

第24期末（2025年2月20日）

基準価額	28,545円
純資産総額	167億円
騰落率	5.8%
分配金	0円

ニッセイ

TOPIXオープン

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：2024年2月21日～2025年2月20日

第24期(決算日 2025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「ニッセイTOPIXオープン」は、このたび第24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、国内の株式市場の動きをとらえること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。

今後ともいっそろ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

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

運用経過

2024年2月21日～2025年2月20日

基準価額等の推移



(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「指標に関するご参考」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24期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	155円	0.550%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は28,175円です。
(投信会社)	(67)	(0.236)	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)	(67)	(0.236)	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)	(22)	(0.077)	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	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
その他費用	0	0.002	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.002)	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	156	0.553	

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

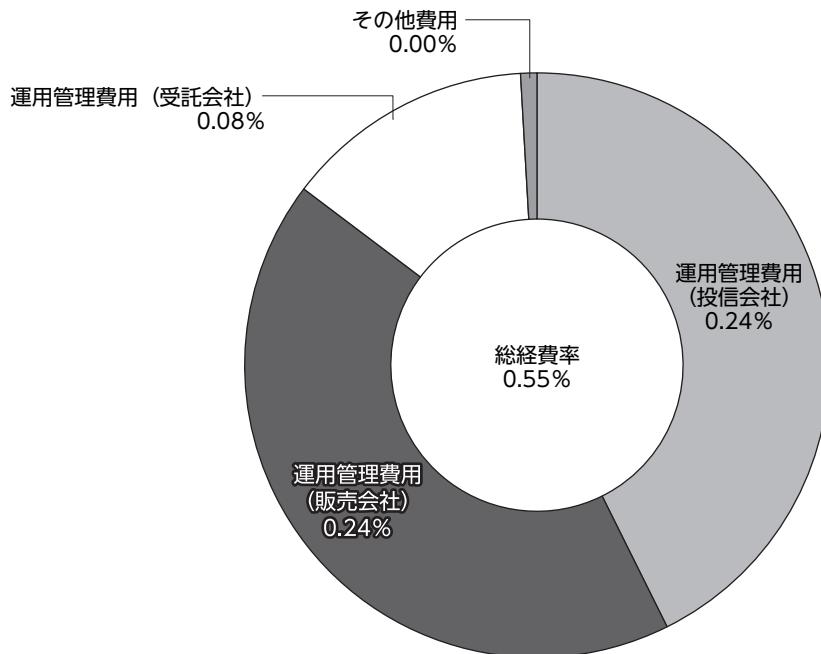
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(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0.55%です。



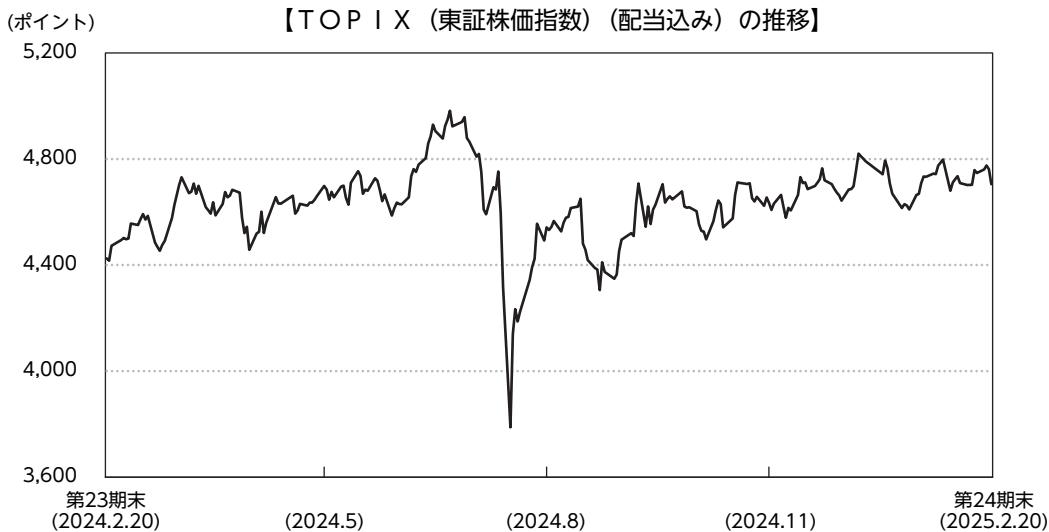
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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



(注) FactSetのデータを使用しています。

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米金利の上昇による円安進行や新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入継続などから株価は上昇する展開となりましたが、その後は中東における地政学リスクの高まりや米国における利下げ観測の後退などを受けて下落しました。2024年4月下旬以降は国内企業の積極的な株主還元姿勢や米国株の上昇を背景に堅調に推移し、6月中旬以降は米国のインフレ継続懸念が後退したことによる米金利の低下と米ハイテク銘柄の株高が追い風となって上昇しました。7月下旬以降は米景気後退懸念と日銀の追加利上げ観測の高まりによる急速な円高などから株価は大幅に下落しましたが、内田日銀副総裁の金融引き締めに慎重な発言を受けて再び円安になると反発しました。

10月に入ると株価は上下する展開となりましたが、為替市場における円安傾向や衆院選の結果を受けた景気刺激的な政策への期待感を受けて上昇しました。11月はトランプ次期米大統領の関税強化策に対する警戒感の高まりやウクライナを巡る地政学リスクの高まりからやや下落し、12月は米連邦準備制度理事会（FRB）の2025年の利下げペース鈍化見通しなどから下落する場面もありましたが、植田日銀総裁の金融引き締めに慎重な発言や堅調な米経済指標を受けて上昇しました。年明け以降もトランプ米新政権による関税強化に対する不確実性や、日銀の追加利上げとその後の金融政策への思惑が交錯し、株価は上下する展開となりましたが、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

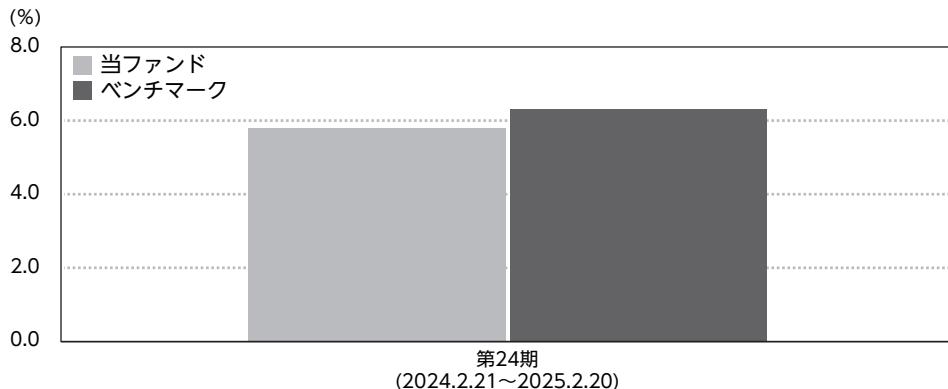
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの收益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■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「指標について」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+5.8%となり、ベンチマーク騰落率(+6.3%)を下回りました。これは主に当ファンドにおいて信託報酬等の費用を控除した影響によるものです。

(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、見送さ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 2024年2月21日～2025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	23,554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、国内の株式市場の動きをとらえること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投資成果を目標に運用を行います。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第24期末 2025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

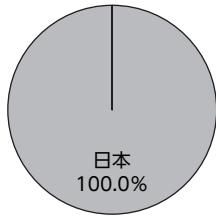
項目	第24期末 2025年2月20日
純資産総額	16,742,224,686円
受益権総口数	5,865,182,449口
1万口当たり基準価額	28,545円

(注) 当期間中における追加設定元本額は591,137,345円、同解約元本額は869,931,851円です。

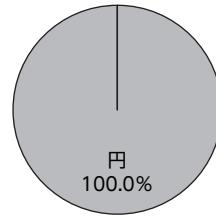
■資産別配分



■国別配分



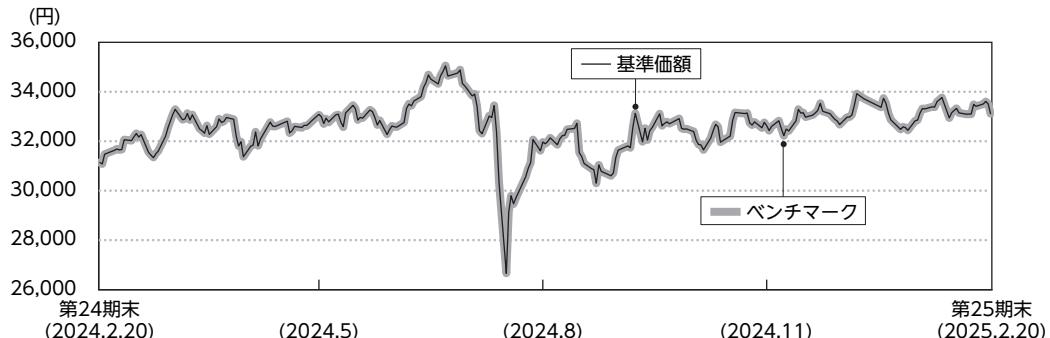
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2025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



■上位銘柄

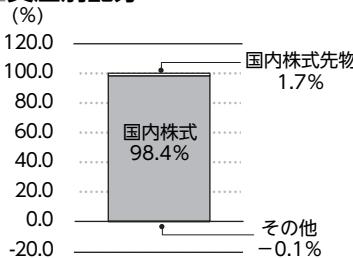
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.6%
ソニーグループ	円	3.2
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	3.1
日立製作所	円	2.8
三井住友フィナンシャルグループ	円	2.0
リクルートホールディングス	円	2.0
任天堂	円	1.8
TOPIX 先物 0703月 買	円	1.7
キーエンス	円	1.6
みずほフィナンシャルグループ	円	1.5
組入銘柄数		1,610

■1万口当たりの費用明細

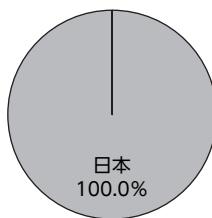
2024.2.21～2025.2.20

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

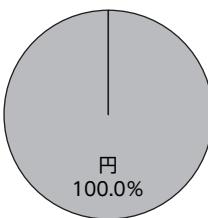
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



（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（2025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	%					
20期(2021年2月22日)	18,773	0	17.9	18,773	20,219	18.6	99.3	0.7	12,357	百万円
21期(2022年2月21日)	18,805	0	0.2	18,805	20,354	0.7	96.1	3.7	12,538	
22期(2023年2月20日)	20,098	0	6.9	20,098	21,884	7.5	97.9	2.1	12,855	
23期(2024年2月20日)	26,980	0	34.2	26,980	29,536	35.0	98.8	1.0	16,576	
24期(2025年2月20日)	28,545	0	5.8	28,545	31,405	6.3	98.4	1.7	16,742	

(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)2024年2月20日	26,980	—	29,536	—	98.8	1.0
2月末	27,427	1.7	30,035	1.7	98.5	1.5
3月末	28,633	6.1	31,367	6.2	97.6	2.5
4月末	28,365	5.1	31,080	5.2	97.5	2.5
5月末	28,677	6.3	31,440	6.4	97.6	2.4
6月末	29,079	7.8	31,897	8.0	98.0	2.0
7月末	28,906	7.1	31,724	7.4	98.1	1.8
8月末	28,065	4.0	30,805	4.3	97.5	2.5
9月末	27,618	2.4	30,333	2.7	96.8	3.5
10月末	28,128	4.3	30,904	4.6	97.5	2.5
11月末	27,972	3.7	30,745	4.1	97.6	2.4
12月末	29,084	7.8	31,981	8.3	97.9	1.9
2025年1月末	29,116	7.9	32,026	8.4	98.4	1.7
(期末)2025年2月20日	28,545	5.8	31,405	6.3	98.4	1.7

(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

2024年2月21日～2025年2月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
千円	千円	千円	千円	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	511,058	1,660,423	778,392	2,541,974

(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	71,795,351千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	244,243,653千円	
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.29	

(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

2024年2月21日～2025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

2025年2月20日現在

種類	期首(前期末)		当期末	
	口数	千円	口数	評価額
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5,323,486	千円	5,056,152	千円
				16,742,438

(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87,962,939千円です。

投資信託財産の構成

2025年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	16,742,438	%
コール・ローン等、その他	64,075	99.6
投資信託財産総額	16,806,514	0.4
		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

		(2025年2月20日現在)
項目	当期末	
(A)資産	16,806,514,028円	
コール・ローン等	44,755,582	
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	16,742,438,180	
未収入金	19,320,266	
(B)負債	64,289,342	
未払解約金	18,045,751	
未払信託報酬	46,151,377	
その他未払費用	92,214	
(C)純資産総額(A-B)	16,742,224,686	
元本	5,865,182,449	
次期繰越損益金	10,877,042,237	
(D)受益権総口数	5,865,182,449口	
1万口当たり基準価額(C/D)	28,545円	
(注)期首元本額	6,143,976,955円	
期中追加設定元本額	591,137,345円	
期中一部解約元本額	869,931,851円	

損益の状況

		当期 (2024年2月21日～2025年2月20日)
項目	当期	
(A)配当等収益	38,476円	
受取利息	38,493	
支払利息	△ 17	
(B)有価証券売買損益	943,470,735	
売買益	1,055,266,122	
売買損	△ 111,795,387	
(C)信託報酬等	△ 93,194,097	
(D)当期損益金(A+B+C)	850,315,114	
(E)前期繰越損益金	6,318,125,095	
(分配準備積立金)	(6,318,131,264)	
(繰越欠損金)	(△ 6,169)	
(F)追加信託差損益金*	3,708,602,028	
(配当等相当額)	(6,646,945,584)	
(売買損益相当額)	(△ 2,938,343,556)	
(G)合計(D+E+F)	10,877,042,237	
次期繰越損益金(G)	10,877,042,237	
追加信託差損益金	3,708,602,028	
(配当等相当額)	(6,646,945,584)	
(売買損益相当額)	(△ 2,938,343,556)	
分配準備積立金	7,168,440,209	

(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	38,476円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	850,270,469円
(c) 信託約款に定める収益調整金	6,646,945,584円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	6,318,131,264円
(e) 分配対象額 (a+b+c+d)	13,815,385,793円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	23,554.91円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

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、国内の株式市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。	
主要運用対象	ニッセイTOPIXオープン	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	ニッセイTOPIXオープン	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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利子・配当収入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。	

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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 25 期

(計算期間：2024年2月21日～2025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。



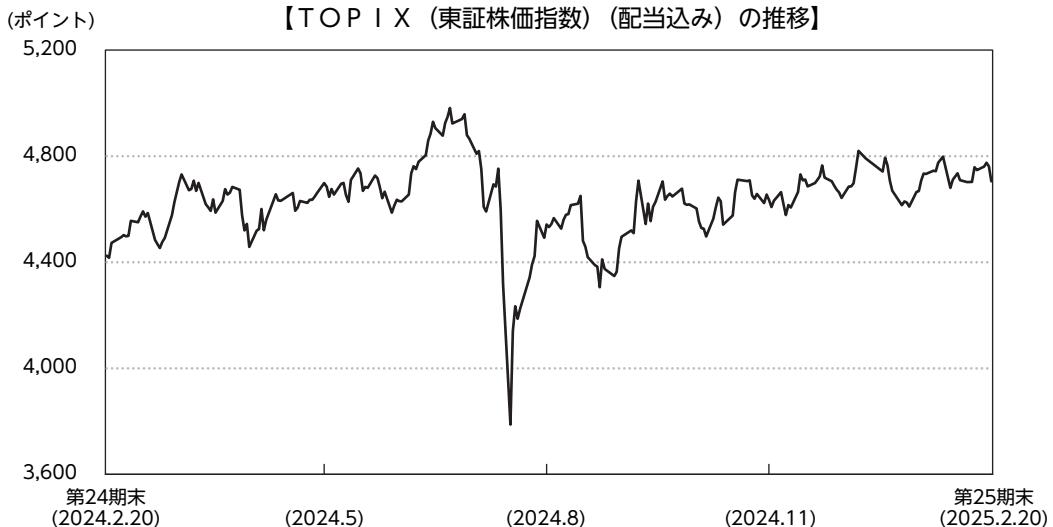
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2024年2月21日～2025年2月20日

国内株式市況



(注) FactSetのデータを使用しています。

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米金利の上昇による円安進行や新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入継続などから株価は上昇する展開となりましたが、その後は中東における地政学リスクの高まりや米国における利下げ観測の後退などを受けて下落しました。2024年4月下旬以降は国内企業の積極的な株主還元姿勢や米国株の上昇を背景に堅調に推移し、6月中旬以降は米国のインフレ継続懸念が後退したことによる米金利の低下と米ハイテク銘柄の株高が追い風となって上昇しました。7月下旬以降は米景気後退懸念と日銀の追加利上げ観測の高まりによる急速な円高などから株価は大幅に下落しましたが、内田日銀副総裁の金融引き締めに慎重な発言を受けて再び円安になると反発しました。

10月に入ると株価は上下する展開となりましたが、為替市場における円安傾向や衆院選の結果を受けた景気刺激的な政策への期待感を受けて上昇しました。11月はトランプ次期米大統領の関税強化策に対する警戒感の高まりやウクライナを巡る地政学リスクの高まりからやや下落し、12月は米連邦準備制度理事会（FRB）の2025年の利下げペース鈍化見通しなどから下落する場面もありましたが、植田日銀総裁の金融引き締めに慎重な発言や堅調な米経済指標を受けて上昇しました。年明け以降もトランプ米新政権による関税強化に対する不確実性や、日銀の追加利上げとその後の金融政策への思惑が交錯し、株価は上下する展開となりましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えるました。

基準価額等の推移



■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。

(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。

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。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+6.3%となり、ベンチマーク騰落率 (+6.3%) 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投資成果を目標として運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチマーク	期中	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		騰落率		騰落率			
		円	%	%	%	%	百万円
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
24期(2024年2月20日)	31,139	34.9	31,493	35.0	98.8	1.0	224,002
25期(2025年2月20日)	33,113	6.3	33,486	6.3	98.4	1.7	291,269

(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)2024年2月20日	31,139	—	31,493	—	98.8	1.0
2月末	31,659	1.7	32,024	1.7	98.5	1.5
3月末	33,063	6.2	33,445	6.2	97.6	2.5
4月末	32,769	5.2	33,139	5.2	97.5	2.5
5月末	33,142	6.4	33,523	6.4	97.6	2.4
6月末	33,620	8.0	34,010	8.0	98.0	2.0
7月末	33,436	7.4	33,826	7.4	98.1	1.8
8月末	32,477	4.3	32,846	4.3	97.5	2.5
9月末	31,974	2.7	32,343	2.7	96.8	3.5
10月末	32,578	4.6	32,951	4.6	97.5	2.5
11月末	32,410	4.1	32,782	4.1	97.6	2.4
12月末	33,714	8.3	34,100	8.3	97.9	1.9
2025年1月末	33,766	8.4	34,148	8.4	98.4	1.7
(期末)2025年2月20日	33,113	6.3	33,486	6.3	98.4	1.7

(注) 謄落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

1万口当たりの費用明細

2024年2月21日～2025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（32,600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

2024年2月21日～2025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
		30,179	63,989,608	5,066	7,805,742
		(21,921)			

(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
株式先物取引	51,466	48,819	－	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

主要な売買銘柄

2024年2月21日～2025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
トヨタ自動車	707	2,037,617	2,880	J S R	64	281,154	4,332
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,121	1,959,480	1,747	ゆうちょ銀行	176	244,149	1,382
日立製作所	433	1,832,677	4,225	日本郵船	47	243,315	5,079
ソニーグループ	316	1,438,436	4,539	トヨタ自動車	59	188,125	3,145
リクルートホールディングス	143	1,396,928	9,734	三菱商事	61	179,397	2,898
三井住友フィナンシャルグループ	216	999,146	4,612	ローソン	13	140,443	10,326
キーエンス	14	943,532	65,523	三菱電機	53	127,758	2,388
任天堂	90	894,775	9,865	I N P E X	51	119,650	2,309
東京エレクトロン	30	844,202	27,769	大正製薬ホールディングス	13	113,098	8,568
第一三共	177	808,193	4,566	日本郵政	69	102,503	1,477

(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

2025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	評価額	千円
水産・農林業(0.1%)				
極洋	3	4	17,780	
ニッスイ	83	102	87,856	
マルハニチロ	12	15	48,042	
雪国まいたけ	7	8	10,612	
カネコ種苗	2	2	4,057	
サカタのタネ	9	12	43,815	
ホクト	6	9	17,802	
鉱業(0.2%)				
住石ホールディングス	9	12	10,087	
日鉄鉱業	3	4	23,534	
I N P E X	307	311	591,556	
石油資源開発	9	56	63,562	
K & O エナジーグループ	3	4	15,134	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
建設業(2.2%)				
ショーボンドホールディングス	11	13	64,354	
ミライト・ワン	27	33	75,723	
タマホーム	5	6	21,417	
ファーストコーポレーション	1	—	—	
第一カッター興業	—	4	6,820	
安藤・間	48	59	78,374	
東急建設	26	32	24,858	
コムシスホールディングス	26	36	117,274	
ビーアールホールディングス	17	20	6,942	
高松コンストラクショングループ	6	7	20,801	
東建コーポレーション	2	2	27,412	
ソネック	1	—	—	
ヤマウラ	4	5	6,939	

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	千円	千円
オリエンタル白石	30	38	14,401	北陸電気工事	5	-	-	-	-	-	-
大成建設	54	65	454,333	ユアテック	12	13	21,718	日本リーテック	5	5	8,187
大林組	208	237	478,014	四電工	2	9	12,123	中電工	9	11	36,008
清水建設	164	196	278,767	関電工	36	39	103,272	きんでん	40	50	162,273
飛島建設	6	-	-	東京エネシス	6	7	8,323	トーエニック	1	11	11,947
長谷工コーポレーション	53	66	131,274	住友電設	5	5	27,759	日本電設工業	10	13	28,903
松井建設	7	4	4,440	エクシオグループ	28	74	130,002	新日本空調	3	9	15,317
鹿島建設	128	159	493,473	九電工	12	15	70,652	三機工業	12	15	50,175
不動テトラ	4	4	9,819	日揮ホールディングス	57	71	80,390	中外炉工業	2	2	8,868
鉄建建設	4	4	12,102	ヤマト	2	-	-	太平電業	3	4	22,310
西松建設	11	11	56,626	高砂熱学工業	15	17	95,787	朝日工業社	2	6	13,513
三井住友建設	43	58	23,937	明星工業	11	12	15,197	大氣社	6	9	42,872
大豊建設	2	2	7,270	ダイダン	7	9	36,527	日比谷総合設備	4	5	18,880
佐田建設	2	-	-	飛島ホールディングス	-	7	12,972	テスホールディングス	13	22	6,297
ナカノフドー建設	0.100	-	-	インフロニア・ホールディングス	67	75	86,372	東洋エンジニアリング	8	10	7,589
奥村組	9	12	54,864	レイズネクスト	8	10	16,213	食料品(2.9%)			
東鉄工業	7	7	24,371	ニップン	17	23	50,337	日清粉グループ本社	54	75	127,351
浅沼組	4	28	19,440	日東富士製粉	1	1	8,554	昭和産業	5	6	17,104
戸田建設	78	88	87,696	中部飼料	8	10	12,680	フィード・ワン	8	10	8,480
熊谷組	9	11	45,517	日本甜菜製糖	3	3	9,013	DM三井製糖ホールディングス	5	7	24,228
植木組	0.900	-	-	ウェルネオシュガー	2	4	9,274	森永製菓	25	30	74,775
矢作建設工業	7	9	12,622								
ピース・コンストラクション	7	5	7,852								
日本ハウスホールディングス	21	21	6,923								
新日本建設	8	10	14,382								
東亜道路工業	2	12	18,562								
日本道路	6	7	13,752								
東亜建設工業	4	21	29,468								
日本国土開発	16	23	11,178								
若築建設	2	2	7,465								
東洋建設	14	20	27,593								
五洋建設	82	94	61,776								
世紀東急工業	7	10	15,851								
福田組	2	2	13,824								
住友林業	50	62	278,096								
日本基礎技術	8	-	-								
巴コーポレーション	6	-	-								
大和ハウス工業	160	217	1,067,377								
ライト工業	12	14	37,697								
積水ハウス	176	218	732,513								
日特建設	5	6	7,286								

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	株数	千円
中村屋	2	2	6,963	キユーピー	31	38	108,737				
江崎グリコ	16	20	95,054	ハウス食品グループ本社	20	24	67,250				
名糖産業	3	3	6,766	カゴメ	25	30	87,524				
井村屋グループ	3	4	9,800	アリアケジャパン	5	7	42,984				
不二家	4	5	11,145	エバラ食品工業	2	2	6,847				
山崎製パン	39	48	132,519	ニチレイ	26	28	98,841				
モロゾフ	1	7	11,599	東洋水産	29	33	306,826				
亀田製菓	3	4	18,147	イートアンドホールディングス	3	3	7,788				
寿スピリッツ	27	42	102,117	ヨシムラ・フード・ホールディングス	6	—	—				
カルビー	26	33	94,335	日清食品ホールディングス	61	91	266,248				
森永乳業	20	26	81,991	永谷園ホールディングス	2	—	—				
六甲バター	4	6	6,894	フジッコ	6	7	12,047				
ヤクルト本社	83	103	301,790	ロック・フィールド	7	8	12,619				
明治ホールディングス	71	93	272,629	日本たばこ産業	354	439	1,631,120				
雪印メグミルク	14	19	49,276	ケンコーマヨネーズ	4	4	8,374				
プリマハム	7	9	20,728	わらべや日洋ホールディングス	3	4	10,084				
日本ハム	25	31	139,732	なとり	3	4	9,720				
林兼産業	1	—	—	ファーマフーズ	8	9	8,995				
丸大食品	5	7	12,045	ユーレナ	36	44	21,596				
S Foods	6	8	18,824	紀文食品	5	6	6,558				
柿安本店	2	3	8,912	ピックルスホールディングス	5	6	6,922				
伊藤ハム米久ホールディングス	8	11	40,755	理研ビタミン	5	6	14,415				
サッポロホールディングス	19	23	183,141	繊維製品(0.4%)							
アサヒグループホールディングス	134	542	969,076	片倉工業	5	6	13,362				
キリンホールディングス	243	301	602,651	グンゼ	4	5	26,312				
シマダヤ	—	4	6,696	東洋紡	25	31	30,655				
宝ホールディングス	39	48	57,539	富士紡ホールディングス	2	2	13,601				
オエノンホールディングス	17	23	9,898	倉敷紡績	4	4	29,057				
養命酒製造	3	—	—	シキボウ	—	6	7,003				
コカ・コーラ ポトラーズジャパンホールディングス	45	45	108,538	日本毛織	15	18	24,590				
ライフドリンク カンパニー	—	15	29,372	帝国繊維	6	8	19,969				
サントリー食品インターナショナル	41	50	234,801	帝人	57	70	91,874				
ダイドーグループホールディングス	6	8	24,050	東レ	397	537	528,900				
伊藤園	19	24	79,714	日本フェルト	5	—	—				
キーコーヒー	6	8	16,669	イチカワ	3	—	—				
日清オイリオグループ	8	10	48,501	アツギ	10	—	—				
不二製油グループ本社	13	14	37,008	セーレン	11	14	37,516				
J-Oイルミルズ	6	8	16,326	ソトー	5	—	—				
キッコーマン	38	239	341,886	東海染工	1	—	—				
味の素	138	167	999,472	小松マテーレ	8	10	8,485				
ブルドックソース	3	4	7,040	ワコールホールディングス	12	15	78,523				

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ホギメディカル	7	9	47,916			デンカ	21	26	55,789		
ＴＳＩホールディングス	19	23	28,652			信越化学工業	538	654	3,026,712		
マツオカコーポレーション	3	—	—			日本カーバイド工業	4	3	7,452		
ワールド	8	11	26,329			堺化学工業	4	5	13,907		
三陽商会	—	3	10,947			第一稀元素化学工業	6	9	6,731		
オンワードホールディングス	35	47	26,425			エア・ウォーター	56	69	131,166		
ルックホールディングス	—	3	7,027			日本酸素ホールディングス	57	71	307,160		
ゴールドワイン	10	13	94,464			日本化学工業	3	—	—		
デサント	10	—	—			日本パーカライジング	26	32	41,984		
ヤマトイターナショナル	14	—	—			高圧ガス工業	8	10	9,137		
パルプ・紙(0.1%)						四国化成ホールディングス	7	8	16,043		
特種東海製紙	3	3	13,338			ステラ ケミファ	3	4	17,100		
王子ホールディングス	247	278	175,315			保土谷化学工業	1	2	7,222		
日本製紙	33	38	38,912			日本触媒	8	47	85,203		
三菱製紙	4	—	—			大日精化工業	4	5	15,631		
北越コーポレーション	29	41	57,778			カネカ	15	18	67,631		
大王製紙	26	37	30,533			三菱瓦斯化学	44	59	140,030		
阿波製紙	3	—	—			三井化学	49	66	221,770		
レンゴー	54	66	53,573			J S R	64	—	—		
トーモク	3	4	10,084			東京応化工業	28	35	131,133		
ザ・パック	4	5	18,562			大阪有機化学工業	5	6	16,095		
化学(4.9%)						三菱ケミカルグループ	434	537	410,081		
北の達人コーポレーション	26	41	6,987			K Hネオケム	9	13	33,276		
クラレ	86	98	183,152			ダイセル	76	83	111,062		
旭化成	401	497	498,992			住友ベーライト	8	23	80,527		
レゾナック・ホールディングス	57	66	231,858			積水化学工業	119	146	366,000		
住友化学	440	591	203,535			日本ゼオン	40	56	84,426		
住友精化	2	3	17,570			アイカ工業	15	18	61,789		
日産化学	27	37	164,959			U B E	28	37	83,398		
ラサ工業	2	2	7,462			積水樹脂	8	9	17,856		
クレハ	13	15	41,967			タキロンシーアイ	15	—	—		
多木化学	2	2	10,063			旭有機材	4	4	19,649		
ティカ	5	5	7,801			ニチバン	3	4	9,236		
石原産業	9	12	20,727			リケンテクノス	12	13	13,173		
日本曹達	7	15	45,349			大倉工業	2	3	12,121		
東ソー	79	98	206,956			積水化成品工業	12	19	6,848		
トフヤマ	19	23	63,093			群栄化学工業	1	2	6,775		
セントラル硝子	6	9	29,992			ダイキヨーニシカワ	13	16	9,849		
東亞合成	28	34	47,774			森六ホールディングス	3	4	8,200		
大阪ソーダ	4	25	35,440			恵和	4	6	8,636		
関東電化工業	11	15	14,077			日本化薬	45	49	66,906		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
カーリット	6	7	7,920			日本高純度化学	2	2	6,886		
日本精化	3	4	10,760			タカラバイオ	16	23	20,559		
扶桑化学工業	6	6	24,106			J C U	6	8	30,213		
トリケミカル研究所	7	8	30,360			新田ゼラチン	0.500	—	—		
A D E K A	20	25	70,784			○ A T アグリオ	3	—	—		
日油	17	86	182,379			デクセリアルズ	14	64	145,770		
新日本理化	5	—	—			アース製薬	5	6	34,000		
ハリマ化成グループ	7	8	6,966			北興化学工業	6	6	8,553		
花王	134	179	1,155,374			大成ラミック	2	2	6,750		
第一工業製薬	3	2	6,999			クミアイ化学工業	23	29	22,150		
石原ケミカル	3	3	6,822			日本農薬	10	11	8,621		
三洋化成工業	3	4	17,910			アキレス	4	4	6,862		
大日本塗料	6	8	10,012			有沢製作所	10	11	15,739		
日本ペイントホールディングス	315	325	335,812			日東電工	38	232	691,765		
関西ペイント	58	61	135,242			レック	7	9	11,627		
中国塗料	12	16	36,204			三光合成	—	10	6,681		
藤倉化成	14	13	6,838			きもと	4	—	—		
太陽ホールディングス	10	12	52,224			Z A C R O S	4	5	24,447		
D I C	23	26	84,303			前澤化成工業	4	5	9,287		
サカタインクス	13	16	29,241			未来工業	2	2	8,801		
a r t i e n c e	12	13	39,481			J S P	4	6	12,276		
T & K T O K A	5	—	—			エフピコ	11	16	48,785		
富士フィルムホールディングス	110	444	1,342,656			天馬	4	6	16,006		
資生堂	124	153	409,917			信越ポリマー	12	15	24,724		
ライオン	77	93	168,660			ニフコ	17	27	100,375		
高砂香料工業	4	5	33,250			バルカー	5	5	18,564		
マンダム	12	14	18,060			ユニ・チャーム	123	460	517,955		
ミルボン	8	11	34,633			医薬品(4.0%)					
ファンケル	26	—	—			協和キリン	71	86	176,447		
コーワ	12	15	93,000			武田薬品工業	526	655	2,726,287		
コタ	5	7	11,325			アステラス製薬	521	645	938,815		
ポーラ・オルビスホールディングス	30	37	46,107			住友ファーマ	44	65	50,238		
ノエビアホールディングス	5	6	27,456			塩野義製薬	75	244	536,751		
新日本製薬	3	4	9,160			わかもと製薬	3	—	—		
エステー	4	6	8,868			日本新薬	15	19	74,324		
アグロ カネショウ	4	—	—			中外製薬	186	230	1,695,558		
コニシ	17	23	27,979			科研製薬	10	12	55,880		
長谷川香料	11	14	37,886			エーザイ	72	96	407,656		
小林製薬	17	19	109,102			ロート製薬	57	77	177,806		
荒川化学工業	5	6	7,894			小野薬品工業	126	150	229,589		
メック	4	6	15,988			久光製薬	13	16	69,486		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円	
持田製薬	6	9	28,737	三ツ星ベルト	7	10	38,862				
参天製薬	108	133	187,760	バンドー化学	8	10	18,758				
扶桑薬品工業	2	2	7,032	ガラス・土石製品(0.6%)							
ツムラ	18	25	110,181	日東紡績	7	8	41,209				
キッセイ薬品工業	9	11	43,197	A G C	53	71	319,550				
生化学工業	10	14	10,808	日本板硝子	28	37	14,816				
栄研化学	10	11	24,858	日本電気硝子	24	27	97,188				
鳥居薬品	3	4	16,700	オハラ	5	6	6,690				
J C R ファーマ	20	24	13,197	住友大阪セメント	9	12	44,825				
東和薬品	9	9	28,264	太平洋セメント	35	45	180,601				
富士製薬工業	4	5	7,414	日本ヒューム	7	6	12,684				
ゼリア新薬工業	8	11	23,329	日本コンクリート工業	13	19	6,856				
ネクセラファーマ	19	34	29,237	三谷セキサン	2	2	15,184				
第一三共	518	695	2,374,815	アジアパイルホールディングス	8	10	9,366				
杏林製薬	12	16	21,456	東海カーボン	54	67	62,074				
ダイト	4	5	10,429	日本カーボン	3	4	17,178				
大塚ホールディングス	123	181	1,297,310	東洋炭素	4	5	20,384				
大正製薬ホールディングス	13	—	—	ノリタケ	3	8	29,110				
ペプチドリーム	28	35	74,684	T O T O	39	53	213,386				
セルソース	3	8	6,930	日本碍子	69	81	152,516				
あすか製薬ホールディングス	6	6	13,051	日本特殊陶業	49	60	269,455				
サワイグループホールディングス	13	43	89,154	M A R U W A	2	3	114,762				
石油・石炭製品(0.6%)				品川リフラクトリーズ	7	9	16,097				
日本コーカス工業	60	74	6,881	黒崎播磨	1	5	12,925				
ニチレイグループ	7	7	17,628	ヨータイ	4	0.100	170				
ユシロ化学工業	3	3	7,824	ニッカトー	1	—	—				
富士石油	17	18	6,128	フジミインコーポレーテッド	16	19	41,104				
出光興産	330	344	353,562	クニミネ工業	0.900	—	—				
ENEOSホールディングス	941	1,249	1,056,778	ニチアス	15	18	83,755				
コスモエネルギーホールディングス	17	24	163,174	ニチハ	7	9	27,968				
ゴム製品(0.6%)				鉄鋼(0.9%)							
横浜ゴム	30	37	124,694	日本製鉄	273	383	1,296,568				
TOYO T I R E	34	42	105,157	神戸製鋼所	123	152	266,525				
ブリヂストン	174	215	1,263,200	中山製鋼所	14	15	11,778				
住友ゴム工業	58	72	123,633	合同製鐵	3	4	16,275				
藤倉コンポジット	4	7	10,209	J F E ホールディングス	170	228	410,760				
オカモト	2	3	19,422	東京製鐵	17	21	33,114				
フコク	3	4	7,057	共英製鋼	7	7	14,570				
ニッタ	6	7	25,632	大和工業	11	14	115,872				
住友理工	9	14	24,066	東京鐵鋼	2	3	19,074				

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	株数	千円
大阪製鐵	2	3	9,324	S U M C O	108	144	171,211				
淀川製鋼所	7	7	41,650	川田テクノロジーズ	1	4	15,018				
中部鋼鉄	4	5	10,880	R S T e c h n o l o g i e s	4	5	20,502				
丸一鋼管	18	23	79,695	東洋製罐グループホールディングス	35	48	112,708				
モリ工業	—	1	8,578	ホッカンホールディングス	1	4	6,855				
大同特殊鋼	38	47	57,406	コロナ	6	7	6,941				
日本冶金工業	4	5	21,267	横河プリッジホールディングス	9	13	33,410				
山陽特殊製鋼	6	7	20,587	三和ホールディングス	61	74	369,362				
愛知製鋼	3	4	31,592	文化シヤッター	16	19	36,709				
太平洋金属	5	7	10,899	三協立山	7	11	6,865				
新日本電工	30	45	12,520	アルインコ	6	6	6,804				
栗本鐵工所	2	3	17,325	L I X I L	95	110	190,771				
三菱製鋼	4	5	9,368	日本フイルコン	0.100	—	—				
日亜鋼業	10	—	—	ノーリツ	10	10	17,901				
日本精線	1	6	7,980	長府製作所	6	8	15,878				
エンビプロ・ホールディングス	10	7	2,726	リンナイ	29	40	138,148				
シンニッタン	14	—	—	日東精工	11	12	7,092				
非鉄金属(0.8%)				岡部	10	13	11,056				
大紀アルミニウム工業所	7	10	10,789	ジー・テクト	7	8	13,515				
日本軽金属ホールディングス	17	22	34,609	東プレ	10	13	24,139				
三井金属鉱業	17	19	81,985	高周波熱鍊	9	11	11,144				
東邦亜鉛	5	—	—	東京製綱	4	—	—				
三菱マテリアル	43	54	126,936	サンコール	13	26	11,050				
住友金属鉱山	70	95	325,005	モリテックスチール	0.100	—	—				
DOWAホールディングス	15	20	94,443	パイオラックス	7	10	24,112				
古河機械金属	8	10	22,630	エイチワン	7	7	8,455				
大阪チタニウムテクノロジーズ	10	13	25,256	日本発条	54	67	116,948				
東邦チタニウム	12	15	15,731	中央発條	8	4	7,590				
U A C J	8	10	53,607	三益半導体工業	5	—	—				
C K サンエツ	1	1	7,267	機械(5.5%)							
古河電気工業	20	25	180,186	日本製鋼所	16	22	119,745				
住友電気工業	228	261	726,332	三浦工業	25	34	110,768				
フジクラ	72	81	547,474	タクマ	20	25	45,531				
S W C C	6	10	65,280	ツガミ	13	15	26,228				
タツタ電線	10	—	—	オークマ	5	13	43,160				
平河ヒューテック	4	4	6,993	芝浦機械	6	9	34,010				
リヨービ	6	8	17,795	アマダ	95	103	150,277				
A R E ホールディングス	23	30	57,313	アイダエンジニアリング	13	16	13,429				
金属製品(0.5%)				F U J I	28	32	70,534				
稻葉製作所	4	4	7,030	牧野フライス製作所	6	8	96,695				
宮地エンジニアリンググループ	3	9	16,425	オーエスジー	26	32	55,213				
トーカロ	17	21	38,455	旭ダイヤモンド工業	13	18	15,614				

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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円
DMG森精機	36	46	121,095		ローツエ	3	38	68,092	
ソディック	14	19	17,953		クボタ	313	379	740,198	
ディスコ	28	35	1,652,910		荏原実業	3	3	14,087	
日東工器	3	3	6,726		三菱化工機	2	2	9,932	
日進工具	6	9	6,946		月島ホールディングス	8	10	15,820	
パンチ工業	0.200	—	—		帝国電機製作所	4	5	14,902	
リケンN P R	6	9	24,077		新東工業	12	16	14,866	
島精機製作所	9	11	10,985		澁谷工業	5	7	23,205	
オプトラン	9	12	21,264		アイチコーポレーション	8	12	18,216	
イワキ	4	4	11,965		小森コーポレーション	14	18	23,607	
フリュー	5	7	7,504		鶴見製作所	4	5	17,698	
ヤマシンフィルタ	18	15	9,686		酒井重工業	0.900	2	6,559	
日阪製作所	6	9	9,288		荏原製作所	24	152	400,286	
やまびこ	9	12	29,233		西島製作所	5	6	15,193	
野村マイクロ・サイエンス	2	12	31,598		北越工業	6	7	15,367	
平田機工	2	3	17,185		ダイキン工業	71	96	1,540,770	
P E G A S U S	14	14	6,930		オルガノ	7	11	83,605	
マルマエ	3	—	—		トーヨーカネツ	2	2	10,062	
タツモ	3	5	12,137		栗田工業	33	41	205,259	
ナブテスコ	37	46	111,507		椿本チエイン	8	33	62,092	
三井海洋開発	7	9	39,903		木村化工機	8	8	6,766	
レオン自動機	6	7	10,186		アネスト岩田	9	12	15,636	
SMC	17	22	1,215,006		ダイワフ	101	125	494,164	
ホソカワミクロン	3	5	19,890		サムコ	1	—	—	
ユニオンツール	2	3	15,015		タダノ	34	42	46,414	
瑞光	4	—	—		フジテック	14	23	136,850	
オイレス工業	8	10	22,826		C K D	16	20	47,375	
日精エー・エス・ビー機械	2	2	13,250		平和	17	24	56,637	
サトーホールディングス	8	9	19,062		理想科学工業	4	11	16,969	
技研製作所	5	7	9,968		S A N K Y O	13	85	175,427	
日本エアーテック	5	6	6,741		日本金銭機械	7	9	10,458	
日精樹脂工業	5	7	6,862		マースグループホールディングス	3	5	15,850	
ワイベイシホールディングス	2	7	7,554		フクシマガリレイ	3	10	29,549	
小松製作所	280	365	1,701,037		ダイコク電機	2	3	8,396	
住友重機械工業	35	43	130,031		竹内製作所	10	13	73,980	
日立建機	23	29	114,961		アマノ	17	21	79,212	
日工	8	11	7,667		J U K I	14	—	—	
巴工業	2	2	10,585		ジャノメ	9	7	6,993	
井関農機	5	7	7,481		マックス	8	8	36,178	
T O W A	6	22	36,774		グローリー	14	19	50,381	
北川鉄工所	4	5	6,748		新晃工業	6	21	26,796	

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	株数	千円
大和冷機工業	9	11	17,749	ソシオネクスト	43	73	154,340				
セガサミーホールディングス	53	66	193,734	東芝テック	7	11	33,633				
T P R	7	9	21,770	芝浦メカトロニクス	3	5	49,086				
ツバキ・ナカシマ	12	18	8,893	マブチモーター	29	32	74,172				
ホシザキ	35	47	276,755	ニデック	132	327	909,517				
大豊工業	7	11	6,930	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	23	6,976				
日本精工	110	137	87,144	トレックス・セミコンダクター	3	5	7,592				
N T N	129	175	41,769	東光高岳	3	4	8,132				
ジェイテクト	53	66	75,108	ダブル・スコーピ	17	—	—				
不二越	4	5	18,122	ダイヘン	6	7	50,890				
日本トムソン	16	20	9,837	ヤーマン	11	14	11,223				
T H K	34	42	158,531	J V C ケンウッド	47	58	83,391				
ユーシン精機	9	10	6,814	ミマキエンジニアリング	—	6	9,486				
前澤給装工業	4	5	7,276	I - P E X	4	—	—				
イーグル工業	6	8	16,391	大崎電気工業	13	15	12,306				
P I L L A R	5	6	25,116	オムロン	45	67	309,488				
キッツ	20	24	27,888	日東工業	8	10	29,420				
マキタ	68	92	441,286	I D E C	8	10	27,609				
三井E & S	29	39	67,874	不二電機工業	0.300	—	—				
カナデビア	52	60	56,908	ジー・エス・ユアサ コーポレーション	23	33	79,886				
三菱重工業	104	1,296	2,804,113	メルコホールディングス	1	1	2,601				
I H I	44	59	565,785	テクノメディア	3	3	6,860				
スター精密	11	12	24,437	ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	9	12	7,130				
電気機器(18.6%)											
キオクシアホールディングス	—	33	79,420	日本電気	78	104	1,604,445				
日清紡ホールディングス	45	55	49,968	富士通	55	682	2,029,842				
イビデン	31	42	154,020	沖電気工業	27	35	33,207				
コニカミノルタ	133	165	88,264	電気興業	2	4	6,617				
ブラザー工業	80	99	261,574	サンケン電気	5	7	49,605				
ミネベアミツミ	104	129	295,926	アイホン	3	4	11,808				
日立製作所	287	1,909	8,243,311	ルネサスエレクトロニクス	390	564	1,525,230				
三菱電機	666	754	1,782,928	セイコーエプソン	76	95	232,899				
富士電機	36	45	305,913	ワコム	45	52	33,135				
安川電機	65	80	345,908	アルパック	13	16	91,801				
シンフォニア テクノロジー	6	7	45,954	E I Z O	4	9	20,554				
明電舎	11	12	57,375	日本信号	13	16	15,159				
オリジン	1	—	—	京三製作所	13	17	8,598				
山洋電気	2	3	29,600	能美防災	8	10	30,250				
デンヨー	4	5	14,621	ホーチキ	4	4	11,923				
P H C ホールディングス	11	13	15,039	エレコム	14	17	28,408				
KOKUSAI ELECTRIC	23	52	182,000	パナソニック ホールディングス	707	876	1,584,246				
				シャープ	100	107	103,383				

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
アンリツ	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千円	
富士通ゼネラル	42	52	75,220	6	9	9,162	コーセル	6	9	9,162	
ソニーグループ	17	21	57,855	5	7	20,105	イリソ電子工業	5	7	20,105	
T D K	419	2,532	9,452,036	オプテックスグループ	10	13	22,491	千代田インテグレ	2	2	8,086
帝国通信工業	94	640	1,082,596	レーザーテック	27	28	418,665	スタンレー電気	38	46	113,689
タムラ製作所	3	3	7,539	ウシオ電機	30	32	67,827	岡谷電機産業	0.100	—	—
アルプスアルパイン	23	29	16,815	日本セラミック	4	6	18,009	古河電池	7	5	7,462
日本電波工業	53	60	93,370	山一電機	5	6	12,900	図研	5	6	31,289
鈴木	7	—	—	日本電子	14	17	88,111	カシオ計算機	42	58	73,140
メイコー	5	4	6,824	ファナック	289	355	1,571,847	日本シエムケイ	12	21	10,449
ローランド ディー. ジー.	5	7	58,608	エンプラス	1	2	10,069	エンプラス	1	2	10,069
フォスター電機	3	—	—	大真空	8	11	6,700	大真空	8	11	6,700
S M K	5	7	11,070	ローム	109	133	221,711	浜松ホトニクス	47	117	198,375
ヨコオ	2	2	6,487	三井ハイテック	5	32	29,347	新光電気工業	21	26	153,452
ホシデン	13	18	37,819	京セラ	368	456	786,945	新光電気工業	21	26	153,452
ヒロセ電機	8	10	196,776	太陽誘電	28	32	84,460	京セラ	368	456	786,945
日本航空電子工業	14	19	51,357	村田製作所	539	646	1,759,024	太陽誘電	28	32	84,460
T O A	6	7	7,065	双葉電子工業	12	14	7,392	村田製作所	539	646	1,759,024
マクセル	13	14	26,681	北陸電気工業	2	—	—	双葉電子工業	12	14	7,392
古野電気	7	8	20,240	ニチコン	15	19	23,951	北陸電気工業	2	—	—
スミダコーポレーション	8	10	9,590	日本ケミコン	6	9	8,451	ニチコン	15	19	23,951
アイコム	2	2	8,006	K O A	9	12	12,285	日本ケミコン	6	9	8,451
リオン	2	3	7,443	市光工業	10	16	6,776	K O A	9	12	12,285
横河電機	2	81	233,486	小糸製作所	61	76	144,133	市光工業	10	16	6,776
新電元工業	14	19	51,357	ミツバ	11	13	10,791	小糸製作所	61	76	144,133
アズビル	6	7	7,065	SCREENホールディングス	20	30	342,612	ミツバ	11	13	10,791
日本光工業	13	14	26,681	キヤノン電子	6	7	17,199	SCREENホールディングス	20	30	342,612
チノー	7	8	20,240	キヤノン	295	366	1,872,014	キヤノン電子	6	7	17,199
共和電業	2	2	6,410	リコー	148	193	293,968	キヤノン	295	366	1,872,014
日本電子材料	4	—	—	象印マホービン	16	21	33,507	リコー	148	193	293,968
堀場製作所	3	4	10,030	MUTOHホールディングス	1	—	—	象印マホービン	16	21	33,507
アドバンテスト	11	13	135,969	東京エレクトロン	125	155	3,916,080	MUTOHホールディングス	1	—	—
エスペック	169	231	2,216,812	イノtek	3	5	7,308	東京エレクトロン	125	155	3,916,080
キーエンス	4	6	15,314				イノtek	3	5	7,308	
日置電機	59	73	4,614,330								
シスメックス	2	3	27,729								
日本マイクロニクス	51	190	522,204								
メガチップス	10	12	58,503								
O B A R A G R O U P	4	5	28,671								
澤藤電機	3	—	—								
原田工業	3	4	15,801								
	4	—	—								

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	千円	千円
トヨタ紡織	25	30	60,610			豊田合成	17	21	55,702		
トヨタ紡織	25	30	60,610			愛三工業	9	13	26,535		
芦森工業	1	—	—			盟和産業	1	—	—		
ユニプレス	10	13	13,741			ヨロズ	6	7	7,645		
豊田自動織機	50	62	793,782			エフ・シー・シー	10	12	40,764		
モリタホールディングス	10	11	24,371			シマノ	23	31	641,987		
三櫻工業	9	10	6,751			ティ・エス・テック	21	29	51,129		
デンソー	489	719	1,370,985			ジャムコ	4	4	7,840		
東海理化電機製作所	16	20	44,525			精密機器(2.2%)					
川崎重工業	48	55	444,999			リガク・ホールディングス	—	37	42,034		
名村造船所	14	21	41,895			テルモ	165	491	1,317,621		
日本車輪製造	2	3	6,798			日機装	13	19	23,275		
三菱ロジスネクスト	9	11	23,423			日本エム・ディ・エム	8	—	—		
日産自動車	800	917	384,608			島津製作所	78	105	411,595		
いすゞ自動車	172	226	446,909			J M S	12	14	6,949		
トヨタ自動車	3,255	3,902	10,578,810			長野計器	4	4	9,609		
日野自動車	89	110	53,212			ブイ・テクノロジー	3	3	8,420		
三菱自動車工業	231	280	113,571			東京計器	4	5	17,498		
エフテック	1	—	—			愛知時計電機	2	2	4,865		
武藏精密工業	14	18	48,816			インターラクション	4	6	7,265		
日産車体	6	11	11,502			東京精密	12	15	135,510		
新明和工業	17	21	29,107			マニー	23	29	40,821		
極東開発工業	9	9	24,552			ニコン	85	115	178,389		
トピー工業	4	5	12,437			トプコン	28	41	118,031		
ティラド	1	1	6,830			オリンパス	364	420	841,020		
タチエス	10	13	23,868			理研計器	4	10	30,014		
NOK	23	28	65,849			タムロン	3	10	38,329		
フタバ産業	15	22	16,685			H O Y A	116	143	2,609,880		
カヤバ	5	12	36,537			ノーリツ鋼機	5	7	32,130		
大同メタル工業	11	14	7,171			A & D ホロンホールディングス	8	9	18,676		
プレス工業	23	28	16,215			朝日インテック	72	89	241,336		
ミクニ	3	—	—			シチズン時計	54	67	59,805		
太平洋工業	13	16	23,352			メニコン	20	27	37,455		
アイシン	45	155	268,237			松風	2	7	16,228		
マツダ	196	225	224,598			セイコーブループ	8	11	55,404		
今仙電機製作所	2	—	—			ニプロ	49	61	80,325		
本田技研工業	1,445	1,739	2,377,163			その他製品(3.2%)					
スズキ	108	593	1,153,375			三井松島ホールディングス	5	5	20,975		
S U B A R U	183	221	587,817			スノーピーク	8	—	—		
ヤマハ発動機	256	310	372,775			パラマウントベッドホールディングス	12	15	41,664		
エクセディ	9	12	56,580			トランザクション	3	4	10,060		

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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額			株数	株数	評価額	
ニホンフラッシュ	千株	千株	千円		関西電力	千株	千株	千円	
前田工織	6	8	6,888		中国電力	228	358	613,067	
アートネイチャー	5	15	27,045		北陸電力	103	127	107,311	
フルヤ金属	7	9	6,879		東北電力	60	75	58,232	
パンダynamコホールディングス	1	6	18,389		四国電力	156	193	202,771	
S H O E I	162	199	967,003		九州電力	55	68	77,223	
フランスペッドホールディングス	13	20	39,552		北海道電力	136	169	214,799	
パイロットコーポレーション	7	10	13,335		沖縄電力	57	76	55,288	
萩原工業	8	11	47,252		電源開発	15	18	17,126	
フジシールインターナショナル	—	4	7,350		エフオン	48	55	137,309	
タカラトミー	12	16	45,540		イーレックス	14	—	—	
広済堂ホールディングス	27	30	117,779		レノバ	10	14	11,082	
プロネクサス	15	27	13,573		東京瓦斯	15	20	14,480	
TOPPANホールディングス	64	152	325,784		大阪瓦斯	125	138	660,191	
大日本印刷	72	96	442,691		東邦瓦斯	64	120	479,609	
共同印刷	1	2	8,977		北海道瓦斯	25	28	116,438	
N I S S H A	10	12	17,400		広島ガス	3	22	11,198	
TAKARA & COMPANY	3	4	12,040		西部ガスホールディングス	1	19	6,930	
アシックス	50	271	964,844		静岡ガス	6	7	12,620	
ツツミ	3	—	—		メタウォーター	11	16	16,883	
ローランド	4	5	19,953		陸運業(2.3%)	7	10	19,735	
小松ウォール工業	2	4	7,340		S B S ホールディングス	5	6	18,310	
ヤマハ	37	131	140,843		東武鉄道	65	77	199,047	
河合楽器製作所	1	2	7,018		相鉄ホールディングス	21	24	58,502	
クリナップ	7	10	6,825		東急	166	205	346,014	
ピジョン	37	46	77,149		京浜急行電鉄	73	90	139,077	
キングジム	7	8	6,893		小田急電鉄	98	121	177,244	
リンテック	11	13	39,726		京王電鉄	28	38	151,087	
イトーキ	12	14	25,754		京成電鉄	38	127	188,696	
任天堂	374	463	5,325,615		富士急行	7	9	21,123	
三菱鉛筆	8	10	26,421		東日本旅客鉄道	108	404	1,149,713	
タカラスタンダード	12	16	29,355		西日本旅客鉄道	70	181	530,782	
コクヨ	24	35	101,850		東海旅客鉄道	228	282	815,736	
ナカバヤシ	11	3	1,742		東京地下鉄	—	122	216,742	
グローブライド	5	7	13,665		西武ホールディングス	71	79	247,530	
オカムラ	17	22	43,979		鴻池運輸	10	12	36,550	
美津濃	5	7	60,517		西日本鉄道	15	21	46,067	
電気・ガス業(1.2%)					ハマキヨウレックス	5	25	31,400	
グリムス	3	3	7,227		サカイ引越センター	6	9	21,436	
東京電力ホールディングス	534	617	242,138		近畿グループホールディングス	59	78	258,500	
中部電力	218	270	426,172		阪急阪神ホールディングス	78	97	353,322	

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	千円	千円
南海電気鉄道	26	32	81,406	中央倉庫	2	3	4,817				
京阪ホールディングス	32	40	135,905	安田倉庫	5	5	8,925				
神戸電鉄	2	2	5,618	上組	27	33	110,796				
名古屋鉄道	61	81	145,800	キユーソー流通システム	6	4	9,466				
山陽電気鉄道	4	5	11,082	エーアイテイー	3	4	7,626				
アルプラス物流	4	—	—	内外トランスライン	2	2	7,090				
ヤマトホールディングス	75	89	178,333	日本コンセプト	3	3	7,026				
山九	15	17	102,872	情報・通信業(7.8%)							
丸全昭和運輸	3	4	26,055	N E C ネッツエスアイ	23	28	94,710				
センコーグループホールディングス	31	48	68,203	クロスキャット	5	6	6,792				
トナミホールディングス	1	1	9,552	システナ	90	105	36,294				
ニッコンホールディングス	18	41	95,826	デジタルアーツ	3	4	30,550				
福山通運	6	7	28,782	日鉄ソリューションズ	10	25	103,487				
セイノーホールディングス	33	36	80,611	キューブシステム	5	6	6,847				
神奈川中央交通	2	2	8,200	コア	3	3	6,793				
A Z - COM丸和ホールディングス	15	22	27,830	ラクーンホールディングス	9	7	6,745				
C & F ロジホールディングス	5	—	—	ソリトンシステムズ	4	—	—				
九州旅客鉄道	41	56	200,838	ソフトクリエイトホールディングス	4	5	10,817				
S G ホールディングス	99	123	177,202	T I S	65	77	296,418				
NIPPON EXPRESSホールディングス	20	78	210,041	グリーホールディングス	19	24	13,980				
海運業(0.7%)				GMOペパボ	—	4	7,080				
日本郵船	169	151	798,538	コーポレートモホールディングス	37	55	111,935				
商船三井	128	139	767,257	三菱総合研究所	2	3	16,310				
川崎汽船	47	166	354,783	ファインデックス	—	8	6,349				
N S ユナイテッド海運	3	4	18,676	ブレインパッド	—	5	7,023				
明海グループ	2	—	—	ポールトウインホールディングス	12	15	7,037				
飯野海運	21	26	28,002	ネクソン	133	161	327,038				
共栄タンカー	0.600	—	—	アイスタイル	19	22	11,155				
乾汽船	6	9	13,258	エムアップホールディングス	7	9	13,977				
空運業(0.4%)				エイチーム	11	7	6,830				
日本航空	145	168	439,992	セルシス	—	10	13,146				
ANAホールディングス	161	199	578,559	エニグモ	17	20	6,895				
パスコ	0.400	—	—	コロプラ	23	25	12,225				
倉庫・運輸関連業(0.1%)				ブロードリーフ	28	29	19,151				
トランコム	1	—	—	デジタルハーツホールディングス	6	6	6,739				
日新	4	5	21,625	メディアドゥ	4	4	7,303				
三菱倉庫	14	74	76,614	じげん	17	18	8,188				
三井倉庫ホールディングス	5	7	55,800	ブイキューブ	20	—	—				
住友倉庫	16	21	59,339	フィックススターズ	6	7	13,823				
澁澤倉庫	2	3	10,296	CARTA HOLDINGS	0.200	4	6,647				
日本トランシスティ	11	14	13,920	オプティム	6	10	7,150				

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
セレス	5	3	9,038			ビジョナル	4	8	65,223		
S H I F T	4	73	100,191			ハイマックス	4	5	6,941		
ティーガイア	6	—	—			野村総合研究所	131	159	823,695		
テクマトリックス	10	15	35,186			日本システム技術	2	6	13,872		
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15	18	56,144			インテージホールディングス	6	4	7,224		
GMOペイメントゲートウェイ	11	16	134,383			ソースネクスト	42	37	8,234		
システムリサーチ	2	5	8,405			インフォコム	7	—	—		
インターネットイニシアティブ	28	40	103,515			シングレックス・ホールディングス	9	14	40,585		
さくらインターネット	6	11	49,795			H E R O Z	3	—	—		
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2	3	6,717			ラクスル	14	17	22,250		
S R A ホールディングス	3	4	18,123			メルカリ	28	40	91,471		
朝日ネット	10	10	6,921			イーソル	10	—	—		
e B A S E	9	11	6,925			ウイングアーク 1 s t	6	7	27,681		
アバントグループ	7	10	19,683			ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	3	3,049		
アドソル臼進	4	3	7,068			サーバーワークス	1	—	—		
コムチュア	8	9	18,730			S a n s a n	19	20	49,608		
アステリア	10	11	6,840			ギフティ	5	6	9,990		
アイル	2	4	9,963			メドレー	8	8	24,000		
マークライズ	3	4	10,780			ベース	2	3	11,880		
メディカル・データ・ビジョン	9	—	—			J M D C	10	9	28,575		
g u m i	15	13	7,670			フォーカスシステムズ	6	6	6,766		
テラスカイ	4	2	6,683			クレスコ	4	12	13,527		
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3	4	10,922			フジ・メディア・ホールディングス	57	70	193,223		
ネオジャパン	—	4	6,719			オービック	19	136	602,983		
P R T I M E S	—	3	6,951			ジャストシステム	8	10	39,379		
ラクス	28	34	74,715			T D C ソフト	5	12	16,802		
ダブルスタンダード	3	4	6,520			L I N E ヤフー	846	1,178	564,711		
オープンドア	7	11	7,084			トレンドマイクロ	28	38	444,276		
アカツキ	2	3	10,569			I Dホールディングス	4	5	9,465		
Ubicomホールディングス	4	4	6,816			日本オラクル	11	14	206,001		
カナミックネットワーク	15	15	7,338			アルファシステムズ	2	2	7,613		
チェンジホールディングス	12	18	24,315			フューチャー	12	18	32,683		
オーネット	3	3	8,238			CAC Holdings	3	4	8,977		
マクロミル	11	14	18,081			S Bテクノロジー	2	—	—		
オロ	2	3	8,134			オービックビジネスコンサルタント	8	12	90,978		
ユーザーローカル	—	3	6,487			アイティフォー	7	8	10,990		
PKSHA Technology	—	5	24,042			東計電算	—	2	9,261		
マネーフォワード	13	18	80,345			大塚商会	29	83	290,246		
プラスアルファ・コンサルティング	3	9	13,754			サイボウズ	8	10	31,209		
電算システムホールディングス	2	3	7,933			電通総研	7	7	44,280		
APP I E R G R O U P	20	22	39,150			A C C E S S	8	7	8,023		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	株数	千円
デジタルガレージ	9	11	54,280	スカウェア・エニックス・ホールディングス	27	37	265,512				
イーエムシステムズ	9	11	9,280	シーイーシー	7	9	17,242				
ウェザーニューズ	1	5	21,092	カプコン	53	146	567,936				
C I J	9	20	9,534	アイ・エス・ビー	4	5	6,655				
ビジネスエンジニアリング	—	1	7,092	ジャステック	4	—	—				
WOWOW	5	6	6,927	S C S K	41	60	217,802				
スカラ	8	17	7,221	N S W	2	3	9,431				
ANY COLOR	6	10	31,300	アイネス	4	5	10,037				
I M A G I C A G R O U P	—	13	6,686	T K C	9	13	49,976				
ネットワンシステムズ	24	8	39,432	富士ソフト	12	20	199,818				
アルゴグラフィックス	5	6	35,088	N S D	21	28	97,153				
マーベラス	9	13	7,000	コナミグループ	22	27	515,016				
エイベックス	10	13	17,512	福井コンピュータホールディングス	3	5	15,402				
B I P R O G Y	19	24	107,094	J B C C ホールディングス	3	4	23,250				
都築電気	3	4	10,617	ミロク情報サービス	5	6	12,247				
T B S ホールディングス	29	36	158,303	ソフトバンクグループ	293	363	3,432,603				
日本テレビホールディングス	52	65	184,027	卸売業(6.1%)							
朝日放送グループホールディングス	9	0.100	68	リョーサン菱洋ホールディングス	—	11	30,761				
テレビ朝日ホールディングス	14	17	45,949	高千穂交易	2	3	12,493				
スカパーＪＳＡＴホールディングス	46	57	62,233	伊藤忠食品	1	1	13,320				
テレビ東京ホールディングス	4	4	15,772	エレマテック	5	—	—				
ビジョン	9	11	12,853	あらた	9	11	37,663				
U-NEXT HOLDINGS	6	24	44,739	トーメンデバイス	1	1	6,710				
日本通信	58	59	9,531	東京エレクトロン デバイス	6	7	24,909				
日本電信電話	17,686	21,902	3,197,808	円谷フィールズホールディングス	10	12	19,618				
K D D I	459	541	2,638,133	双日	69	86	280,692				
ソフトバンク	956	11,787	2,482,342	アルフレッサ ホールディングス	63	72	145,089				
光通信	6	8	312,800	横浜冷凍	17	19	17,082				
エムティーアイ	10	—	—	アルコニックス	8	11	16,461				
GMOインターネットグループ	22	24	68,592	神戸物産	48	60	191,057				
K A D O K A W A	31	38	143,074	ハイパー	4	—	—				
学研ホールディングス	9	13	13,324	あい ホールディングス	10	14	27,636				
ゼンリン	10	12	12,398	ディーブイエックス	4	—	—				
アイネット	3	4	8,734	ダイワボウホールディングス	27	34	90,609				
松竹	3	4	48,552	マクニカホールディングス	14	60	110,798				
東宝	33	46	328,185	ラクト・ジャパン	2	3	9,490				
東映	2	12	63,684	パイタルケースター・ホールディングス	9	10	12,326				
N T T データグループ	155	192	570,666	八洲電機	5	6	10,980				
ピー・シー・エー	5	4	9,369	メディアスホールディングス	8	—	—				
ビジネスブレイン太田昭和	2	3	7,932	レスター	5	6	15,787				
D T S	12	12	54,567	TOKA I ホールディングス	34	42	39,457				

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
三洋貿易	7	8	11,424			長瀬産業	28	34	94,765		
ビューティガレージ	2	4	6,757			蝶理	3	4	12,915		
ワイン・パートナーズ	5	5	7,307			豊田通商	54	233	561,319		
シップヘルスケアホールディングス	22	30	60,632			三共生興	8	11	7,256		
明治電機工業	4	4	6,582			兼松	26	32	80,112		
コメダホールディングス	15	20	54,424			三井物産	472	1,141	3,104,906		
アセンテック	10	—	—			日本紙パルプ商事	3	37	22,074		
フルサト・マルカホールディングス	5	6	13,999			カメイ	6	8	15,869		
ヤマエグループホールディングス	3	8	18,480			OUGホールディングス	1	—	—		
小野建	6	8	12,537			スターゼン	4	5	15,600		
南陽	1	—	—			山善	19	26	33,326		
佐鳥電機	3	4	8,075			椿本興業	1	4	9,073		
伯東	3	4	19,844			住友商事	379	465	1,502,634		
コンドーテック	5	6	7,872			内田洋行	2	3	21,421		
中山福	0.100	—	—			三菱商事	1,242	1,435	3,401,173		
ナガイレーベン	7	9	17,581			第一実業	5	7	17,374		
三菱食品	5	7	33,840			キヤノンマーケティングジャパン	14	15	76,243		
松田産業	4	5	18,555			西華産業	2	3	16,280		
第一興商	24	30	48,205			佐藤商事	4	5	7,954		
メディパルホールディングス	63	84	188,536			菱洋エレクトロ	5	—	—		
S P K	3	3	6,982			東京産業	8	9	6,805		
萩原電気ホールディングス	2	3	11,154			ユアサ商事	4	6	30,116		
アズワン	9	24	58,273			神鋼商事	1	1	10,064		
スズデン	2	3	7,038			阪和興業	11	12	63,360		
シモジマ	4	5	6,884			正栄食品工業	4	5	19,630		
ドウシシャ	5	7	14,853			カナデン	4	5	8,514		
小津産業	2	—	—			R Y O D E N	5	6	15,050		
高速	3	4	9,641			岩谷産業	14	77	120,895		
丸文	5	6	7,072			ナイス	2	—	—		
ハピネット	5	5	28,585			極東貿易	3	4	7,654		
橋本総業ホールディングス	4	5	6,960			アステナホールディングス	13	15	6,817		
日本ライフライン	18	20	32,739			三愛オブリ	15	18	32,013		
タカシヨー	—	17	6,811			稻畑産業	12	21	65,100		
I DOM	16	26	29,832			G S I クレオス	3	4	8,736		
進和	3	4	13,160			明和産業	9	11	7,914		
ダイトロン	2	3	11,067			ワキタ	10	11	19,277		
シーカス	8	11	11,688			東邦ホールディングス	17	21	87,570		
オーハシテクニカ	3	3	6,829			サンゲツ	14	19	56,608		
白鈴	2	3	6,924			ミツウロコグループホールディングス	8	9	18,037		
伊藤忠商事	421	522	3,187,508			シナネンホールディングス	1	2	12,621		
丸紅	523	638	1,444,472			伊藤忠エネクス	15	19	30,725		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
サンリオ	17	63	436,462			アダストリア	7	10	32,367		
サンワ テクノス	3	3	7,542			くら寿司	7	9	28,119		
リョーサン	4	—	—			キャンドゥ	2	2	9,282		
新光商事	8	10	10,212			パルグループホールディングス	12	17	57,494		
トーホー	2	3	8,741			エディオン	24	33	58,203		
三信電気	2	3	6,619			サーラコーポレーション	13	16	12,632		
東陽テクニカ	6	7	10,123			ハローズ	2	3	12,214		
モスフードサービス	9	11	40,527			フジオフードグループ本社	7	9	11,252		
加賀電子	5	15	42,470			あみやき亭	1	5	8,741		
ソーダニッカ	5	7	8,451			大黒天物産	1	2	19,572		
立花エレテック	4	4	11,509			ハニーズホールディングス	5	6	11,274		
P A L T A C	8	12	47,444			アルペン	5	7	16,447		
三谷産業	17	20	6,831			クオールホールディングス	8	9	15,081		
西B Wismettacホールディングス	1	3	6,342			ジンズホールディングス	3	5	40,769		
コーナー商事ホールディングス	—	9	6,802			ビックカメラ	33	46	74,888		
K P P グループホールディングス	16	16	11,012			D C M ホールディングス	33	40	54,672		
ヤマタネ	2	3	11,888			M o n o t a R O	88	110	278,167		
泉州電業	2	5	25,296			東京一番フーズ	8	—	—		
トラスコ中山	13	16	31,899			J. フロント リテイリング	72	89	174,725		
オートバックスセブン	21	27	39,663			ドトール・日レスホールディングス	11	13	32,361		
モリト	4	6	9,300			マツキヨココカラ&カンパニー	114	136	320,688		
加藤産業	7	9	41,280			ブロンコビリー	3	4	16,123		
イエローハット	10	13	39,401			Z O Z O	40	57	270,959		
J K ホールディングス	5	6	6,786			トレジャー・ファクトリー	4	5	7,828		
日伝	4	4	12,946			物語コーポレーション	10	15	47,942		
北沢産業	10	—	—			三越伊勢丹ホールディングス	105	116	267,030		
杉本商事	3	6	8,376			H a m e e	5	5	6,715		
因幡電機産業	16	21	83,783			ウエルシアホールディングス	32	40	89,768		
東テク	2	7	19,344			クリエイト S D ホールディングス	8	11	30,866		
ミスミグループ本社	94	117	289,508			丸善C H I ホールディングス	12	—	—		
スズケン	23	25	127,795			ミサワ	2	—	—		
ジェコス	5	6	6,922			シュッピン	6	7	7,660		
小売業(4.5%)						オイシックス・ラ・大地	8	12	16,662		
インターメスティック	—	4	8,113			ネクステージ	14	17	25,735		
ローソン	13	—	—			ジョイフル本田	18	21	41,083		
サンエー	4	13	39,204			エターナルホスピタリティグループ	2	2	7,316		
カワチ薬品	4	6	16,030			ホットランド	4	5	12,230		
エービーシー・マート	27	34	100,368			すかいらーくホールディングス	85	106	264,703		
ハードオフコーポレーション	3	3	6,778			S F P ホールディングス	3	4	9,442		
アスクル	15	18	29,955			綿半ホールディングス	4	6	9,792		
ゲオホールディングス	7	8	15,120			ヨシックスホールディングス	—	2	7,246		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17	33	25,630			魚力	2	2	6,983		
B E E N O S	4	4	19,477			フジ・コーポレーション	3	3	6,789		
あさひ	5	6	9,392			ユナイテッドアローズ	7	8	18,094		
日本調剤	4	5	6,987			ハイディ日高	9	12	33,944		
コスマス薬品	5	15	104,581			コロワイド	27	43	74,722		
セブン&アイ・ホールディングス	216	858	2,059,440			壱番屋	5	30	28,888		
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	42	58	73,876			スギホールディングス	12	41	113,757		
ツルハホールディングス	13	13	126,684			葉王堂ホールディングス	3	3	7,052		
サンマルクホールディングス	5	6	14,023			スクワール	9	11	11,994		
フェリシモ	4	—	—			ヨンドシーホールディングス	5	7	13,271		
トリドールホールディングス	17	21	81,248			木曽路	9	11	25,452		
TOKYO BASE	19	20	6,789			S R S ホールディングス	10	12	15,782		
J M ホールディングス	4	5	12,527			リテールパートナーズ	9	11	13,972		
アレンザホールディングス	5	6	6,885			上新電機	6	7	16,701		
串カツ田中ホールディングス	—	5	6,936			日本瓦斯	33	37	82,193		
パロックジャパンリミテッド	7	9	7,052			ロイヤルホールディングス	11	13	32,332		
クスリのアオキホールディングス	18	20	63,266			いなげや	6	—	—		
力の源ホールディングス	4	5	7,975			チヨダ	7	7	8,228		
FOOD & LIFE COMPANIES	33	41	173,341			ライフコーポレーション	6	8	29,038		
メディカルシステムネットワーク	10	16	6,837			リングガーハット	8	10	22,500		
はるやまホールディングス	5	—	—			M r Ma x HD	10	10	6,956		
ノジマ	18	25	57,684			AOKIホールディングス	13	16	20,925		
カッパ・クリエイト	9	12	17,677			オーツワ	9	12	9,610		
ライトオン	6	—	—			コメリ	9	10	29,589		
良品計画	68	92	362,600			青山商事	13	16	34,660		
アドヴァングループ	6	7	6,679			しまむら	14	18	162,871		
アルビス	2	2	7,092			高島屋	43	107	133,796		
ハウス オブ ローゼ	0.400	—	—			松屋	10	13	13,556		
G-7ホールディングス	6	8	10,812			エイチ・ツー・オー リテイリング	27	37	85,730		
イオン北海道	18	19	16,177			近鉄百貨店	2	4	9,279		
コジマ	10	15	15,000			丸井グループ	41	51	133,257		
ヒマラヤ	0.400	—	—			アクシアル リテイリング	4	21	20,161		
コーナン商事	7	8	30,788			イオン	212	287	1,041,462		
エコス	2	3	6,968			イズミ	11	11	35,376		
ワタミ	6	9	9,588			平和堂	10	12	29,654		
ル・ル・ワイヤー・インターナショナルホールディングス	126	156	637,484			フジ	9	14	28,900		
西松屋チェーン	12	17	37,891			ヤオコー	7	9	83,490		
ゼンショーホールディングス	31	44	337,673			ゼビオホールディングス	8	10	12,894		
幸楽苑	—	6	7,316			ケーズホールディングス	42	52	72,453		
サイゼリヤ	9	11	51,060			日産東京販売ホールディングス	4	—	—		
V T ホールディングス	23	30	14,877			シルバーライフ	—	4	3,192		

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
Genky DrugStores	2	6	19,536			第四北越フィナンシャルグループ	9	22	63,673		
ナルミヤ・インターナショナル	3	—	—			ひろぎんホールディングス	83	101	121,531		
ブックオフグループホールディングス	—	5	7,431			おきなわフィナンシャルグループ	5	5	14,398		
ギフトホールディングス	2	3	14,250			十六フィナンシャルグループ	7	10	46,716		
アインホールディングス	8	7	34,476			北國フィナンシャルホールディングス	6	7	37,914		
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	3	4	13,926			プロクレアホールディングス	6	8	14,574		
ヤマダホールディングス	192	238	103,419			あいちフィナンシャルグループ	9	13	37,624		
アークランズ	18	23	37,306			あおぞら銀行	42	49	109,480		
ニトリホールディングス	22	28	443,178			三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,555	4,638	9,149,441		
愛眼	1	—	—			りそなホールディングス	680	893	1,111,016		
ケーユーホールディングス	5	6	6,851			三井住友トラストグループ	209	257	1,007,082		
吉野家ホールディングス	23	30	88,616			三井住友フィナンシャルグループ	415	1,508	5,908,794		
松屋フーズホールディングス	3	3	21,238			千葉銀行	162	223	300,809		
サガミホールディングス	9	12	22,112			群馬銀行	113	125	132,068		
関西フードマーケット	4	—	—			武蔵野銀行	8	11	35,090		
王将フードサービス	4	15	46,053			千葉興業銀行	11	17	26,077		
ミニストップ	4	6	11,089			筑波銀行	—	31	7,956		
アーツ	11	13	35,186			七十七銀行	17	23	104,028		
バローホールディングス	12	14	32,944			秋田銀行	3	4	10,848		
ベルク	3	3	24,765			山形銀行	6	8	11,344		
大 庄	4	6	6,867			岩手銀行	3	4	14,398		
ファーストリテイリング	28	43	2,077,061			東邦銀行	46	62	19,718		
サンドラッグ	21	26	112,660			ふくおかフィナンシャルグループ	50	63	252,693		
サックスパー ホールディングス	7	—	—			スルガ銀行	51	48	64,722		
ヤマザワ	3	—	—			八十二銀行	125	169	165,473		
ベルーナ	15	18	17,017			山梨中央銀行	6	8	16,799		
銀行業(9.3%)						大垣共立銀行	11	13	30,718		
いよぎんホールディングス	69	94	150,573			福井銀行	5	6	12,148		
しづおかフィナンシャルグループ	129	159	245,322			清水銀行	4	2	3,171		
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	49	60	95,856			富山銀行	1	—	—		
楽天銀行	20	33	196,310			滋賀銀行	9	10	52,320		
京都フィナンシャルグループ	74	91	194,148			南都銀行	8	10	38,913		
じもとホールディングス	2	—	—			百五銀行	54	68	48,280		
めぶきフィナンシャルグループ	289	363	228,000			紀陽銀行	20	25	57,135		
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7	9	47,988			ほくほくフィナンシャルグループ	36	40	87,505		
九州フィナンシャルグループ	113	127	95,501			山陰合同銀行	36	45	57,032		
ゆうちょ銀行	641	595	915,004			百十四銀行	5	7	23,714		
富山第一銀行	18	23	23,230			四国銀行	8	10	12,529		
コンコルディア・フィナンシャルグループ	313	384	351,269			阿波銀行	8	10	27,966		
西日本フィナンシャルホールディングス	32	44	90,468			大分銀行	3	4	14,512		
三十三フィナンシャルグループ	5	6	15,320			宮崎銀行	3	4	15,486		

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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
佐賀銀行	千株	千株	千円	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	千株	千株	千円	千株	千円
琉球銀行	3	4	9,349	第一生命ホールディングス	130	529	1,612,485	285	340
セブン銀行	12	16	19,090	東京海上ホールディングス	577	706	3,581,538	706	1,532,720
みずほフィナンシャルグループ	183	259	78,062	T & Dホールディングス	156	194	613,477	194	4,255,360
山口フィナンシャルグループ	788	976	4,255,360	アドバンスクリエイト	3	5	3,051	5	118,048
名古屋銀行	57	70	33,660	その他金融業(1.1%)					
北洋銀行	3	4	33,660	全国保証	15	18	103,269	15	50,088
大光銀行	88	98	50,088	ジェイリース	1	5	7,101	1	—
愛媛銀行	1	—	—	イントラスト	0.100	—	—	0.100	7
京葉銀行	7	10	11,691	S B I アルヒ	7	7	5,971	7	26,845
栃木銀行	24	32	26,845	プレミアグループ	9	12	27,218	9	9,996
北日本銀行	29	33	9,996	ネットプロテクションズホールディングス	34	24	11,809	34	8,800
東和銀行	2	2	8,800	クレディセゾン	37	45	164,193	37	8,684
トモニホールディングス	10	13	8,684	芙蓉総合リース	37	6	74,437	5	34,638
フィデアホールディングス	55	69	34,638	みずほリース	9	54	55,494	9	11,490
池田泉州ホールディングス	6	7	11,490	東京センチュリー	43	54	77,139	43	41,825
証券、商品先物取引業(1.0%)	81	100	41,825	日本証券金融	21	26	47,720	21	21,220,864
F P G	19	25	62,924	アイフル	86	119	41,775	86	529,969
ジャパンインベストメントアドバイザー	9	11	20,545	リコーリース	5	6	36,225	5	49,256
マーキュリアホールディングス	1	—	—	イオンフィナンシャルサービス	33	41	51,252	33	542,591
S B I ホールディングス	85	116	529,969	アコム	104	172	66,942	104	35,120
ジャフコ グループ	17	21	49,256	ジャックス	19	23	19,092	19	23,834
大和証券グループ本社	452	517	542,591	オリエントコーポレーション	355	433	1,322,913	355	19,241
野村ホールディングス	981	1,216	1,220,864	三菱H Cキャピタル	577	602	363,587	577	42,778
岡三証券グループ	51	57	35,120	日本取引所グループ	152	430	678,855	152	23,834
丸三証券	19	24	23,834	イー・ギャランティ	9	11	20,709	9	12,441
東洋証券	19	21	12,441	NECキャピタルソリューション	2	3	13,510	2	69
東洋証券	69	85	42,778	不動産業(1.8%)					
光世証券	1	—	—	r o b o t h o m e	—	42	7,679	—	17
水戸証券	17	19	10,890	大東建託	21	24	385,073	21	14
いちよし証券	10	14	11,315	いちご	67	61	21,726	67	9
松井証券	28	49	39,939	日本駐車場開発	61	86	17,306	61	70
マネックスグループ	57	70	58,551	S R E ホールディングス	2	2	8,613	2	8
極東証券	8	9	14,670	A Dワークスグループ	20	—	—	20	10
岩井コスモホールディングス	6	8	20,778	ヒューリック	136	168	227,491	136	8
アイザワ証券グループ	8	10	18,740	野村不動産ホールディングス	32	45	184,869	32	6
スパークス・グループ	6	8	12,676	三重交通グループホールディングス	12	15	8,013	12	19
保険業(3.2%)				サムティ	9	—	—	9	240,054
かんぽ生命保険	59	84	240,054	ディア・ライフ	10	12	13,001	10	7,462
F P パートナー	1	3	7,462	コーチアールティー	3	—	—	3	87
S O M P O ホールディングス	87	353	1,510,152	地主	4	6	13,561	4	19
アニコム ホールディングス									

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
プレサンスコーポレーション	9	9	22,924			F Jネクストホールディングス	6	7	8,823		
ハウスコム	4	—	—			グランディハウス	9	11	6,926		
J PMC	5	6	7,006			日本空港ビルディング	20	25	117,734		
サンセイランディック	2	—	—			サービス業(5.0%)					
エストラスト	7	—	—			L I F U L L	32	38	6,400		
フージャースホールディングス	9	11	12,032			M I X I	13	14	50,268		
オープンハウスグループ	21	26	140,155			ジェイエシーリクルートメント	22	27	21,621		
東急不動産ホールディングス	175	217	209,877			日本M&Aセンターホールディングス	97	111	67,754		
飯田グループホールディングス	55	69	154,504			メンバーズ	6	—	—		
And Doホールディングス	5	5	6,805			U Tグループ	7	9	22,618		
シーアールイー	4	3	6,452			アイテイメディア	6	4	6,696		
ケイアイスター不動産	2	3	17,452			ケアネット	9	15	11,257		
グッドコムアセット	8	—	—			E・Jホールディングス	3	4	7,110		
ジェイ・エス・ビー	2	3	9,465			オープンアップグループ	18	25	46,368		
ロードスターキャピタル	3	4	10,172			コシダカホールディングス	18	23	24,909		
霞ヶ関キャピタル	1	3	42,960			パソナグループ	7	9	18,952		
パーク24	37	56	114,689			リンクアンドモチベーション	17	18	10,260		
パラカ	—	3	6,851			エス・エム・エス	21	28	34,992		
三井不動産	270	993	1,258,627			パーソルホールディングス	620	688	157,024		
三菱地所	381	412	889,311			フックパッド	53	—	—		
平和不動産	9	11	55,696			学情	3	3	7,862		
東京建物	51	63	150,416			スタジオアリス	3	3	8,033		
京阪神ビルディング	10	12	17,946			N J S	2	1	8,759		
住友不動産	84	117	586,706			綜合警備保障	101	126	132,531		
テーオーシー	10	12	8,552			カカクコム	40	54	126,044		
東京楽天地	1	—	—			アイロムグループ	—	3	8,382		
レオパレス21	58	63	37,536			セントケア・ホールディング	6	9	6,947		
スターツコーポレーション	8	11	47,600			ルネサンス	6	—	—		
フジ住宅	8	9	6,742			ディップ	9	13	29,132		
空港施設	10	11	6,925			デジタルホールディングス	—	4	7,035		
明和地所	—	6	6,910			新日本科学	5	8	12,576		
ゴールドクレスト	4	4	14,896			ベネフィット・ワン	21	—	—		
エスリード	2	3	14,943			エムスリー	120	149	291,089		
日神グループホールディングス	12	12	6,835			アウトソーシング	39	—	—		
日本エスコン	10	18	19,315			ワールドホールディングス	2	3	6,897		
MIRARTHホールディングス	26	42	21,454			ディー・エヌ・エー	21	30	106,726		
AVANTIA	3	—	—			博報堂DYホールディングス	77	85	90,136		
イオンモール	30	43	83,969			ぐるなび	23	20	7,011		
ファースト住建	1	—	—			ファンコミュニケーションズ	15	17	6,954		
カチタス	15	19	39,964			ライク	4	4	6,967		
トーセイ	9	12	28,992			エスプール	20	23	7,456		
サンフロンティア不動産	8	12	23,400			W D B ホールディングス	3	3	7,000		

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
アドウェイズ	12	24	7,167			ベクトル	7	10	10,042		
バリューコマース	5	9	7,709			チャーム・ケア・コーポレーション	5	6	8,064		
インフォマート	63	71	29,405			キャリアリンク	2	2	6,454		
J P ホールディングス	15	19	10,306			I B J	9	10	7,207		
プレステージ・インターナショナル	28	35	25,063			アサンテ	3	4	6,900		
プロトコーゴレーション	6	8	17,577			バリューH R	5	6	9,764		
アミューズ	4	4	7,107			M&Aキャピタルパートナーズ	4	6	18,208		
ドリームインキュベータ	2	1	7,200			ライドオンエクスプレスホールディングス	6	6	7,072		
ワイック	4	5	9,843			シグマクシス・ホールディングス	8	22	21,296		
電通グループ	59	80	246,119			ウィルグループ	5	6	6,865		
ぴあ	2	2	8,242			メドピア	9	—	—		
イオンファンタジー	2	3	9,880			リクルートホールディングス	451	588	5,815,387		
シーティーエス	9	10	8,528			エラン	8	10	7,780		
H. U. グループホールディングス	17	22	57,636			日本郵政	716	845	1,344,872		
アルプス技研	5	6	16,513			ベルシステム24ホールディングス	6	8	10,238		
日本空調サービス	7	8	8,035			鎌倉新書	10	13	6,716		
オリエンタルランド	322	444	1,359,614			エアトリ	4	5	6,336		
ダスキン	13	16	60,555			アトラエ	9	8	6,638		
明光ネットワークジャパン	8	9	7,003			ストライク	2	3	11,858		
ファルコホールディングス	2	3	7,023			ソラスト	16	20	9,817		
ラウンドワン	57	71	84,134			インソース	13	16	16,170		
リゾートトラスト	26	29	90,294			ペイカレント	44	55	371,683		
ビー・エム・エル	7	9	26,439			Orchestra Holdings	6	8	6,994		
リソー教育	31	47	12,980			アイモバイル	14	14	6,824		
早稻田アカデミー	—	4	8,400			ジャパンエレベーター・サービスホールディングス	19	29	88,486		
ユー・エス・エス	68	155	213,167			ミダックホールディングス	3	4	8,675		
東京個別指導学院	14	19	6,860			キューピーネットホールディングス	4	6	6,758		
サイバーエージェント	134	166	194,572			オープングループ	24	—	—		
楽天グループ	522	532	518,717			マネジメントソリューションズ	2	—	—		
クリーク・アンド・リバー社	3	4	7,236			プロレド・パートナーズ	17	16	7,040		
S B I グローバルアセットマネジメント	11	14	10,345			アンビスホールディングス	6	16	11,242		
ティー・オー・ダブリュー	18	21	6,748			カーブスホールディングス	16	20	13,843		
山田コンサルティンググループ	3	3	6,669			フォーラムエンジニアリング	8	8	9,460		
セントラルスポーツ	2	2	7,015			Macbee Planet	—	2	6,930		
フルキャストホールディングス	5	6	10,031			ダイレクトマーケティングミックス	14	25	7,467		
エン・ジャパン	9	12	20,651			ポピンズ	5	—	—		
テクノプロ・ホールディングス	35	45	140,454			L I T A L I C O	4	6	7,990		
アイ・アールジャパンホールディングス	4	9	6,826			リログループ	30	42	80,262		
K e e P e r 技研	3	4	18,494			東祥	7	9	6,586		
イー・ガーディアン	4	3	6,966			I D & E ホールディングス	3	5	32,350		
ジャパンマテリアル	18	23	34,881			サンウェルズ	—	12	9,900		

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末)	株数	評価額
	千株	千株	千円
T R E ホールディングス	11	17	26,261
人・夢・技術グループ	3	4	6,471
大栄環境	11	16	45,589
日本管財ホールディングス	6	7	20,247
M&A総研ホールディングス	2	8	11,907
エイチ・アイ・エス	17	24	34,679
ラックランド	2	—	—
共立メンテナンス	9	23	71,621
イチネンホールディングス	6	7	12,373
建設技術研究所	3	7	18,805
スペース	6	6	6,867
燐ホールディングス	5	6	7,604
スバル興業	—	2	9,729
ナガワ	1	2	13,200
東京都競馬	5	5	25,300
カナモト	9	11	35,568
ニシオホールディングス	5	6	26,257
トランス・コスモス	7	9	30,000
乃村工藝社	26	32	29,182
藤田観光	2	3	32,708
トーカイ	5	6	13,634
セコム	62	153	784,792
セントラル警備保障	3	4	12,152
丹青社	11	16	14,048
マイテックグループホールディングス	21	27	82,857
応用地質	5	6	20,434
船井総研ホールディングス	12	15	35,107
学究社	3	3	6,925

銘柄	当期末		
	期首(前期末)	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベネッセホールディングス	20	—	—
イオンディライト	6	8	36,450
ナック	12	10	7,040
ダイセキ	12	18	66,703
ステップ	1	3	6,976
合計	株数・金額	91,102	138,136 286,563,591
	銘柄数<比率>	1,708	1,609 <98.4%>

(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 T O P I X	百万円 5,007	百万円 —

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2025年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 286,563,591	% 98.2
コール・ローン等、その他	5,273,574	1.8
投資信託財産総額	291,837,165	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

(2025年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	291,780,459,183円
コール・ローン等	4,638,560,529
株式(評価額)	286,563,591,300
未収配当金	371,970,044
差入委託証拠金	206,337,310
(B)負債	511,296,167
未払金	9,686,650
未払解約金	501,609,517
(C)純資産総額(A-B)	291,269,163,016
元本	87,962,939,470
次期繰越損益金	203,306,223,546
(D)受益権総口数	87,962,939,470口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,113円

(注1) 期首元本額 71,936,737,810円
期中追加設定元本額 34,833,488,609円
期中一部解約元本額 18,807,286,949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	5,056,152,623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)	2,909,961,878円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	1,695,602円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,050,021,345円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,712,843,045円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	7,033,795,199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)	1,875,300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)	4,278,822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)	8,462,278円
DCニッセイ国内株式インデックス	5,466,408,010円
<購入・換出手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	25,528,690,186円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	5,567,777,230円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2055	496,392,826円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	255,226,405円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2045	566,641,796円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2035	652,057,583円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2025	19,968,230円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	126,939,648円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	15,155,487円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式／リート)	16,151,243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)	5,136,297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)	11,287,809円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	31,016,873円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2060	412,435,105円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2050	280,460,887円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2040	484,713,992円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2030	170,684,612円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(株式機関投資家限定)	22,690,721,624円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	30,778,514円
FWニッセイ国内株式インデックス	79,143,003円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2065	221,277,879円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	44,088,651円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2070	8,855,412円
ニッセイインデックスバランス(外団株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	1,314,716円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)	529,360円

損益の状況

当期 (2024年2月21日～2025年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	5,601,041,469円
受取配当金	5,591,077,390
受取利息	9,388,690
その他の収益金	597,991
支払利息△	22,602
(B)有価証券売買損益	8,964,053,746
売買益	31,612,789,155
売買損△	22,648,735,409
(C)先物取引等損益	196,392,550
取引益	656,286,050
取引損△	459,893,500
(D)信託報酬等△	8,043
(E)当期損益金(A+B+C+D)	14,761,479,722
(F)前期繰越損益金	152,065,851,838
(G)追加信託差損益金	78,469,476,066
(H)解約差損益金△	41,990,584,080
(I)合計(E+F+G+H)	203,306,223,546
次期繰越損益金(I)	203,306,223,546

(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

・TOPIX（東証株価指数）（配当込み）

TOPIX（東証株価指数）の指標値および同指標にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます）の知的財産であり、指標の算出、指標値の公表、利用など同指標に関するすべての権利・ノウハウおよび同指標にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指標の指標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、JPX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JPXは責任を負いません。