホールディングス | 9 | 14 | 55,334 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 石油・石炭製品(0.5%) | | | |
| 日本コークス工業 | 36 | 57 | 5,086 |
| ニチレキ | 5 | 7 | 10,395 |
| ユシロ化学工業 | 2 | 6 | 5,133 |
| 富士石油 | 11 | 18 | 4,712 |
| MORESCO | 2 | 0.800 | 974 |
| 出光興産 | 47 | 70 | 218,017 |
| ENEOSホールディングス | 647 | 1,154 | 533,840 |
| コスモエネルギーホールディングス | 12 | 25 | 98,923 |
| ゴム製品(0.8%) | | | |
| 横浜ゴム | 24 | 36 | 88,608 |
| TOYO TIRE | 22 | 36 | 58,683 |
| ブリヂストン | 124 | 204 | 1,065,288 |
| 住友ゴム工業 | 38 | 62 | 76,998 |
| 藤倉コンポジット | 3 | 2 | 2,545 |
| オカモト | 2 | 3 | 14,076 |
| フコク | 1 | 4 | 4,825 |
| ニッタ | 4 | 6 | 19,038 |
| 住友理工 | 8 | 12 | 8,804 |
| 三ツ星ベルト | 5 | 9 | 35,991 |
| バンドー化学 | 6 | 10 | 10,251 |
| ガラス・土石製品(0.7%) | | | |
| 日東紡績 | 6 | 7 | 16,028 |
| AGC | 39 | 65 | 323,700 |
| 日本板硝子 | 20 | 32 | 22,689 |
| 日本山村硝子 | 3 | - | - |
| 日本電気硝子 | 17 | 26 | 64,962 |
| オハラ | - | 4 | 5,616 |
| 住友大阪セメント | 8 | 9 | 34,470 |
| 太平洋セメント | 24 | 40 | 100,122 |
| 日本ヒューム | 4 | 7 | 4,980 |
| 日本コンクリート工業 | 10 | 21 | 5,080 |
| 三谷セキサン | 2 | 2 | 11,866 |
| アジアパイルホールディングス | 6 | 10 | 6,350 |
| 東海カーボン | 36 | 53 | 69,572 |
| 日本カーボン | 2 | 3 | 15,392 |
| 東洋炭素 | 2 | 4 | 17,080 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 2 | 3 | 14,304 |
| TOTO | 30 | 42 | 192,397 |
| 日本碍子 | 46 | 75 | 135,626 |

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 |
| 日本特殊陶業 | 32 | 48 | 132,969 |
| MARUWA | 1 | 2 | 41,664 |
| 品川リフラクトリーズ | 1 | 1 | 7,740 |
| 黒崎播磨 | 0.700 | 1 | 8,567 |
| ヨータイ | 2 | 4 | 6,428 |
| イソライト工業 | 2 | - | - |
| ニッカトー | 4 | 5 | 2,984 |
| フジミンコーポレートッド | 3 | 5 | 32,436 |
| クニミネ工業 | 2 | 0.900 | 792 |
| ニチアス | 10 | 16 | 41,682 |
| ニチハ | 6 | 8 | 21,184 |
| 鉄鋼(0.9%) | | | |
| 日本製鉄 | 190 | 294 | 911,137 |
| 神戸製鋼所 | 79 | 132 | 117,658 |
| 中山製鋼所 | 7 | 13 | 14,431 |
| 合同製鐵 | 2 | 3 | 11,269 |
| JFEホールディングス | 115 | 175 | 306,422 |
| 東京製鐵 | 14 | 18 | 27,639 |
| 共英製鋼 | 4 | 7 | 11,625 |
| 大和工業 | 8 | 10 | 56,916 |
| 東京鐵鋼 | 2 | 3 | 6,099 |
| 大阪製鐵 | - | 4 | 5,565 |
| 淀川製鋼所 | 5 | 7 | 19,792 |
| 丸一鋼管 | 15 | 20 | 56,460 |
| モリ工業 | 1 | - | - |
| 大同特殊鋼 | 7 | 8 | 44,073 |
| 日本高周波鋼業 | 9 | 15 | 5,213 |
| 日本冶金工業 | 3 | 4 | 21,528 |
| 山陽特殊製鋼 | 4 | 6 | 17,277 |
| 愛知製鋼 | 2 | 3 | 8,816 |
| 日立金属 | 45 | - | - |
| 大太平洋金属 | 2 | 4 | 9,338 |
| 新日本電工 | 27 | 42 | 15,708 |
| 栗本鐵工所 | 1 | 3 | 6,460 |
| 三菱製鋼 | 2 | 4 | 6,027 |
| 日亜鋼業 | 11 | 18 | 5,069 |
| 日本精線 | 0.700 | 1 | 5,098 |
| エンビプロ・ホールディングス | 1 | 0.300 | 216 |
| シンニッタン | 13 | 14 | 3,833 |
| 非鉄金属(0.7%) | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 6 | 9 | 13,310 |
| 日本軽金属ホールディングス | 10 | 17 | 25,629 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三井金属鉱業 | 11 | 19 | 64,992 |
| 東邦亜鉛 | 2 | 3 | 8,127 |
| 三菱マテリアル | 28 | 43 | 94,033 |
| 住友金属鉱山 | 54 | 76 | 396,468 |
| DOWAホールディングス | 11 | 14 | 66,822 |
| 古河機械金属 | 7 | 9 | 13,228 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 4 | 9 | 29,730 |
| 東邦チタニウム | 7 | 11 | 25,335 |
| UACJ | 6 | 9 | 23,324 |
| CKサンエツ | 0.900 | 1 | 6,744 |
| 古河電気工業 | 13 | 21 | 53,151 |
| 住友電気工業 | 159 | 226 | 378,809 |
| フジクラ | 47 | 70 | 68,103 |
| 昭和電線ホールディングス | 3 | 7 | 14,082 |
| 東京特殊電線 | 1 | - | - |
| タツタ電線 | 7 | 13 | 9,527 |
| 平河ヒューテック | 2 | 4 | 5,903 |
| リョービ | 5 | 7 | 10,157 |
| アーレスティ | 5 | 7 | 4,282 |
| アサヒホールディングス | 17 | 26 | 52,455 |
| 金属製品(0.6%) | | | |
| 稲葉製作所 | 2 | 3 | 5,342 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 1 | 1 | 6,624 |
| トーカロ | 11 | 18 | 22,425 |
| アルファ | 2 | 4 | 4,638 |
| SUMCO | 65 | 125 | 234,312 |
| 川田テクノロジーズ | 0.900 | 1 | 5,280 |
| RS Technologies | 1 | 4 | 15,265 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 27 | 43 | 75,603 |
| ホッカンホールディングス | 2 | 3 | 4,707 |
| コロナ | 3 | 5 | 4,941 |
| 横河ブリッジホールディングス | 7 | 8 | 17,652 |
| 三和ホールディングス | 40 | 60 | 85,789 |
| 文化シャッター | 13 | 18 | 21,640 |
| 三協立山 | 5 | 9 | 5,961 |
| アルインコ | 3 | 5 | 5,325 |
| LIXIL | 67 | 95 | 204,606 |
| 日本ファイルコン | 5 | 9 | 4,449 |
| ノーリツ | 8 | 9 | 15,364 |
| 長府製作所 | 4 | 6 | 13,866 |
| リンナイ | 8 | 11 | 115,311 |
| ダイニチ工業 | 3 | 7 | 4,874 |

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 |
| 日東精工 | 5 | 9 | 4,966 |
| 三洋工業 | 1 | 2 | 5,373 |
| 岡部 | 8 | 10 | 7,610 |
| ジーテクト | 5 | 7 | 10,212 |
| 東プレ | 7 | 11 | 13,827 |
| 高周波熱錬 | 7 | 10 | 7,179 |
| 東京製綱 | 3 | 5 | 6,916 |
| サンコール | 5 | 2 | 1,550 |
| モリテックスチール | 8 | 7 | 2,383 |
| パイオラックス | 6 | 9 | 17,553 |
| エイチワン | 4 | 7 | 4,921 |
| 日本発条 | 39 | 58 | 52,173 |
| 中央発條 | - | 4 | 3,177 |
| 三益半導体工業 | 3 | 5 | 14,826 |
| 機械(5.3%) | | | |
| 日本製鋼所 | 12 | 17 | 46,462 |
| 三浦工業 | 18 | 26 | 89,846 |
| タクマ | 14 | 19 | 27,403 |
| ツガミ | 9 | 14 | 20,992 |
| オークマ | 5 | 6 | 34,060 |
| 芝浦機械 | 4 | 6 | 18,553 |
| アマダ | 67 | 102 | 123,017 |
| アイダエンジニアリング | 11 | 13 | 10,428 |
| TAKISAWA | 2 | 4 | 4,468 |
| FUJI | 19 | 28 | 57,540 |
| 牧野フライス製作所 | 4 | 7 | 34,344 |
| オーエスジー | 19 | 30 | 59,189 |
| ダイジェット工業 | 3 | 5 | 4,399 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 11 | 18 | 13,770 |
| DMG森精機 | 25 | 39 | 84,006 |
| ソディック | 9 | 17 | 13,098 |
| ディスコ | 6 | 10 | 412,000 |
| 日東工器 | 2 | 3 | 5,456 |
| 日進工具 | 3 | 5 | 5,772 |
| パンチ工業 | - | 10 | 4,693 |
| 豊和工業 | 3 | - | - |
| 東洋機械金属 | 5 | 7 | 4,060 |
| エンシュウ | 5 | 5 | 3,981 |
| 島精機製作所 | 6 | 10 | 18,880 |
| オプトラン | 5 | 9 | 19,950 |
| NCホールディングス | 0.500 | 2 | 4,237 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| イワキ | 2 | 4 | 5,508 |
| フリーュー | 3 | 6 | 8,147 |
| ヤマシンフィルタ | 8 | 15 | 6,196 |
| 日阪製作所 | 5 | 6 | 5,759 |
| やまびこ | 8 | 10 | 13,387 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 1 | 2 | 9,625 |
| 平田機工 | 2 | 3 | 20,057 |
| ペガサスミシン製造 | 5 | 7 | 4,771 |
| マルマエ | 1 | 3 | 6,446 |
| タツモ | 2 | 3 | 6,026 |
| ナプテスコ | 24 | 40 | 142,410 |
| 三井海洋開発 | 4 | 8 | 12,376 |
| レオン自動機 | 4 | 6 | 8,241 |
| S MC | 12 | 20 | 1,399,046 |
| ホソカワミクロン | 3 | 4 | 12,887 |
| ユニオンツール | 1 | 2 | 9,058 |
| オイレス工業 | 6 | 9 | 14,625 |
| 日精工エー・エス・ビー機械 | 1 | 3 | 13,020 |
| サトーホールディングス | 5 | 9 | 21,011 |
| 技研製作所 | 3 | 6 | 18,773 |
| 日本エアータック | - | 4 | 4,489 |
| カワタ | 3 | 4 | 4,174 |
| 日精樹脂工業 | 3 | 5 | 5,151 |
| オカダアイオン | 1 | - | - |
| ワイエイシイホールディングス | 2 | - | - |
| 小松製作所 | 195 | 301 | 996,729 |
| 住友重機械工業 | 24 | 38 | 112,242 |
| 日立建機 | 17 | 25 | 79,744 |
| 日工 | 5 | 9 | 5,956 |
| 巴工業 | 1 | 2 | 6,795 |
| 井関農機 | 4 | 6 | 7,092 |
| TOWA | 3 | 6 | 12,084 |
| 丸山製作所 | 1 | - | - |
| 北川鉄工所 | 2 | 4 | 4,636 |
| ローツェ | 2 | 3 | 34,918 |
| タカキタ | 4 | 9 | 4,262 |
| クボタ | 210 | 340 | 710,074 |
| 荏原実業 | 2 | 3 | 9,064 |
| 三菱化工機 | 1 | 2 | 5,330 |
| 月島機械 | 7 | 8 | 9,709 |
| 帝国電機製作所 | 3 | 4 | 12,191 |

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 |
| 新東工業 | 9 | 13 | 9,802 |
| 澁谷工業 | 3 | 6 | 14,448 |
| アイチコーポレーション | 6 | 9 | 7,070 |
| 小森コーポレーション | 10 | 14 | 12,977 |
| 鶴見製作所 | 3 | 4 | 9,716 |
| 荏原製作所 | 17 | 26 | 147,576 |
| 石井鐵工所 | 1 | 1 | 3,942 |
| 西島製作所 | 3 | 5 | 8,442 |
| 北越工業 | 4 | 6 | 9,002 |
| ダイキン工業 | 54 | 76 | 1,793,280 |
| オルガノ | 1 | 8 | 29,744 |
| トーヨーカネツ | 1 | 2 | 6,331 |
| 栗田工業 | 23 | 36 | 217,080 |
| 椿本チエイン | 5 | 9 | 28,164 |
| 大同工業 | 3 | 3 | 2,928 |
| 木村化工機 | 3 | 6 | 4,998 |
| アネスト岩田 | 6 | 10 | 9,929 |
| ダイフク | 23 | 33 | 240,368 |
| サムコ | 1 | 2 | 7,318 |
| 加藤製作所 | 3 | 6 | 5,244 |
| タダノ | 22 | 33 | 34,001 |
| フジテック | 16 | 23 | 75,552 |
| CKD | 12 | 17 | 35,795 |
| キトー | 3 | - | - |
| 平和 | 12 | 21 | 52,943 |
| 理想科学工業 | 3 | 5 | 13,577 |
| SANKYO | 9 | 12 | 70,739 |
| 日本金銭機械 | 4 | 7 | 8,889 |
| マースグループホールディングス | 2 | 3 | 9,427 |
| フクシマガリレイ | 2 | 4 | 20,496 |
| ダイコク電機 | 2 | 3 | 9,366 |
| 竹内製作所 | 6 | 11 | 34,702 |
| アマノ | 11 | 18 | 45,603 |
| JUKI | 6 | 10 | 6,340 |
| ジャノメ | 4 | 8 | 5,210 |
| マックス | 5 | 7 | 16,929 |
| グローリー | 11 | 16 | 44,605 |
| 新晃工業 | 4 | 6 | 10,094 |
| 大和冷機工業 | 6 | 9 | 12,206 |
| セガサミーホールディングス | 42 | 51 | 121,391 |
| 日本ピストンリング | 2 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| リケン | 1 | 2 | 6,477 |
| T P R | 5 | 7 | 10,275 |
| ツバキ・ナカシマ | 9 | 15 | 17,283 |
| ホシザキ | 12 | 41 | 195,050 |
| 大豊工業 | 3 | 7 | 5,111 |
| 日本精工 | 81 | 118 | 88,177 |
| NTN | 92 | 126 | 42,858 |
| ジェイテクト | 41 | 57 | 58,229 |
| 不二越 | 3 | 4 | 18,142 |
| 日本トムソン | 11 | 15 | 9,385 |
| THK | 24 | 37 | 106,402 |
| ユースイン精機 | 4 | 7 | 5,321 |
| 前澤給装工業 | 3 | 5 | 5,038 |
| イーグル工業 | 5 | 7 | 8,328 |
| 日本ピラー工業 | 4 | 6 | 20,040 |
| キッツ | 14 | 23 | 20,310 |
| マキタ | 52 | 80 | 278,400 |
| 三井E&Sホールディングス | 15 | 29 | 12,468 |
| 日立造船 | 36 | 52 | 47,219 |
| 三菱重工業 | 67 | 112 | 567,675 |
| IHI | 26 | 40 | 147,378 |
| スター精密 | 6 | 12 | 19,831 |
| 電気機器(17.3%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 26 | 52 | 51,876 |
| イビデン | 22 | 36 | 165,681 |
| コニカミノルタ | 94 | 143 | 86,507 |
| ブラザー工業 | 52 | 85 | 172,744 |
| ミネベアミツミ | 74 | 111 | 266,433 |
| 日立製作所 | 207 | 322 | 2,276,445 |
| 東芝 | 75 | 123 | 536,920 |
| 三菱電機 | 430 | 664 | 1,030,107 |
| 富士電機 | 25 | 39 | 204,493 |
| 東洋電機製造 | 2 | 5 | 4,690 |
| 安川電機 | 46 | 76 | 392,430 |
| シンフォニアテクノロジー | 5 | 7 | 11,594 |
| 明電舎 | 7 | 9 | 18,757 |
| オリジン | 2 | 1 | 2,036 |
| 山洋電気 | 1 | 2 | 15,792 |
| デンヨー | 3 | 4 | 7,756 |
| PHCホールディングス | 4 | 8 | 12,629 |
| ソシオネクスト | - | 6 | 54,714 |

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 |
| 東芝テック | 4 | 9 | 37,056 |
| 芝浦メカトロニクス | 0.800 | 1 | 15,996 |
| マブチモーター | 10 | 16 | 60,000 |
| 日本電産 | 111 | 156 | 1,082,778 |
| トレックス・セミコンダクター | 2 | 3 | 7,560 |
| 東光高岳 | 2 | 3 | 7,901 |
| ダブル・スコープ | 12 | 21 | 27,720 |
| ダイヘン | 4 | 5 | 24,621 |
| ヤーマン | 7 | 12 | 18,150 |
| JVCケンウッド | 35 | 58 | 22,561 |
| ミマキエンジニアリング | 3 | - | - |
| I-P E X | 2 | 4 | 4,981 |
| 日新電機 | 10 | 15 | 26,118 |
| 大崎電気工業 | 7 | 15 | 8,047 |
| オムロン | 35 | 58 | 426,377 |
| 日東工業 | 5 | 8 | 23,037 |
| I D E C | 5 | 9 | 31,112 |
| 不二電機工業 | 2 | 4 | 4,575 |
| ジーエス・ユア コーポレーション | 14 | 21 | 52,306 |
| サクサホールディングス | 2 | 3 | 5,787 |
| メルコホールディングス | 1 | 1 | 5,712 |
| テクノメディカ | - | 2 | 4,990 |
| 日本電気 | 54 | 91 | 434,980 |
| 富士通 | 38 | 64 | 1,122,391 |
| 沖電気工業 | 17 | 29 | 20,922 |
| 岩崎通信機 | 3 | 6 | 4,704 |
| 電気興業 | 2 | 2 | 5,631 |
| サンケン電気 | 4 | 6 | 52,980 |
| アイホン | 2 | 3 | 7,620 |
| ルネサスエレクトロニクス | 233 | 419 | 717,896 |
| セイコーエプソン | 53 | 85 | 160,516 |
| ワコム | 33 | 50 | 33,644 |
| アルバック | 7 | 15 | 80,631 |
| E I Z O | 3 | 4 | 17,390 |
| ジャパンディスプレイ | 147 | 247 | 10,374 |
| 日本信号 | 11 | 14 | 15,169 |
| 京三製作所 | 9 | 13 | 5,521 |
| 能美防災 | 5 | 8 | 14,407 |
| ホーチキ | 3 | 4 | 6,993 |
| 星和電機 | - | 10 | 4,742 |
| エレコム | 9 | 15 | 20,097 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| パナソニック ホールディングス | 459 | 759 | 896,943 |
| シャープ | 49 | 77 | 75,717 |
| アンリツ | 27 | 45 | 56,942 |
| 富士通ゼネラル | 11 | 18 | 68,432 |
| ソニーグループ | 269 | 450 | 5,153,720 |
| T D K | 62 | 101 | 463,190 |
| 帝国通信工業 | - | 3 | 5,075 |
| タムラ製作所 | 16 | 27 | 20,810 |
| アルプスアルパイン | 38 | 57 | 81,795 |
| 池上通信機 | 4 | 8 | 4,864 |
| 日本電波工業 | 3 | 7 | 10,949 |
| メイコー | 3 | 7 | 19,264 |
| 日本トリム | 0.900 | - | - |
| ローランド ディー. ジー. | 2 | 3 | 11,214 |
| フォスター電機 | 4 | 6 | 5,682 |
| S M K | 1 | 2 | 5,250 |
| ヨコオ | 3 | 5 | 10,210 |
| ホシデン | 10 | 15 | 24,701 |
| ヒロセ電機 | 6 | 10 | 181,365 |
| 日本航空電子工業 | 9 | 13 | 29,937 |
| T O A | 4 | 7 | 5,853 |
| マクセル | 8 | 14 | 20,496 |
| 古野電気 | 5 | 8 | 7,929 |
| ユニデンホールディングス | 0.900 | - | - |
| スミダコーポレーション | 4 | 5 | 9,681 |
| アイコム | 1 | 2 | 6,427 |
| リオン | 1 | 2 | 5,003 |
| 横河電機 | 43 | 70 | 145,798 |
| 新電元工業 | 1 | 2 | 8,700 |
| アズビル | 25 | 44 | 160,645 |
| 東亜ディーケーケー | 3 | 5 | 4,244 |
| 日本光電工業 | 17 | 29 | 99,225 |
| 共和電業 | 7 | 11 | 3,988 |
| 日本電子材料 | 2 | 4 | 6,363 |
| 堀場製作所 | 8 | 14 | 99,400 |
| アドバンテスト | 32 | 50 | 505,514 |
| 小野測器 | 6 | 11 | 4,621 |
| エスベック | 3 | 5 | 10,347 |
| キーエンス | 39 | 63 | 3,710,525 |
| 日置電機 | 2 | 3 | 26,169 |
| シスメックス | 36 | 54 | 455,779 |

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 |
| 日本マイクロニクス | 7 | 10 | 13,639 |
| メガチップス | 4 | 5 | 14,747 |
| OBARA GROUP | 2 | 3 | 11,520 |
| 澤藤電機 | 1 | 3 | 3,765 |
| 原田工業 | 3 | 5 | 4,763 |
| コーセル | 5 | 8 | 9,222 |
| イリソ電子工業 | 3 | 5 | 27,641 |
| オプテックスグループ | 7 | 11 | 24,183 |
| 千代田インテグレ | 1 | 2 | 4,785 |
| アイ・オー・データ機器 | 3 | - | - |
| レーザーテック | 18 | 31 | 708,227 |
| スタンレー電気 | 30 | 45 | 128,380 |
| 岩崎電気 | 1 | 2 | 9,334 |
| ウシオ電機 | 22 | 33 | 53,046 |
| 岡谷電機産業 | 9 | 0.100 | 29 |
| 日本セラミック | 4 | 6 | 17,524 |
| 遠藤照明 | 2 | 6 | 5,134 |
| 古河電池 | 3 | 4 | 5,395 |
| 山一電機 | 3 | 5 | 10,040 |
| 図研 | 2 | 5 | 19,085 |
| 日本電子 | 9 | 16 | 64,240 |
| カシオ計算機 | 31 | 47 | 64,084 |
| ファナック | 37 | 62 | 1,418,750 |
| 日本シイエムケイ | 8 | 13 | 6,709 |
| エンプラス | 1 | 1 | 7,514 |
| 大真空 | 5 | 7 | 5,826 |
| ローム | 19 | 29 | 308,700 |
| 浜松ホトニクス | 30 | 51 | 340,326 |
| 三井ハイテック | 4 | 6 | 45,936 |
| 新光電気工業 | 12 | 22 | 85,500 |
| 京セラ | 60 | 98 | 661,542 |
| 太陽誘電 | 20 | 31 | 129,735 |
| 村田製作所 | 126 | 193 | 1,429,519 |
| 双葉電子工業 | 7 | 12 | 6,630 |
| 北陸電気工業 | 0.100 | 3 | 5,358 |
| ニチコン | 13 | 13 | 17,082 |
| 日本ケミコン | 4 | 6 | 13,324 |
| KOA | 6 | 9 | 17,817 |
| 市光工業 | 5 | - | - |
| 小糸製作所 | 23 | 76 | 175,184 |
| ミツバ | 8 | 11 | 6,033 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| SCREENホールディングス | 7 | 10 | 112,597 |
| キャノン電子 | 3 | 7 | 12,166 |
| キャノン | 213 | 349 | 1,034,398 |
| リコー | 119 | 159 | 170,240 |
| 象印マホービン | 11 | 19 | 31,065 |
| MUTOHホールディングス | 1 | 2 | 4,017 |
| 東京エレクトロン | 27 | 44 | 2,042,052 |
| イノテック | 2 | 4 | 5,590 |
| 輸送用機器(7.5%) | | | |
| トヨタ紡織 | 17 | 26 | 56,012 |
| 芦森工業 | 3 | 4 | 5,940 |
| ユニプレス | 6 | 11 | 8,675 |
| 豊田自動織機 | 34 | 46 | 360,218 |
| モリタホールディングス | 6 | 11 | 13,328 |
| 三櫻工業 | 6 | 9 | 6,586 |
| デンソー | 94 | 131 | 970,520 |
| 東海理化電機製作所 | 11 | 18 | 27,594 |
| 川崎重工業 | 31 | 48 | 145,200 |
| 名村造船所 | - | 16 | 6,275 |
| 日本車輛製造 | 1 | 2 | 4,880 |
| 三菱ロジスネクスト | 5 | 10 | 8,547 |
| 近畿車輛 | 3 | - | - |
| 日産自動車 | 507 | 904 | 474,243 |
| いすゞ自動車 | 135 | 185 | 303,913 |
| トヨタ自動車 | 2,180 | 3,497 | 6,653,042 |
| 日野自動車 | 53 | 82 | 46,961 |
| 三菱自動車工業 | 159 | 248 | 132,148 |
| エフテック | 5 | 1 | 861 |
| 武蔵精密工業 | 9 | 15 | 28,314 |
| 日産車体 | 6 | 11 | 9,889 |
| 新明和工業 | 12 | 20 | 21,900 |
| 極東開発工業 | 8 | 11 | 16,273 |
| トピー工業 | 3 | 5 | 9,682 |
| ティラド | 1 | 1 | 4,227 |
| 曙ブレーキ工業 | 23 | 38 | 5,718 |
| タチエス | 7 | 10 | 12,635 |
| NOK | 20 | 24 | 31,665 |
| フタバ産業 | 10 | 17 | 7,011 |
| KYB | 4 | 6 | 22,173 |
| 大同メタル工業 | 8 | 12 | 6,299 |
| プレス工業 | 21 | 28 | 12,978 |

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 |
| ミクニ | 9 | 13 | 4,732 |
| 太平洋工業 | 9 | 14 | 16,571 |
| 河西工業 | 10 | - | - |
| アイシン | 31 | 49 | 184,616 |
| マツダ | 135 | 210 | 246,519 |
| 今仙電機製作所 | 5 | 2 | 1,930 |
| 本田技研工業 | 338 | 517 | 1,791,242 |
| スズキ | 98 | 117 | 558,909 |
| S U B A R U | 123 | 201 | 442,897 |
| ヤマハ発動機 | 56 | 100 | 337,837 |
| エクセディ | 6 | 10 | 18,720 |
| 豊田合成 | 13 | 18 | 40,306 |
| 愛三工業 | 6 | 10 | 9,124 |
| 盟和産業 | - | 4 | 4,598 |
| ヨロズ | 4 | 7 | 5,421 |
| エフ・シー・シー | 7 | 11 | 16,622 |
| シマノ | 17 | 26 | 571,590 |
| テイ・エス テック | 18 | 29 | 50,574 |
| ジャムコ | 3 | 3 | 6,279 |
| 精密機器(2.5%) | | | |
| テルモ | 121 | 199 | 737,295 |
| 日機装 | 12 | 15 | 15,009 |
| 日本エム・ディ・エム | 2 | 5 | 5,916 |
| 島津製作所 | 55 | 77 | 299,148 |
| JMS | 5 | 9 | 5,005 |
| 長野計器 | 3 | 4 | 5,552 |
| ブイ・テクノロジー | 1 | 3 | 7,808 |
| 東京計器 | 3 | 4 | 6,355 |
| 愛知時計電機 | 1 | 3 | 5,223 |
| インターアクション | 2 | 3 | 5,791 |
| オーバル | 12 | 6 | 3,182 |
| 東京精密 | 7 | 14 | 66,990 |
| マニー | 17 | 28 | 52,136 |
| ニコン | 65 | 99 | 128,106 |
| トプコン | 20 | 33 | 56,883 |
| オリンパス | 225 | 398 | 913,639 |
| 理研計器 | 3 | 4 | 19,820 |
| タムロン | 3 | 4 | 15,192 |
| H O Y A | 84 | 136 | 1,823,760 |
| シード | - | 2 | 1,466 |
| ノーリツ鋼機 | 3 | 6 | 12,780 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| A&Dホロンホールディングス | 3 | 9 | 11,690 |
| 朝日インテック | 47 | 84 | 198,139 |
| シチズン時計 | 50 | 70 | 58,450 |
| リズム | 2 | 1 | 1,838 |
| メニコン | 14 | 21 | 64,626 |
| 松風 | 1 | 2 | 6,052 |
| セイコーグループ | 6 | 9 | 28,967 |
| ニプロ | 32 | 53 | 57,666 |
| その他製品(2.3%) | | | |
| K Y O R I T S U | - | 25 | 3,263 |
| スノーピーク | 5 | 10 | 23,838 |
| パラマウントベッドホールディングス | 8 | 14 | 35,338 |
| トランザクシオン | 2 | 4 | 7,394 |
| 粧美堂 | 0.200 | 2 | 829 |
| ニホンフラッシュ | 3 | 6 | 5,616 |
| 前田工業 | 4 | 6 | 23,115 |
| 永大産業 | 10 | 18 | 4,095 |
| アートネイチャー | 4 | 6 | 4,943 |
| パンダイナムコホールディングス | 38 | 58 | 499,065 |
| アイフィスジャパン | 4 | 7 | 4,193 |
| 共立印刷 | 21 | - | - |
| S H O E I | 4 | 6 | 34,505 |
| フランスベッドホールディングス | 5 | 7 | 7,884 |
| パイロットコーポレーション | 7 | 10 | 44,200 |
| 萩原工業 | 2 | 4 | 5,224 |
| フジシールインターナショナル | 10 | 12 | 20,846 |
| タカラトミー | 18 | 29 | 38,249 |
| 広済堂ホールディングス | 3 | 4 | 10,156 |
| プロネクサス | 3 | 5 | 5,236 |
| 大建工業 | 2 | 3 | 8,295 |
| 凸版印刷 | 65 | 83 | 200,086 |
| 大日本印刷 | 50 | 75 | 275,184 |
| 共同印刷 | 1 | 1 | 5,293 |
| N I S S H A | 8 | 12 | 22,276 |
| TAKARA & COMPANY | 2 | 4 | 9,570 |
| アシックス | 38 | 58 | 192,276 |
| ツツミ | 1 | 2 | 4,967 |
| ローランド | 3 | 4 | 18,306 |
| 小松ウオール工業 | 1 | 2 | 5,189 |
| ヤマハ | 25 | 40 | 198,695 |
| 河合楽器製作所 | 1 | 1 | 5,067 |

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 |
| ビジョン | 26 | 40 | 89,320 |
| 兼松サステック | — | 0.400 | 898 |
| キングジム | 3 | 5 | 4,961 |
| リンテック | 9 | 12 | 28,108 |
| イトーキ | 7 | 13 | 9,759 |
| 任天堂 | 24 | 402 | 2,197,074 |
| 三菱鉛筆 | 7 | 9 | 13,320 |
| タカラスタANDARD | 8 | 12 | 17,269 |
| コクヨ | 20 | 30 | 56,764 |
| ナカバヤシ | 5 | 9 | 4,761 |
| グローブライド | 3 | 5 | 13,305 |
| オカムラ | 14 | 19 | 25,881 |
| 美津濃 | 4 | 6 | 19,089 |
| 電気・ガス業(1.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 322 | 574 | 275,568 |
| 中部電力 | 131 | 234 | 340,315 |
| 関西電力 | 163 | 245 | 325,325 |
| 中国電力 | 67 | 101 | 71,385 |
| 北陸電力 | 39 | 60 | 34,317 |
| 東北電力 | 100 | 155 | 106,343 |
| 四国電力 | 38 | 54 | 40,908 |
| 九州電力 | 88 | 146 | 110,687 |
| 北海道電力 | 37 | 61 | 29,827 |
| 沖縄電力 | 9 | 14 | 15,943 |
| 電源開発 | 36 | 48 | 103,392 |
| エフオン | 2 | 4 | 2,486 |
| イーレックス | 6 | 11 | 22,961 |
| レノバ | 8 | 16 | 38,041 |
| 東京瓦斯 | 82 | 134 | 360,862 |
| 大阪瓦斯 | 78 | 129 | 276,963 |
| 東邦瓦斯 | 19 | 25 | 63,001 |
| 北海道瓦斯 | 2 | 3 | 6,870 |
| 広島ガス | 8 | 14 | 4,844 |
| 西部ガスホールディングス | 4 | 6 | 10,638 |
| 静岡ガス | 11 | 14 | 16,269 |
| メタウォーター | 4 | 8 | 13,160 |
| 陸運業(2.9%) | | | |
| SBSホールディングス | 3 | 5 | 18,439 |
| 東武鉄道 | 42 | 70 | 210,350 |
| 相鉄ホールディングス | 13 | 21 | 48,153 |
| 東急 | 108 | 178 | 291,296 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 京浜急行電鉄 | 55 | 72 | 91,838 |
| 小田急電鉄 | 64 | 96 | 158,163 |
| 京王電鉄 | 22 | 33 | 158,390 |
| 京成電鉄 | 30 | 41 | 159,057 |
| 富士急行 | 5 | 7 | 32,643 |
| 新京成電鉄 | 1 | — | — |
| 東日本旅客鉄道 | 75 | 108 | 745,740 |
| 西日本旅客鉄道 | 52 | 81 | 429,792 |
| 東海旅客鉄道 | 35 | 49 | 751,230 |
| 西武ホールディングス | 56 | 77 | 108,724 |
| 鴻池運輸 | 6 | 10 | 16,055 |
| 西日本鉄道 | 11 | 17 | 40,936 |
| ハマキョウレックス | 3 | 5 | 15,750 |
| サカイ引越センター | 2 | 3 | 13,200 |
| 近鉄グループホールディングス | 40 | 63 | 261,714 |
| 阪急阪神ホールディングス | 51 | 84 | 325,632 |
| 南海電気鉄道 | 18 | 30 | 83,691 |
| 京阪ホールディングス | 18 | 26 | 89,420 |
| 神戸電鉄 | 1 | 1 | 5,397 |
| 名古屋鉄道 | 33 | 70 | 146,013 |
| 山陽電気鉄道 | 3 | 4 | 10,502 |
| アルプス物流 | 2 | 5 | 6,543 |
| ヤマトホールディングス | 57 | 81 | 189,743 |
| 山九 | 10 | 16 | 78,408 |
| 丸全昭和運輸 | 3 | 3 | 11,817 |
| センコーグループホールディングス | 20 | 33 | 32,891 |
| トナミホールディングス | 1 | 1 | 5,376 |
| ニッコンホールディングス | 13 | 20 | 50,388 |
| 日本石油輸送 | 0.500 | 1 | 2,804 |
| 福山通運 | 6 | 4 | 16,128 |
| セイノーホールディングス | 27 | 39 | 54,806 |
| 神奈川中央交通 | 1 | 1 | 5,886 |
| 日立物流 | 7 | — | — |
| AZ-COM丸和ホールディングス | 8 | 15 | 28,182 |
| C&Fロジホールディングス | 4 | 6 | 7,350 |
| 九州旅客鉄道 | 31 | 45 | 132,705 |
| S Gホールディングス | 77 | 122 | 255,590 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 14 | 23 | 181,542 |
| 海運業(0.6%) | | | |
| 日本郵船 | 34 | 170 | 566,262 |
| 商船三井 | 22 | 112 | 383,382 |

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 |
| 川崎汽船 | 12 | 54 | 176,150 |
| N S ユナイテッド海運 | 2 | 3 | 14,577 |
| 明治海運 | 4 | 6 | 4,042 |
| 飯野海運 | 18 | 23 | 23,346 |
| 共栄タンカー | - | 0,600 | 574 |
| 乾汽船 | 2 | 8 | 16,507 |
| 空運業(0.5%) | | | |
| 日本航空 | 93 | 156 | 406,276 |
| ANAホールディングス | 103 | 173 | 486,649 |
| パスコ | 0.700 | 1 | 1,694 |
| 倉庫・運輸関連業(0.1%) | | | |
| トランコム | 1 | 1 | 12,474 |
| 日新 | 3 | 4 | 9,744 |
| 三菱倉庫 | 13 | 13 | 42,675 |
| 三井倉庫ホールディングス | 4 | 5 | 23,777 |
| 住友倉庫 | 14 | 17 | 36,872 |
| 澁澤倉庫 | 2 | 2 | 5,415 |
| 東陽倉庫 | 9 | 15 | 4,258 |
| 日本トランスシティ | 9 | 12 | 7,257 |
| 中央倉庫 | 3 | 5 | 5,028 |
| 安田倉庫 | 3 | 5 | 4,914 |
| 東洋埠頭 | 2 | - | - |
| 上組 | 22 | 30 | 82,197 |
| キューソー流通システム | - | 4 | 4,006 |
| 近鉄エクスプレス | 7 | - | - |
| 東海運 | 9 | 13 | 3,830 |
| エーアイティ | 2 | 4 | 6,312 |
| 内外トランスライン | 1 | 2 | 4,979 |
| 日本コンセプト | 1 | 3 | 4,579 |
| 情報・通信業(8.7%) | | | |
| N E C ネットズ エスアイ | 14 | 21 | 34,697 |
| クロスキャット | - | 3 | 4,582 |
| システナ | 60 | 107 | 37,053 |
| デジタルアーツ | 2 | 4 | 21,720 |
| 日鉄ソリューションズ | 6 | 10 | 36,624 |
| キューブシステム | 0.900 | 4 | 5,249 |
| コア | 1 | 3 | 5,025 |
| 手間いらず | 0.600 | 1 | 5,461 |
| ラクーンホールディングス | 3 | 6 | 7,219 |
| ソリトンシステムズ | - | 4 | 4,862 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 1 | 2 | 9,178 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| T I S | 40 | 71 | 246,633 |
| グリー | 25 | 34 | 25,205 |
| コーエーテックホールディングス | 13 | 40 | 94,800 |
| 三菱総合研究所 | 1 | 3 | 16,058 |
| A G S | 3 | 6 | 4,499 |
| ファインデックス | 3 | 10 | 6,130 |
| ブレインパッド | 3 | 6 | 4,316 |
| K L a b | 7 | 12 | 4,964 |
| ポルトゥウィンホールディングス | 6 | 10 | 9,275 |
| ネクソン | 95 | 165 | 507,164 |
| アイススタイル | 12 | 20 | 9,078 |
| エムアップホールディングス | 4 | 7 | 8,556 |
| エイチーム | 3 | 6 | 5,286 |
| エニグモ | 4 | 8 | 4,965 |
| テクノスジャパン | 5 | - | - |
| コロプラ | 13 | 24 | 14,805 |
| ブロードリーフ | 20 | 37 | 16,374 |
| クロス・マーケティンググループ | - | 5 | 3,578 |
| デジタルハーツホールディングス | 1 | 4 | 6,140 |
| システム情報 | 3 | 5 | 4,582 |
| メディアドゥ | 1 | 2 | 4,267 |
| じげん | 11 | 18 | 7,663 |
| ブイキューブ | 4 | 7 | 4,951 |
| サイバーリンクス | 2 | 3 | 3,293 |
| フィックスターズ | 4 | 7 | 10,022 |
| CARTA HOLDINGS | 1 | 3 | 4,501 |
| オプティム | 2 | 5 | 5,172 |
| セレス | 1 | 5 | 6,315 |
| S H I F T | 2 | 4 | 105,985 |
| ティーガイア | 3 | 6 | 11,055 |
| テクマトリックス | 7 | 11 | 17,678 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 11 | 19 | 45,396 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 8 | 14 | 166,002 |
| ザッパラス | 5 | - | - |
| インターネットイニシアティブ | 11 | 35 | 95,301 |
| さくらインターネット | 5 | 9 | 5,674 |
| ヴァインクス | 3 | - | - |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 0.900 | 1 | 7,533 |
| S R A ホールディングス | 2 | 3 | 9,982 |
| 朝日ネット | 5 | 8 | 5,039 |
| e B A S E | 5 | 9 | 5,958 |

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 |
| アバントグループ | 4 | 8 | 10,959 |
| アドソル日進 | 1 | 3 | 5,398 |
| フリービット | 2 | 4 | 5,561 |
| コムチュア | 4 | 8 | 18,681 |
| サイバーコム | 2 | 0.600 | 850 |
| アステリア | 3 | 6 | 5,071 |
| アイル | 2 | 3 | 6,883 |
| マークラインズ | 2 | 3 | 9,243 |
| メディカル・データ・ビジョン | 5 | 9 | 8,569 |
| gumi | 5 | 10 | 8,964 |
| テラスカイ | 1 | 2 | 5,474 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 2 | 3 | 5,412 |
| P R T I M E S | 1 | 2 | 3,853 |
| ラクス | 14 | 30 | 52,427 |
| ランドコンピュータ | 3 | 5 | 5,500 |
| ダブルスタンダード | 1 | 2 | 5,239 |
| オーブندア | 2 | 4 | 7,231 |
| アカツキ | 1 | 3 | 6,480 |
| Ubicomホールディングス | 1 | 2 | 4,425 |
| カナミックネットワーク | 6 | 9 | 4,830 |
| ノムラシステムコーポレーション | 10 | 39 | 4,446 |
| チェンジ | 7 | 15 | 41,574 |
| シンクロ・フード | 8 | 0.200 | 101 |
| オークネット | 2 | 3 | 5,644 |
| キャピタル・アセット・プランニング | 4 | 7 | 4,582 |
| マクロミル | 8 | 14 | 14,891 |
| ビーグリー | 1 | 3 | 4,389 |
| オロ | 1 | 2 | 4,565 |
| ユーザーローカル | 1 | 3 | 6,425 |
| マネーフォワード | 6 | 15 | 74,536 |
| 電算システムホールディングス | 1 | 3 | 7,771 |
| プロトコーポレーション | 4 | 8 | 9,968 |
| ハイマックス | 2 | - | - |
| 野村総合研究所 | 81 | 131 | 386,712 |
| サイバネットシステム | 4 | 5 | 5,194 |
| C E ホールディングス | 6 | 9 | 5,123 |
| インテージホールディングス | 5 | 8 | 14,616 |
| 東邦システムサイエンス | 2 | - | - |
| ソースネクスト | 18 | 32 | 7,605 |
| インフォコム | 4 | 8 | 19,360 |
| シンプルクス・ホールディングス | 4 | 10 | 25,252 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| HEROZ | 2 | 5 | 5,890 |
| ラクスル | 4 | 18 | 24,372 |
| メルカリ | - | 28 | 73,012 |
| I P S | - | 2 | 5,512 |
| F I G | 8 | 12 | 3,660 |
| イーソル | 4 | 6 | 4,410 |
| アルテリア・ネットワークス | 5 | 6 | 7,728 |
| ウイングアーク1 s t | 2 | 6 | 12,005 |
| サーバーワークス | 0.900 | 2 | 4,876 |
| トビラシステムズ | 3 | 4 | 4,233 |
| Sansan | 15 | 23 | 36,328 |
| ギフトィ | 3 | 6 | 17,705 |
| メドレー | - | 6 | 27,744 |
| ベース | 0.700 | 2 | 10,384 |
| JMDC | 4 | 10 | 44,940 |
| フォーカスシステムズ | 3 | 4 | 4,732 |
| クレスコ | 3 | 4 | 8,540 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 40 | 61 | 68,276 |
| オービック | 13 | 21 | 427,491 |
| ジャストシステム | 6 | 9 | 31,694 |
| TDCソフト | 3 | 5 | 8,148 |
| Zホールディングス | 614 | 909 | 348,147 |
| トレンドマイクロ | 22 | 36 | 239,850 |
| IDホールディングス | 3 | 5 | 5,315 |
| 日本オラクル | 8 | 12 | 114,070 |
| アルファシステムズ | 1 | 2 | 8,470 |
| フューチャー | 8 | 15 | 28,349 |
| CAC Holdings | 2 | 3 | 6,286 |
| S B テクノロジー | 1 | 2 | 5,324 |
| トーセ | 4 | 6 | 4,687 |
| オービックビジネスコンサルタント | 4 | 12 | 60,039 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 19 | 34 | 104,958 |
| アイティフォー | 5 | 8 | 7,266 |
| 東計電算 | 0.600 | 0.900 | 5,346 |
| エックスネット | - | 4 | 4,872 |
| 大塚商会 | 22 | 36 | 165,977 |
| サイボウズ | 5 | 8 | 23,100 |
| 電通国際情報サービス | 6 | 7 | 38,142 |
| A C C E S S | 4 | 7 | 7,524 |
| デジタルガレージ | 7 | 11 | 51,358 |
| イーエムシステムズ | 7 | 10 | 9,211 |

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 |
| ウェザーニューズ | 1 | 2 | 15,594 |
| C I J | 3 | 5 | 5,991 |
| ビジネスエンジニアリング | 0.800 | — | — |
| 日本エンタープライズ | 16 | 30 | 4,181 |
| WOWOW | 2 | 3 | 4,878 |
| スカラ | 4 | 6 | 4,785 |
| ネットワンシステムズ | 16 | 23 | 78,183 |
| アルゴグラフィックス | 3 | 5 | 22,567 |
| マーベラス | 6 | 10 | 7,488 |
| エイベックス | 7 | 10 | 17,581 |
| B I P R O G Y | 13 | 23 | 68,643 |
| 兼松エレクトロニクス | 2 | 4 | 25,338 |
| 都築電気 | 2 | 3 | 5,009 |
| T B Sホールディングス | 25 | 32 | 53,268 |
| 日本テレビホールディングス | 35 | 56 | 61,020 |
| 朝日放送グループホールディングス | 4 | 7 | 5,016 |
| テレビ朝日ホールディングス | 10 | 15 | 21,731 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 35 | 56 | 27,612 |
| テレビ東京ホールディングス | 3 | 4 | 9,788 |
| 日本BS放送 | 2 | 4 | 4,368 |
| ビジョン | 7 | 8 | 13,431 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 4 | 5 | 14,905 |
| コネクシオ | 3 | — | — |
| 日本通信 | 35 | 58 | 14,136 |
| 日本電信電話 | 441 | 818 | 3,250,684 |
| K D D I | 308 | 493 | 1,993,650 |
| ソフトバンク | 639 | 1,026 | 1,572,498 |
| 光通信 | 5 | 7 | 151,725 |
| エムティーアイ | 4 | 9 | 4,794 |
| GMOインターネットグループ | 15 | 23 | 60,980 |
| ファイバーゲート | 2 | — | — |
| アйдママーケティングコミュニケーション | 10 | 16 | 4,706 |
| K A D O K A W A | 23 | 33 | 92,375 |
| 学研ホールディングス | 6 | 10 | 9,147 |
| ゼンリン | 6 | 10 | 9,286 |
| インプレスホールディングス | 13 | 22 | 4,562 |
| アイネット | 2 | 3 | 4,992 |
| 松竹 | 2 | 3 | 40,885 |
| 東宝 | 24 | 40 | 189,200 |
| 東映 | 1 | 1 | 30,798 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 112 | 200 | 377,353 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ピー・シー・エー | 2 | 3 | 4,832 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 1 | 2 | 5,656 |
| D T S | 8 | 13 | 42,092 |
| スクエア・エックス・ホールディングス | 19 | 32 | 200,304 |
| シーイーシー | 4 | 9 | 13,554 |
| カプコン | 39 | 63 | 285,115 |
| アイ・エス・ビー | 2 | 4 | 5,168 |
| ジャステック | 2 | 4 | 5,199 |
| S C S K | 29 | 52 | 101,699 |
| N S W | 1 | 2 | 5,260 |
| アイネス | 3 | 4 | 5,989 |
| T K C | 7 | 11 | 41,917 |
| 富士ソフト | 4 | 7 | 55,512 |
| N S D | 13 | 22 | 52,257 |
| コナミグループ | 15 | 27 | 170,898 |
| 福井コンピュータホールディングス | 1 | 4 | 12,408 |
| J B C Cホールディングス | 2 | 4 | 8,892 |
| ミロク情報サービス | 3 | 5 | 10,492 |
| ソフトバンクグループ | 253 | 369 | 2,115,719 |
| 卸売業(6.0%) | | | |
| 高千穂交易 | — | 2 | 5,776 |
| オルパルスケアホールディングス | 2 | — | — |
| 伊藤忠食品 | 1 | 1 | 7,455 |
| エレマテック | 3 | 6 | 10,404 |
| J A L U X | 1 | — | — |
| あらた | 3 | 5 | 20,982 |
| トーマンデバイス | 0.600 | 1 | 6,770 |
| 東京エレクトロン デバイス | 1 | 2 | 19,825 |
| 円谷フィールズホールディングス | — | 5 | 23,461 |
| 双日 | 46 | 71 | 184,184 |
| アルフレッサ ホールディングス | 47 | 67 | 110,931 |
| 横浜冷凍 | 11 | 18 | 18,245 |
| ラサ商事 | 3 | — | — |
| アルコニックス | 5 | 8 | 11,979 |
| 神戸物産 | 32 | 52 | 188,081 |
| ハイパー | 5 | 4 | 1,980 |
| あい ホールディングス | 6 | 10 | 23,036 |
| ディーブイエックス | 2 | 4 | 4,841 |
| ダイワボウホールディングス | 20 | 27 | 56,760 |
| マクニカホールディングス | 10 | 16 | 58,410 |
| ラクト・ジャパン | 1 | 2 | 5,179 |

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 |
| グリムス | 1 | 2 | 6,946 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 7 | 9 | 8,486 |
| 八洲電機 | 3 | 5 | 6,042 |
| メディアスホールディングス | 3 | 7 | 5,464 |
| レスターホールディングス | 4 | 6 | 14,176 |
| ジュテックホールディングス | 2 | 4 | 5,332 |
| OCHIホールディングス | 2 | 3 | 5,206 |
| TOKAIホールディングス | 20 | 33 | 28,704 |
| Cominix | 4 | 6 | 5,005 |
| 三洋貿易 | 4 | 6 | 7,859 |
| ビューティガレージ | - | 1 | 4,207 |
| ウイン・パートナーズ | 3 | 4 | 5,179 |
| シップハルスケアホールディングス | 13 | 24 | 60,354 |
| 明治電機工業 | 2 | 4 | 5,358 |
| コメダホールディングス | 9 | 16 | 38,940 |
| アセンテック | 3 | 11 | 5,991 |
| 協栄産業 | 1 | - | - |
| フルサト・マルカホールディングス | 4 | 6 | 19,798 |
| ヤマエグループホールディングス | 2 | 3 | 6,281 |
| 小野建 | 4 | 6 | 9,337 |
| 南陽 | 1 | 2 | 5,055 |
| 佐鳥電機 | - | 4 | 6,858 |
| 伯東 | 2 | 3 | 18,876 |
| コンドーテック | 3 | 5 | 5,512 |
| 中山福 | 8 | 14 | 5,017 |
| ナガイレーベン | 5 | 8 | 16,753 |
| 三菱食品 | 4 | 6 | 20,398 |
| 松田産業 | 3 | 5 | 11,577 |
| 第一興商 | 8 | 13 | 55,250 |
| メディパルホールディングス | 45 | 69 | 122,325 |
| S P K | 2 | 3 | 5,316 |
| 萩原電気ホールディングス | 1 | 2 | 6,931 |
| アズワン | 6 | 9 | 56,529 |
| スズデン | 1 | 2 | 6,391 |
| シモジマ | 2 | 5 | 5,319 |
| ドウシシャ | 4 | 7 | 12,559 |
| 小津産業 | 1 | 2 | 4,427 |
| 高速 | 2 | 3 | 6,727 |
| 丸文 | 3 | 6 | 7,938 |
| ハピネット | 3 | 5 | 10,590 |
| 橋本総業ホールディングス | 1 | 4 | 5,254 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本ライフライン | 12 | 19 | 18,005 |
| I DOM | 12 | 20 | 17,748 |
| 進和 | 2 | 4 | 9,567 |
| ダイトロン | 1 | 2 | 6,633 |
| シークス | 6 | 9 | 14,438 |
| 田中商事 | 4 | 8 | 4,938 |
| オーハシテクニカ | 2 | 3 | 5,253 |
| 白銅 | 1 | 2 | 6,211 |
| 伊藤忠商事 | 296 | 415 | 1,705,641 |
| 丸紅 | 418 | 532 | 935,522 |
| 長瀬産業 | 23 | 31 | 64,794 |
| 蝶理 | 2 | 3 | 9,032 |
| 豊田通商 | 42 | 59 | 329,220 |
| 三共生興 | 5 | 10 | 5,640 |
| 兼松 | 15 | 26 | 41,684 |
| 三井物産 | 329 | 493 | 1,926,644 |
| 日本紙パルプ商事 | 2 | 3 | 18,540 |
| カメイ | 5 | 7 | 9,907 |
| OUGホールディングス | 1 | 1 | 4,222 |
| スターゼン | 3 | 5 | 10,954 |
| 山善 | 17 | 18 | 19,000 |
| 椿本興業 | 0.900 | 1 | 4,908 |
| 住友商事 | 267 | 417 | 985,453 |
| 内田洋行 | 1 | 3 | 14,100 |
| 三菱商事 | 317 | 421 | 1,969,577 |
| 第一実業 | 1 | 2 | 12,480 |
| キャノンマーケティングジャパン | 10 | 15 | 48,204 |
| 西華産業 | 2 | 3 | 5,332 |
| 佐藤商事 | 3 | 4 | 6,424 |
| 菱洋エレクトロ | 2 | 5 | 13,885 |
| 東京産業 | 3 | 6 | 4,947 |
| ユアサ商事 | 4 | 6 | 22,173 |
| 神鋼商事 | 0.900 | 1 | 9,894 |
| 阪和興業 | 8 | 12 | 48,037 |
| 正栄食品工業 | 2 | 4 | 18,742 |
| カナデン | 3 | 5 | 5,956 |
| 菱電商事 | 3 | 5 | 10,076 |
| 岩谷産業 | 10 | 15 | 86,598 |
| ナイス | 1 | 2 | 3,967 |
| 極東貿易 | 1 | 4 | 5,784 |
| アステナホールディングス | 6 | 11 | 4,984 |

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 |
| 三愛オブリ | 10 | 18 | 26,077 |
| 稲畑産業 | 9 | 13 | 35,496 |
| G S Iクレオス | - | 3 | 6,091 |
| 明和産業 | 3 | 9 | 6,318 |
| クワザワホールディングス | - | 10 | 4,939 |
| ワキタ | 9 | 12 | 14,470 |
| 東邦ホールディングス | 13 | 16 | 36,136 |
| サンゲツ | 11 | 16 | 40,272 |
| ミツウロコグループホールディングス | 6 | 8 | 11,745 |
| シナネンホールディングス | 1 | 2 | 7,733 |
| 伊藤忠エネクス | 9 | 16 | 18,403 |
| サンリオ | 13 | 19 | 77,928 |
| サンワ テクノス | 2 | 3 | 6,558 |
| リョーサン | 4 | 7 | 21,832 |
| 新光商事 | 6 | 9 | 11,720 |
| トーホー | 2 | 2 | 5,118 |
| 三信電気 | 2 | 2 | 6,885 |
| 東陽テクニカ | 4 | 7 | 9,742 |
| モスフードサービス | 5 | 9 | 30,492 |
| 加賀電子 | 3 | 5 | 25,685 |
| ソーダニッカ | 4 | - | - |
| 立花エレテック | 3 | 4 | 9,177 |
| フォーバル | 3 | - | - |
| P A L T A C | 5 | 10 | 51,516 |
| 三谷産業 | 9 | 15 | 5,008 |
| 西本Wismettacホールディングス | 1 | 1 | 6,162 |
| K P Pグループホールディングス | 9 | 15 | 12,355 |
| ヤマタネ | 2 | 3 | 4,995 |
| 丸紅建材リース | 1 | 2 | 4,847 |
| 日鉄物産 | 3 | 4 | 42,596 |
| 泉州電業 | 1 | 3 | 12,427 |
| トラスコ中山 | 8 | 14 | 31,048 |
| オートバックスセブン | 14 | 23 | 33,883 |
| モリト | 4 | 6 | 6,402 |
| 加藤産業 | 6 | 8 | 29,807 |
| イエローハット | 7 | 11 | 21,158 |
| J Kホールディングス | 3 | 5 | 5,628 |
| 日伝 | 3 | 4 | 7,612 |
| 北沢産業 | 12 | 23 | 6,354 |
| 杉本商事 | 2 | 3 | 5,748 |
| 因幡電機産業 | 11 | 17 | 49,070 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東テク | 1 | 2 | 9,141 |
| ミスミグループ本社 | 53 | 101 | 316,795 |
| タキヒヨー | 1 | - | - |
| 蔵王産業 | 1 | 2 | 5,187 |
| スズケン | 16 | 21 | 73,185 |
| ジェコス | 3 | 5 | 5,010 |
| 小売業(4.6%) | | | |
| ローソン | 9 | 16 | 90,514 |
| サンエー | 3 | 5 | 21,216 |
| カワチ薬品 | 3 | 5 | 12,311 |
| エービーシー・マート | 6 | 9 | 66,444 |
| ハードオフコーポレーション | 4 | 2 | 3,640 |
| アスクル | 6 | 16 | 28,247 |
| ゲオホールディングス | 5 | 7 | 12,545 |
| アダストリア | 4 | 8 | 18,411 |
| くら寿司 | 4 | 7 | 25,122 |
| キャンドウ | 2 | 2 | 5,551 |
| I Kホールディングス | 7 | - | - |
| パルグループホールディングス | 3 | 6 | 18,222 |
| エディオン | 19 | 26 | 35,217 |
| サーラコーポレーション | 8 | 14 | 10,110 |
| ハローズ | 1 | 3 | 10,431 |
| フジオフードグループ本社 | 3 | 5 | 7,593 |
| あみやき亭 | 1 | 1 | 5,069 |
| 大黒天物産 | 1 | 2 | 11,832 |
| ハニーズホールディングス | 3 | 6 | 8,718 |
| ファーマライズホールディングス | - | 7 | 4,277 |
| アルペン | 3 | 5 | 10,920 |
| ハブ | 4 | - | - |
| クオールホールディングス | 5 | 9 | 11,067 |
| ジンスホールディングス | 2 | 4 | 14,080 |
| ビックカメラ | 25 | 44 | 52,908 |
| D C Mホールディングス | 26 | 41 | 49,032 |
| M o n o t a R O | 53 | 95 | 182,214 |
| 東京一番フーズ | 5 | 8 | 4,034 |
| アーランドサービスホールディングス | 3 | 5 | 12,028 |
| J. フロント リテイリング | 50 | 83 | 107,599 |
| ドトール・日レスホールディングス | 7 | 11 | 22,360 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 26 | 40 | 270,758 |
| ブロンコビリー | 2 | 3 | 8,679 |
| Z O Z O | 29 | 44 | 136,837 |

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 |
| トレジャー・ファクトリー | 3 | 2 | 4,828 |
| 物語コーポレーション | 2 | 3 | 26,381 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 74 | 113 | 160,007 |
| Hamee | 0.300 | 7 | 5,964 |
| ウエルシアホールディングス | 22 | 35 | 105,875 |
| クリエイトSDホールディングス | 6 | 11 | 37,518 |
| 丸善CHIホールディングス | 8 | 12 | 4,445 |
| ミサワ | 4 | 2 | 1,414 |
| ティーライフ | 2 | 3 | 4,355 |
| シュッピン | 3 | 5 | 4,530 |
| オイシックス・ラ・大地 | 6 | 9 | 22,859 |
| ネクステージ | 8 | 15 | 48,895 |
| ジョイフル本田 | 12 | 21 | 38,322 |
| 鳥貴族ホールディングス | - | 2 | 5,122 |
| ホットランド | 3 | 5 | 7,170 |
| すかいらーくホールディングス | 54 | 92 | 147,267 |
| SFPホールディングス | 2 | 3 | 6,541 |
| 綿半ホールディングス | 3 | 5 | 7,363 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 12 | 22 | 24,684 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 2 | 3 | 3,224 |
| B E E N O S | 2 | 3 | 9,511 |
| あさひ | 3 | 5 | 7,632 |
| 日本調剤 | 2 | 4 | 5,395 |
| コスモス薬品 | 4 | 7 | 95,988 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 165 | 232 | 1,424,314 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 22 | 50 | 48,672 |
| ツルハホールディングス | 9 | 16 | 156,585 |
| サンマルクホールディングス | 3 | 5 | 9,655 |
| フェリシモ | 2 | 4 | 4,400 |
| トリドールホールディングス | 10 | 16 | 45,023 |
| T O K Y O B A S E | 4 | 17 | 8,043 |
| ウエルプラスホールディングス | 3 | - | - |
| J Mホールディングス | 2 | 5 | 10,670 |
| アレンザホールディングス | 3 | 5 | 5,075 |
| パロックジャパンリミテッド | 3 | 5 | 4,950 |
| クスリのアオキホールディングス | 4 | 6 | 48,280 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 24 | 38 | 135,450 |
| メディカルシステムネットワーク | 5 | 11 | 4,720 |
| はるやまホールディングス | - | 11 | 4,906 |
| ノジマ | 6 | 22 | 28,798 |
| カッパ・クリエイト | 5 | 10 | 15,147 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ライトオン | 3 | 6 | 3,682 |
| 良品計画 | 48 | 86 | 122,007 |
| アドヴァングループ | 4 | 6 | 5,792 |
| アルビス | 1 | 2 | 5,284 |
| コナカ | 9 | 14 | 5,069 |
| ハウス オブ ローゼ | - | 2 | 4,782 |
| G-7ホールディングス | 4 | 8 | 12,062 |
| イオン北海道 | 7 | 10 | 8,910 |
| コジマ | 7 | 13 | 7,267 |
| ヒマラヤ | 3 | 4 | 4,630 |
| コーナン商事 | 6 | 9 | 30,576 |
| エコス | 1 | 2 | 4,820 |
| ワタミ | 5 | 8 | 7,290 |
| パ・パフィック・インターナショナルホールディングス | 84 | 151 | 390,442 |
| 西松屋チェーン | 9 | 14 | 23,318 |
| ゼンショーホールディングス | 20 | 36 | 140,589 |
| 幸楽苑ホールディングス | 2 | - | - |
| サイゼリヤ | 6 | 11 | 34,216 |
| V Tホールディングス | 16 | 25 | 12,876 |
| 魚力 | - | 2 | 4,958 |
| フジ・コーポレーション | 2 | 3 | 4,753 |
| ユナイテッドアローズ | 4 | 7 | 12,535 |
| ハイデイ日高 | 6 | 10 | 20,570 |
| YU-WA CREATION HOLDINGS | 14 | - | - |
| コロワイド | 17 | 31 | 58,125 |
| ピーシーデポコーポレーション | 9 | 17 | 5,304 |
| 壱番屋 | 3 | 5 | 24,857 |
| スギホールディングス | 8 | 13 | 77,928 |
| 薬王堂ホールディングス | 2 | 3 | 9,203 |
| スクロール | 6 | 10 | 7,850 |
| ヨンドシーホールディングス | 3 | 5 | 10,411 |
| 木曽路 | 5 | 10 | 22,348 |
| S R Sホールディングス | 5 | 11 | 10,145 |
| 千趣会 | 7 | 12 | 4,910 |
| リテールパートナーズ | 5 | 10 | 13,070 |
| ケーヨー | 7 | 10 | 9,766 |
| 上新電機 | 4 | 6 | 11,946 |
| 日本瓦斯 | 20 | 36 | 67,831 |
| ロイヤルホールディングス | 7 | 13 | 33,536 |
| 東天紅 | 3 | 5 | 4,033 |
| いなげや | 5 | 6 | 8,703 |

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 |
| チヨダ | 4 | 6 | 5,068 |
| ライフコーポレーション | 4 | 5 | 16,496 |
| リンガーハット | 5 | 8 | 19,583 |
| MrMaxHD | 5 | 9 | 6,429 |
| AOKIホールディングス | 8 | 12 | 9,812 |
| オークワ | 6 | 10 | 9,946 |
| コメリ | 6 | 10 | 27,560 |
| 青山商事 | 8 | 14 | 13,694 |
| しまむら | 4 | 7 | 102,147 |
| 高島屋 | 30 | 50 | 96,723 |
| 松屋 | 8 | 11 | 12,973 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 20 | 32 | 44,575 |
| 近鉄百貨店 | 1 | 2 | 5,398 |
| 丸井グループ | 33 | 49 | 102,680 |
| アクシアル リテイリング | 3 | 4 | 16,307 |
| イオン | 163 | 228 | 596,923 |
| イズミ | 7 | 10 | 30,549 |
| 平和堂 | 7 | 11 | 24,600 |
| フジ | 5 | 10 | 18,818 |
| ヤオコー | 4 | 7 | 51,984 |
| ゼビオホールディングス | 5 | 9 | 8,908 |
| ケーズホールディングス | 39 | 53 | 63,355 |
| 日産東京販売ホールディングス | 13 | 4 | 1,675 |
| Genky DrugStores | 1 | 3 | 14,008 |
| ナルミヤ・インターナショナル | 3 | 5 | 5,224 |
| ブックオフグループホールディングス | 2 | 4 | 5,096 |
| ギフトホールディングス | - | 1 | 5,999 |
| アインホールディングス | 6 | 9 | 52,080 |
| 元気寿司 | 1 | 2 | 6,394 |
| ヤマダホールディングス | 155 | 276 | 132,347 |
| アークランズ | 6 | 9 | 14,404 |
| ニトリホールディングス | 16 | 27 | 439,120 |
| グルメ杵屋 | 3 | 5 | 5,560 |
| 愛眼 | 17 | 27 | 4,537 |
| ケーユーホールディングス | - | 3 | 5,674 |
| 吉野家ホールディングス | 14 | 26 | 62,594 |
| 松屋フーズホールディングス | 2 | 3 | 12,800 |
| サガミホールディングス | 6 | 10 | 13,748 |
| 関西フードマーケット | 3 | 6 | 8,277 |
| 王将フードサービス | 2 | 4 | 26,708 |
| プレナス | 4 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ミニストップ | 3 | 4 | 6,918 |
| アークス | 8 | 12 | 27,503 |
| パローホールディングス | 9 | 12 | 24,897 |
| ベルク | 1 | 3 | 18,802 |
| 大 庄 | - | 4 | 4,255 |
| ファーストリテイリング | 5 | 10 | 834,967 |
| サンドラッグ | 15 | 25 | 94,976 |
| サックスパー ホールディングス | 5 | 6 | 4,953 |
| ヤマザワ | 1 | 3 | 4,957 |
| やまや | 1 | 1 | 4,964 |
| ベルーナ | 9 | 16 | 11,097 |
| 銀行業(6.8%) | | | |
| いよぎんホールディングス | - | 74 | 60,500 |
| しずおかフィナンシャルグループ | - | 141 | 157,145 |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | - | 52 | 51,004 |
| 島根銀行 | 5 | 9 | 5,157 |
| じもとホールディングス | 4 | 8 | 3,645 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 220 | 311 | 114,832 |
| 東京きらほしフィナンシャルグループ | 5 | 8 | 24,080 |
| 九州フィナンシャルグループ | 86 | 110 | 56,414 |
| ゆうちょ銀行 | 100 | 178 | 215,748 |
| 富山第一銀行 | 10 | 15 | 10,202 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 242 | 345 | 197,740 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 27 | 39 | 44,821 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 3 | 5 | 9,615 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 6 | 9 | 31,605 |
| ひろぎんホールディングス | 62 | 81 | 56,687 |
| おきなわフィナンシャルグループ | 3 | 6 | 14,070 |
| 十六フィナンシャルグループ | 5 | 8 | 26,158 |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 3 | 5 | 22,949 |
| プロクレアホールディングス | - | 7 | 18,010 |
| あいちフィナンシャルグループ | - | 8 | 20,627 |
| SBI新生銀行 | 27 | 18 | 45,066 |
| あおぞら銀行 | 23 | 39 | 104,449 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,662 | 3,982 | 3,975,729 |
| りそなホールディングス | 486 | 800 | 603,572 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 80 | 114 | 565,554 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 293 | 458 | 2,750,400 |
| 千葉銀行 | 141 | 174 | 173,052 |
| 群馬銀行 | 81 | 121 | 61,701 |
| 武蔵野銀行 | 6 | 8 | 20,225 |

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 | |
| 千葉興業銀行 | 11 | 14 | 7,541 | |
| 筑波銀行 | — | 27 | 6,572 | |
| 七十七銀行 | 13 | 20 | 48,501 | |
| 青森銀行 | 3 | — | — | |
| 秋田銀行 | 2 | 4 | 8,148 | |
| 山形銀行 | 4 | 7 | 8,939 | |
| 岩手銀行 | 2 | 4 | 10,479 | |
| 東邦銀行 | 35 | 49 | 12,300 | |
| みちのく銀行 | 3 | — | — | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 35 | 50 | 155,059 | |
| 静岡銀行 | 103 | — | — | |
| スルガ銀行 | 37 | 55 | 23,391 | |
| 八十二銀行 | 95 | 128 | 77,734 | |
| 山梨中央銀行 | 4 | 6 | 8,659 | |
| 大垣共立銀行 | 8 | 12 | 23,976 | |
| 福井銀行 | 3 | 5 | 9,486 | |
| 清水銀行 | 1 | 3 | 4,792 | |
| 富山銀行 | 1 | 1 | 1,985 | |
| 滋賀銀行 | 8 | 10 | 30,243 | |
| 南都銀行 | 6 | 9 | 25,126 | |
| 百五銀行 | 40 | 59 | 24,603 | |
| 京都銀行 | 15 | 19 | 127,957 | |
| 紀陽銀行 | 14 | 22 | 36,310 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 26 | 39 | 42,134 | |
| 山陰合同銀行 | 25 | 39 | 33,129 | |
| 中国銀行 | 33 | — | — | |
| 鳥取銀行 | 1 | — | — | |
| 伊予銀行 | 56 | — | — | |
| 百十四銀行 | 4 | 5 | 11,382 | |
| 四国銀行 | 6 | 10 | 9,520 | |
| 阿波銀行 | 6 | 9 | 20,794 | |
| 大分銀行 | 2 | 3 | 8,588 | |
| 宮崎銀行 | 2 | 4 | 11,410 | |
| 佐賀銀行 | 2 | 3 | 6,830 | |
| 琉球銀行 | 9 | 14 | 15,825 | |
| セブン銀行 | 126 | 224 | 60,444 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 543 | 907 | 1,945,729 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 49 | 69 | 63,894 | |
| 長野銀行 | 2 | 3 | 5,486 | |
| 名古屋銀行 | 3 | 4 | 15,204 | |
| 北洋銀行 | 64 | 95 | 28,405 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-------|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 愛知銀行 | 1 | — | — | |
| 中京銀行 | 1 | — | — | |
| 大光銀行 | 2 | 3 | 4,521 | |
| 愛媛銀行 | 5 | 8 | 8,151 | |
| 京葉銀行 | 18 | 29 | 18,944 | |
| 栃木銀行 | 20 | 28 | 9,499 | |
| 北日本銀行 | 1 | 2 | 4,928 | |
| 東和銀行 | 7 | 11 | 6,992 | |
| トモニホールディングス | 32 | 50 | 19,773 | |
| フィデアホールディングス | 3 | 6 | 9,600 | |
| 池田泉州ホールディングス | 48 | 80 | 20,476 | |
| 証券、商品先物取引業(0.8%) | | | | |
| F P G | 14 | 25 | 31,033 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 3 | 5 | 5,380 | |
| マーキュリアホールディングス | — | 4 | 3,675 | |
| S B Iホールディングス | 52 | 90 | 268,768 | |
| ジャフコ グループ | 16 | 20 | 44,328 | |
| 大和証券グループ本社 | 318 | 448 | 288,834 | |
| 野村ホールディングス | 648 | 1,155 | 653,612 | |
| 岡三証券グループ | 33 | 55 | 24,629 | |
| 丸三証券 | 12 | 20 | 9,196 | |
| 東洋証券 | 15 | 20 | 6,780 | |
| 東海証券フィナンシャル・ホールディングス | 48 | 68 | 26,568 | |
| 光世証券 | 6 | 5 | 1,907 | |
| 水戸証券 | 11 | 23 | 6,969 | |
| いちよし証券 | 7 | 11 | 7,551 | |
| 松井証券 | 20 | 37 | 29,785 | |
| マネックスグループ | 34 | 70 | 37,082 | |
| 極東証券 | 5 | 8 | 5,321 | |
| 岩井コスモホールディングス | 4 | 7 | 9,819 | |
| アイザワ証券グループ | 7 | 9 | 6,461 | |
| スパークス・グループ | 19 | 7 | 12,012 | |
| 保険業(2.5%) | | | | |
| かんぽ生命保険 | 42 | 76 | 183,718 | |
| SOMPOホールディングス | 69 | 107 | 624,229 | |
| アニコム ホールディングス | 13 | 21 | 12,077 | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 95 | 127 | 568,713 | |
| 第一生命ホールディングス | 209 | 319 | 946,405 | |
| 東京海上ホールディングス | 139 | 631 | 1,810,481 | |
| T & Dホールディングス | 110 | 168 | 364,369 | |
| アドバンスクリエイト | 2 | 3 | 4,154 | |

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 |
| その他金融業(1.2%) | | | |
| 全国保証 | 10 | 16 | 87,285 |
| ジェイリース | 1 | 2 | 4,998 |
| イントラスト | 3 | 4 | 3,897 |
| アルヒ | 6 | 7 | 8,616 |
| プレミアグループ | 2 | 10 | 16,493 |
| ネットプロテクションズホールディングス | — | 20 | 11,964 |
| クレディセゾン | 27 | 39 | 72,412 |
| 芙蓉総合リース | 4 | 5 | 52,722 |
| みずほリース | 6 | 9 | 33,340 |
| 東京センチュリー | 8 | 11 | 54,634 |
| 日本証券金融 | 16 | 25 | 25,928 |
| アイフル | 71 | 103 | 38,339 |
| リコーリース | 3 | 6 | 23,730 |
| イオンフィナンシャルサービス | 23 | 36 | 47,952 |
| アコム | 83 | 111 | 36,591 |
| ジャックス | 4 | 6 | 28,743 |
| オリエンコーポレーション | 114 | 16 | 19,122 |
| オリックス | 257 | 419 | 1,017,916 |
| 三菱HCキャピタル | 156 | 244 | 169,997 |
| 九州リースサービス | 5 | 3 | 3,104 |
| 日本取引所グループ | 107 | 176 | 346,497 |
| イー・ギャランティ | 6 | 10 | 22,977 |
| アサックス | 4 | 8 | 4,952 |
| NECキャピタルソリューション | 1 | 3 | 7,998 |
| 不動産業(1.9%) | | | |
| 大東建託 | 13 | 23 | 289,340 |
| いちご | 47 | 72 | 20,793 |
| 日本駐車場開発 | 46 | 74 | 19,123 |
| スター・マイカ・ホールディングス | 2 | — | — |
| SREホールディングス | 1 | 3 | 10,757 |
| ADワークスグループ | 19 | 20 | 3,292 |
| ヒューリック | 101 | 146 | 158,442 |
| 三栄建築設計 | 1 | 3 | 4,926 |
| 野村不動産ホールディングス | 22 | 39 | 114,503 |
| 三重交通グループホールディングス | 8 | 13 | 6,686 |
| サムティ | 6 | 10 | 20,460 |
| ディア・ライフ | 5 | 9 | 5,942 |
| コーセーアールイー | 4 | 6 | 4,532 |
| 地主 | 2 | 4 | 9,124 |
| プレサンスコーポレーション | 5 | 8 | 13,751 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ハウスコム | — | 4 | 4,460 |
| JPMC | 2 | 4 | 4,690 |
| サンセイランディック | 0.200 | 5 | 4,580 |
| エストラスト | 4 | 8 | 5,040 |
| フージャースホールディングス | 5 | 9 | 8,021 |
| オープンハウスグループ | 13 | 23 | 111,320 |
| 東急不動産ホールディングス | 125 | 188 | 120,515 |
| 飯田グループホールディングス | 35 | 54 | 120,725 |
| イーブランド | 1 | — | — |
| ムゲンエステート | 6 | 9 | 4,878 |
| ファーストブラザーズ | 3 | — | — |
| And Doホールディングス | 3 | 6 | 5,511 |
| シーアールイー | — | 4 | 4,578 |
| ケイアイスター不動産 | 1 | 3 | 12,725 |
| グッドコムアセット | 2 | 5 | 4,979 |
| ジェイ・エス・ビー | 0.700 | 1 | 5,692 |
| ロードスターキャピタル | — | 3 | 4,683 |
| パーク24 | 22 | 48 | 99,169 |
| 三井不動産 | 193 | 272 | 677,547 |
| 三菱地所 | 279 | 378 | 619,983 |
| 平和不動産 | 7 | 10 | 36,669 |
| 東京建物 | 41 | 59 | 95,261 |
| ダイビル | 10 | — | — |
| 京阪神ビルディング | 6 | 7 | 9,630 |
| 住友不動産 | 89 | 113 | 351,540 |
| テーオーシー | 7 | 11 | 7,107 |
| 東京楽天地 | 0.700 | 1 | 5,352 |
| レオパレス21 | 44 | 70 | 22,977 |
| スターツコーポレーション | 5 | 9 | 23,314 |
| フジ住宅 | 4 | 8 | 5,948 |
| 空港施設 | 5 | 9 | 4,765 |
| ゴールドクレスト | 3 | 6 | 9,948 |
| エスリード | 1 | 2 | 6,081 |
| 日神グループホールディングス | 6 | 11 | 4,961 |
| 日本エスコン | 7 | 14 | 11,674 |
| MIRARTHホールディングス | 17 | 31 | 11,443 |
| AVANTIA | 3 | 5 | 4,628 |
| イオンモール | 21 | 32 | 58,825 |
| ファースト住建 | 2 | 4 | 4,656 |
| カチタス | 10 | 16 | 45,528 |
| トーセイ | 5 | 10 | 14,996 |

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 |
| 穴吹興産 | 1 | 2 | 5,014 |
| サンフロンティア不動産 | 5 | 10 | 12,820 |
| FJネクストホールディングス | 4 | 6 | 6,501 |
| グランディハウス | 6 | 8 | 4,988 |
| 日本空港ビルデング | 16 | 22 | 144,300 |
| サービス業(5.2%) | | | |
| 日本工営 | 2 | 4 | 15,228 |
| L I F U L L | 12 | 22 | 4,345 |
| M I X I | 9 | 14 | 39,201 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 3 | 5 | 13,446 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 67 | 112 | 134,647 |
| メンバーズ | 1 | 2 | 3,632 |
| UTグループ | 5 | 9 | 23,241 |
| アイティメディア | 1 | 3 | 4,512 |
| E・Jホールディングス | － | 4 | 5,678 |
| オープンアップグループ | 10 | 23 | 44,860 |
| コシダカホールディングス | 11 | 19 | 18,012 |
| アルトナー | 3 | 1 | 1,409 |
| パソナグループ | 4 | 7 | 15,199 |
| CDS | 1 | 2 | 4,690 |
| リンクアンドモチベーション | 9 | 18 | 11,280 |
| エス・エム・エス | 14 | 24 | 82,917 |
| サニーサイドアップグループ | 4 | 7 | 4,102 |
| パーソルホールディングス | 41 | 73 | 204,726 |
| クックパッド | 12 | 26 | 5,772 |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 4 | 3 | 2,165 |
| 学情 | 2 | 3 | 4,844 |
| スタジオアリス | 1 | 3 | 6,930 |
| シミックホールディングス | 2 | 3 | 6,336 |
| N J S | 1 | 2 | 5,060 |
| 総合警備保障 | 16 | 24 | 85,293 |
| カカココム | 30 | 48 | 94,132 |
| アイロムグループ | 1 | 2 | 4,783 |
| セントケア・ホールディング | 3 | 5 | 4,553 |
| ルネサンス | 2 | 5 | 5,084 |
| ディップ | 7 | 11 | 42,090 |
| デジタルホールディングス | 2 | 5 | 5,946 |
| 新日本科学 | 5 | 6 | 18,429 |
| ベネフィット・ワン | 15 | 30 | 63,145 |
| エムスリー | 72 | 129 | 427,667 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 10 | － | － |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アウトソーシング | 23 | 39 | 49,101 |
| ウェルネット | 6 | 7 | 5,089 |
| ワールドホールディングス | 1 | 2 | 7,803 |
| ディー・エヌ・エー | 15 | 27 | 50,136 |
| 博報堂DYホールディングス | 57 | 83 | 125,584 |
| ぐるなび | 6 | 12 | 4,662 |
| ジャパンバスターシキュシステム | － | 5 | 4,655 |
| ファンコミュニケーションズ | 10 | 12 | 5,248 |
| ライク | － | 2 | 4,562 |
| ビジネス・ブレークスルー | 7 | 11 | 4,446 |
| エスプール | 11 | 18 | 12,972 |
| WDBホールディングス | 1 | 3 | 6,642 |
| アドウェイズ | 6 | 9 | 6,435 |
| バリューコマース | 3 | 4 | 8,383 |
| インフォマート | 45 | 68 | 22,304 |
| J P ホールディングス | 12 | 18 | 6,448 |
| CLホールディングス | 2 | 6 | 4,972 |
| プレステージ・インターナショナル | 15 | 27 | 18,562 |
| アミューズ | 2 | 3 | 6,177 |
| ドリームインキュベータ | 1 | 2 | 6,177 |
| クイック | 2 | 5 | 9,170 |
| TAC | 13 | 22 | 4,651 |
| 電通グループ | 42 | 64 | 280,348 |
| ぴあ | 1 | 2 | 6,853 |
| イオンファンタジー | 1 | 2 | 7,966 |
| シーティーエス | 4 | 7 | 5,666 |
| ネクシィーズグループ | 4 | － | － |
| H. U. グループホールディングス | 10 | 19 | 51,590 |
| アルプス技研 | 3 | 5 | 13,668 |
| 日本空調サービス | 4 | 7 | 5,047 |
| オリエンタルランド | 48 | 69 | 1,488,217 |
| ダスキン | 9 | 14 | 45,552 |
| 明光ネットワークジャパン | 5 | 8 | 5,340 |
| ファルコホールディングス | 2 | 3 | 5,892 |
| 秀英予備校 | 7 | 11 | 4,706 |
| ラウンドワン | 11 | 54 | 26,256 |
| リゾートトラスト | 18 | 25 | 55,315 |
| ビー・エム・エル | 5 | 8 | 25,636 |
| りらいあコミュニケーションズ | 6 | 10 | 15,681 |
| リソー教育 | 18 | 29 | 10,549 |
| 早稲田アカデミー | 2 | 4 | 5,190 |

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 |
| ユー・エス・エス | 46 | 67 | 150,213 |
| 東京個別指導学院 | 4 | 9 | 4,885 |
| サイバーエージェント | 101 | 156 | 187,920 |
| 楽天グループ | 211 | 302 | 209,303 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 2 | 3 | 8,618 |
| モーニングスター | 7 | 10 | 5,232 |
| テー・オー・ダブリュー | 9 | 16 | 5,018 |
| 山田コンサルティンググループ | 2 | 4 | 6,451 |
| セントラルスポーツ | 1 | 2 | 6,165 |
| フルキャストホールディングス | 3 | 6 | 15,500 |
| エン・ジャパン | 6 | 11 | 28,426 |
| テクノプロ・ホールディングス | 24 | 43 | 152,333 |
| インタワーワークス | 7 | 12 | 4,798 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 1 | 3 | 6,762 |
| Keeper 技研 | 2 | 4 | 16,755 |
| 三機サービス | 2 | 4 | 4,377 |
| Gunosy | 2 | - | - |
| イー・ガーディアン | 1 | 2 | 5,952 |
| リブセンス | 17 | 1 | 475 |
| ジャパンマテリアル | 12 | 20 | 47,260 |
| ベクトル | 5 | 10 | 14,008 |
| ウチヤマホールディングス | 9 | 15 | 4,277 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 3 | 5 | 6,099 |
| キャリアリンク | 2 | 2 | 6,072 |
| I B J | 3 | 5 | 4,494 |
| アサンテ | 1 | 3 | 5,260 |
| バリューHR | 1 | 5 | 9,063 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 3 | 6 | 27,210 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 1 | 4 | 5,156 |
| アビスト | 1 | - | - |
| シグマクシス・ホールディングス | 2 | 9 | 10,909 |
| ウィルグループ | 3 | 5 | 6,064 |
| メドピア | 3 | 5 | 6,981 |
| リクルートホールディングス | 317 | 484 | 1,846,222 |
| エラン | 5 | 8 | 9,282 |
| 日本郵政 | 537 | 858 | 1,046,331 |
| ベルシステム24ホールディングス | 5 | 8 | 13,006 |
| 鎌倉新書 | 4 | 7 | 8,073 |
| SMN | 4 | 8 | 3,801 |
| エアトリ | 2 | 4 | 10,714 |
| アトラエ | 2 | 5 | 5,074 |
| ストライク | 1 | 3 | 13,056 |
| ソラスト | 10 | 18 | 12,222 |
| インソース | 4 | 16 | 21,205 |
| ペイカレント・コンサルティング | 2 | 51 | 289,562 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| Orchestra Holdings | 0.800 | 2 | 5,250 |
| アイモパイル | - | 4 | 5,212 |
| MS-Japan | 3 | - | - |
| ジャパンエペーターサービスホールディングス | 13 | 23 | 46,716 |
| GAMEWITH | 6 | 10 | 3,510 |
| ウェルビー | 2 | 6 | 4,349 |
| ミダックホールディングス | 1 | 4 | 11,116 |
| 日総工産 | 3 | - | - |
| キュービネットホールディングス | 1 | 3 | 5,227 |
| RPAホールディングス | 8 | 18 | 6,290 |
| マネジメントソリューションズ | 2 | 3 | 13,284 |
| プロレド・パートナーズ | 2 | 10 | 5,613 |
| and factory | 7 | 11 | 4,247 |
| カープスホールディングス | 11 | 20 | 15,718 |
| フォーラムエンジニアリング | 3 | 5 | 5,150 |
| ダイレクトマーケティングミックス | 4 | 7 | 12,097 |
| ポピンズ | 1 | 3 | 5,952 |
| LITALICO | 3 | 5 | 13,203 |
| リロググループ | 22 | 36 | 78,915 |
| 東祥 | 3 | 4 | 5,469 |
| TREホールディングス | 5 | 13 | 20,451 |
| 人・夢・技術グループ | 1 | 2 | 4,428 |
| エイチ・アイ・エス | 9 | 17 | 35,756 |
| ラックランド | 1 | 2 | 5,796 |
| 共立メンテナンス | 7 | 11 | 59,024 |
| イチネンホールディングス | 4 | 6 | 8,776 |
| 建設技術研究所 | 2 | 3 | 11,832 |
| スペース | 3 | 5 | 4,717 |
| 燦ホールディングス | - | 2 | 6,032 |
| 東京テアトル | 2 | 4 | 4,520 |
| タナベコンサルティンググループ | 4 | 7 | 6,153 |
| ナガワ | 1 | 1 | 13,680 |
| 東京都競馬 | 3 | 5 | 20,487 |
| カナモト | 7 | 12 | 26,712 |
| 西尾レントオール | 3 | 6 | 18,971 |
| トランス・コスモス | 5 | 8 | 27,418 |
| 乃村工藝社 | 17 | 28 | 25,682 |
| 藤田観光 | 1 | 2 | 9,613 |
| KNT-CTホールディングス | 2 | 3 | 6,680 |
| 日本管財 | 4 | 6 | 17,601 |
| トーカイ | 3 | 5 | 11,043 |
| セコム | 40 | 66 | 525,262 |
| セントラル警備保障 | 2 | 3 | 8,715 |
| 丹青社 | 8 | 12 | 9,042 |
| メイテック | 5 | 26 | 63,449 |

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 |
| 応用地質 | 4 | 6 | 12,187 |
| 船井総研ホールディングス | 8 | 13 | 38,391 |
| 進学会ホールディングス | 10 | 14 | 4,380 |
| 学究社 | 1 | 2 | 5,429 |
| ベネッセホールディングス | 13 | 24 | 48,214 |
| イオンディライト | 5 | 7 | 21,744 |
| ナック | 3 | 5 | 5,090 |
| ダイセキ | 7 | 13 | 53,935 |
| ステップ | 1 | 2 | 4,795 |
| 合計 | 株数・金額 | 47,173 | 74,409 183,450,884 |
| | 銘柄数<比率> | 1,840 | 1,821 <97.9%> |

(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 |
| | TOPIX | 3,958 | — |

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 183,450,884 | 97.7 |
| コール・ローン等、その他 | 4,369,209 | 2.3 |
| 投資信託財産総額 | 187,820,093 | 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

(2023年2月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|------------------------|-------------------------|
| (A)資産 | 187,717,378,816円 |
| コール・ローン等 | 3,767,811,236 |
| 株式(評価額) | 183,450,884,230 |
| 未収入金 | 123,396,100 |
| 未収配当金 | 317,622,250 |
| 差入委託証拠金 | 57,665,000 |
| (B)負債 | 289,343,871 |
| 未払解約金 | 289,341,033 |
| その他未払費用 | 2,838 |
| (C)純資産総額(A-B) | 187,428,034,945 |
| 元本 | 81,219,744,591 |
| 次期繰越損益金 | 106,208,290,354 |
| (D)受益権総口数 | 81,219,744,591口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,077円 |

(注1) 期首元本額 54,493,461,224円
 期中追加設定元本額 52,350,966,244円
 期中一部解約元本額 25,624,682,877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 | 5,571,030,272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) | 3,265,507,266円 |
| ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) | 3,457,877円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 2,199,185,777円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 7,566,845,432円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 5,825,429,331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) | 3,392,674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) | 13,543,439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) | 11,849,890円 |
| DCニッセイ国内株式インデックス | 1,876,859,994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 | 23,490,370,695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) | 2,985,872,092円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2055 | 290,153,997円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 242,293,972円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2045 | 335,702,180円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2035 | 571,176,835円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2025 | 47,127,163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) | 124,141,170円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 9,162,792円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) | 12,847,195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) | 5,307,703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) | 8,885,025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) | 28,981,300円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2060 | 212,241,013円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2050 | 141,337,546円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2040 | 299,353,517円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2030 | 205,759,439円 |
| ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定) | 25,795,069,108円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/スケット) | 22,046,930円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型) | 72,423円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型) | 154,390円 |
| FWニッセイ国内株インデックス | 38,721,220円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2065 | 15,864,934円 |

損益の状況

当期(2022年2月22日~2023年2月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A)配当等収益 | 4,092,787,401円 |
| 受取配当金 | 4,093,722,738 |
| 受取利息 | 85,045 |
| その他収益 | 1,284,641 |
| 支払利息 | △ 2,305,023 |
| (B)有価証券売買損益 | 10,228,495,064 |
| 売却益 | 17,364,693,127 |
| 売却損 | △ 7,136,198,063 |
| (C)先物取引等損益 | 273,947,350 |
| 取引益 | 755,852,300 |
| 取引損 | △ 481,904,950 |
| (D)信託報酬等 | △ 127,768 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 14,595,102,047 |
| (F)前期繰越損益金 | 62,567,536,066 |
| (G)追加信託差損益金 | 60,038,867,965 |
| (H)解約差損益金 | △ 30,993,215,724 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 106,208,290,354 |
| 次期繰越損益金(I) | 106,208,290,354 |

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。