

## 第8期末 (2022年11月21日)

基準価額	15,751円
純資産総額	56億円
騰落率	△1.1%
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。



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

**ニッセイアセットマネジメント株式会社**

東京都千代田区丸の内1-6-6

# <購入・換金手数料なし> ニッセイ J P X 日経400 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:2021年11月23日～2022年11月21日

第8期(決算日 2022年11月21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 J P X 日経400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。

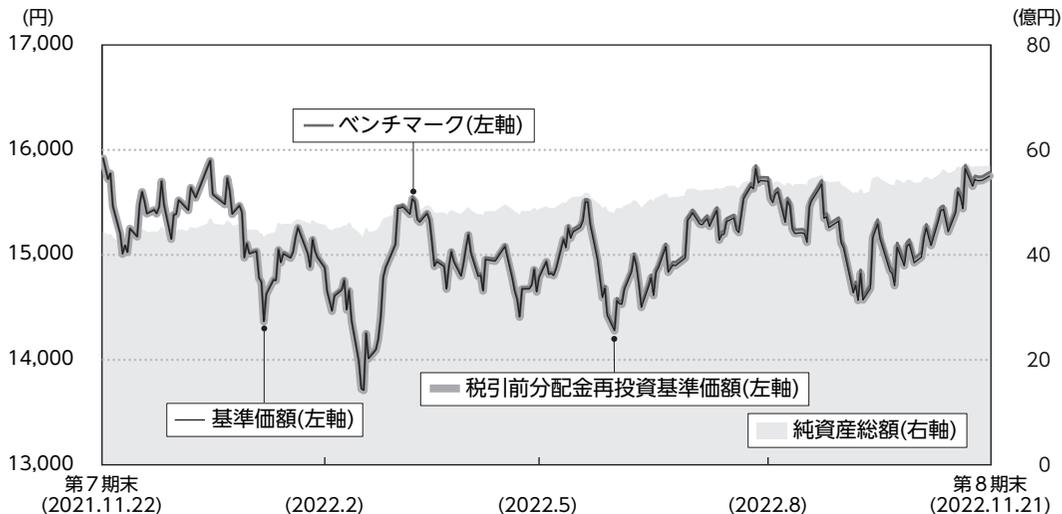
当ファンドは、「ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、J P X 日経インデックス400(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2021年11月23日～2022年11月21日

## 基準価額等の推移



第8期首	15,920円	既払分配金	0円
第8期末	15,751円	騰落率(分配金再投資ベース)	△1.1%

- (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 J P X 日経インデックス400 (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、当期の基準価額は下落しました。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	32円	0.214%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は15,099円です。
(投信会社)	(15)	(0.099)	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)	(13)	(0.088)	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)	(4)	(0.027)	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	0.003	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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)	(0.003)	
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	33	0.218	

(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。

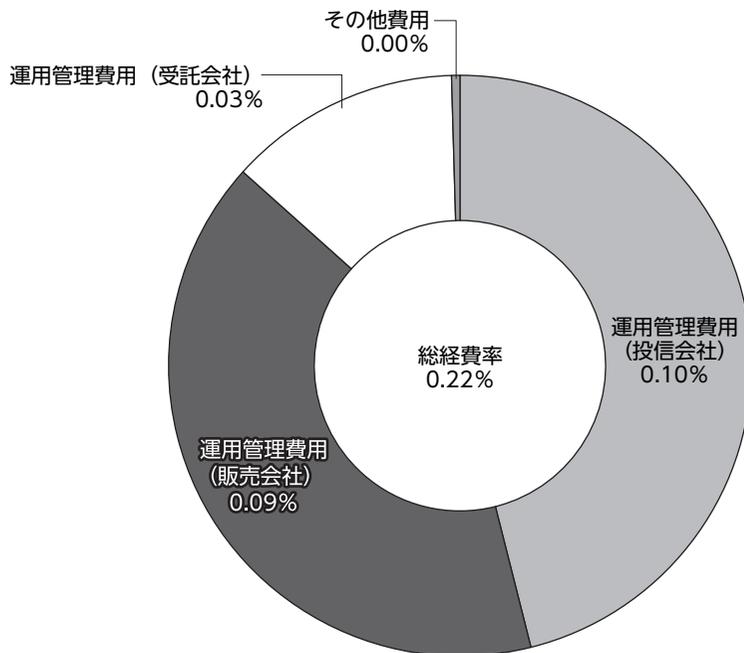
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.22%**です。



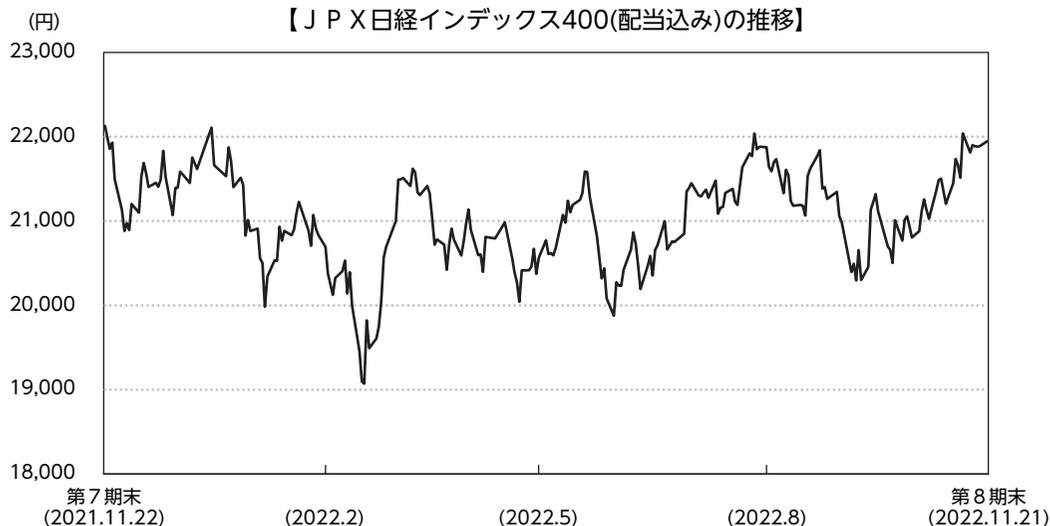
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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) 指数はブルームバーク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若干下落して当期末を迎えました。

期初より新型コロナウイルスの新たな変異型（オミクロン型）の感染拡大への警戒感から下落する場面もありましたが、国内企業の良好な決算発表などから2021年12月末にかけて反発しました。2022年1月から3月上旬にかけては、高水準にあるインフレを沈静化させるために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下落しましたが、その後、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、株価は下落する展開となりました。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や、参院選で自民党が改選議席の過半数を単独で確保し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月から当期末にかけては、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。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

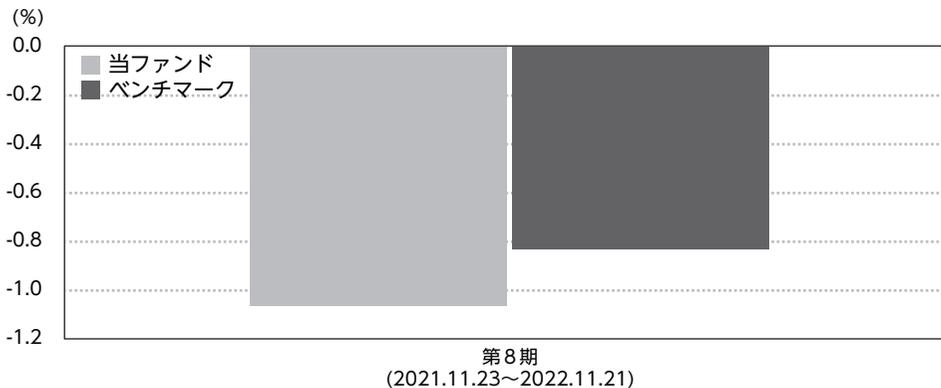
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、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JPX日経インデックス400（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-1.1%となり、ベンチマーク騰落率（-0.8%）におおむね連動しました。

(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 2021年11月23日～2022年11月21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	6,320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に投資を行い、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8期末 2022年11月21日
ニッセイJPX日経400 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。

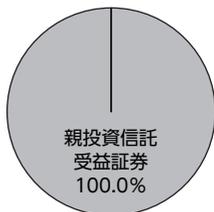
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

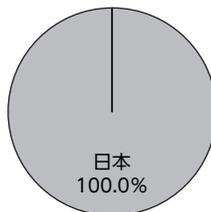
項目	第8期末 2022年11月21日
純資産総額	5,679,488,231円
受益権総口数	3,605,846,432口
1万口当たり基準価額	15,751円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,312,168,410円、同解約元本額は476,653,403円です。

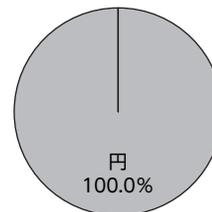
### ■資産別配分



### ■国別配分



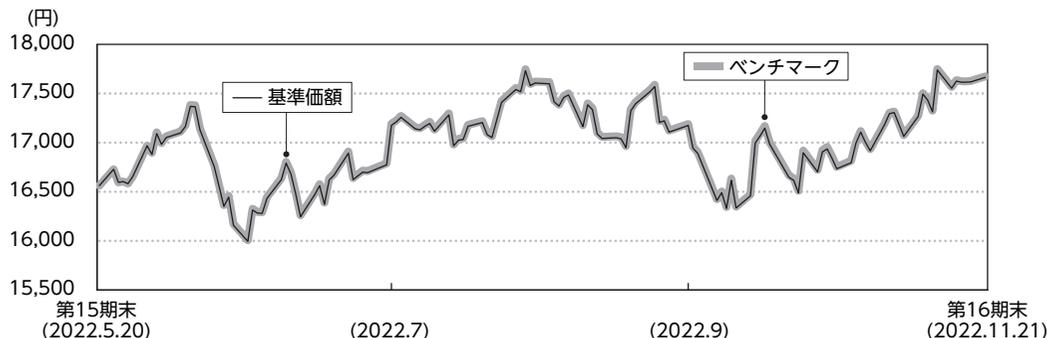
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年11月21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JPX日経400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

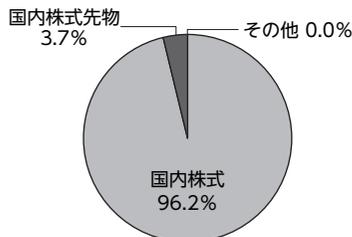
銘柄名	通貨	比率
TOPIX 先物 0412月 買	円	3.7%
第一三共	円	1.9
キーエンス	円	1.7
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
リクルートホールディングス	円	1.5
日立製作所	円	1.5
H O Y A	円	1.4
武田薬品工業	円	1.4
日本電信電話	円	1.4
信越化学工業	円	1.4
組入銘柄数		401

### ■ 1万口当たりの費用明細

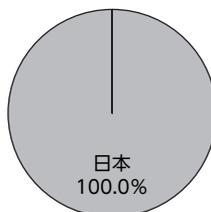
2022.5.21~2022.11.21

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

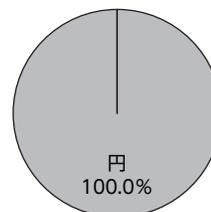
### ■ 資産別配分



### ■ 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(2022年11月21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) 基準価額+ 累計分配金	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	円	%	円		%	%	%	百万円
4期(2018年11月20日)	11,702	0	△ 6.6	11,702	12,046	△ 5.8	94.5	5.3	1,231
5期(2019年11月20日)	12,536	0	7.1	12,536	12,978	7.7	97.0	3.1	1,638
6期(2020年11月20日)	13,251	0	5.7	13,251	13,769	6.1	97.0	2.9	2,476
7期(2021年11月22日)	15,920	0	20.1	15,920	16,584	20.4	96.0	4.0	4,410
8期(2022年11月21日)	15,751	0	△ 1.1	15,751	16,447	△ 0.8	96.2	3.7	5,679

(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) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注5) 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		ベンチ マーク		株式 組入比率	株式 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2021年11月22日	15,920	-	16,584	-	96.0	4.0
11月末	15,007	△5.7	15,650	△5.6	95.9	4.0
12月末	15,544	△2.4	16,202	△2.3	97.0	3.1
2022年1月末	14,761	△7.3	15,389	△7.2	95.7	4.3
2月末	14,664	△7.9	15,292	△7.8	97.1	2.7
3月末	15,335	△3.7	15,993	△3.6	95.2	4.8
4月末	14,955	△6.1	15,598	△5.9	94.3	5.6
5月末	15,068	△5.4	15,724	△5.2	96.1	3.7
6月末	14,708	△7.6	15,349	△7.4	97.5	2.5
7月末	15,273	△4.1	15,945	△3.9	96.7	3.3
8月末	15,466	△2.9	16,147	△2.6	96.3	3.9
9月末	14,571	△8.5	15,215	△8.3	94.2	5.7
10月末	15,326	△3.7	16,005	△3.5	96.1	3.8
(期末)2022年11月21日	15,751	△1.1	16,447	△0.8	96.2	3.7

(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。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ J P X 日経400インデックスファンド

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年11月23日～2022年11月21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 J P X 日経400インデックス マザーファンド	1,171,537	1,978,593	431,738	736,902

(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 J P X 日経400インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,964,613千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,929,488千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.54

(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

2021年11月23日～2022年11月21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

2022年11月21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 J P X 日経400インデックス マザーファンド	2,475,911	3,215,710	5,679,588

(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 J P X 日経400インデックスマザーファンド全体の口数は5,663,082千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド	5,679,588	99.8
コール・ローン等、その他	11,063	0.2
投資信託財産総額	5,690,651	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

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,690,651,619円</b>
コール・ローン等	5,532,319
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド(評価額)	5,679,588,550
未収入金	5,530,750
<b>(B) 負債</b>	<b>11,163,388</b>
未払解約金	5,430,355
未払信託報酬	5,703,876
その他未払費用	29,157
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>5,679,488,231</b>
元本	3,605,846,432
次期繰越損益金	2,073,641,799
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,605,846,432口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>15,751円</b>

(注) 期首元本額 2,770,331,425円  
 期中追加設定元本額 1,312,168,410円  
 期中一部解約元本額 476,653,403円

## 損益の状況

当期(2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 1,024円</b>
受取利息	65
支払利息	△ 1,089
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>51,530,178</b>
売買益	74,090,729
売買損	△ 22,560,551
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 10,587,806</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>40,941,348</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>660,374,889</b>
(分配準備積立金)	(660,374,889)
<b>(F) 追加信託差損益金*</b>	<b>1,372,325,562</b>
(配当等相当額)	(1,494,365,227)
(売買損益相当額)	(△ 122,039,665)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>2,073,641,799</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>2,073,641,799</b>
追加信託差損益金	1,372,325,562
(配当等相当額)	(1,498,789,772)
(売買損益相当額)	(△ 126,464,210)
分配準備積立金	780,328,993
繰越欠損金	△ 79,012,756

(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	119,954,104円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,498,789,772円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	660,374,889円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	2,279,118,765円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	6,320.62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)

## ■関連会社の実質保有比率

2022年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に26.1%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

## 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 J P X 日経400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に投資することにより、J P X 日経インデックス400（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 J P X 日経400 インデックスファンド	ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ J P X 日経400 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
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ J P X 日経400 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 J P X 日経400 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 J P X 日経400インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 16 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

#### 運用方針

主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、J P X 日経インデックス400（配当込み）の動きに連動する成果を目標に運用を行います。

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式

#### 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。



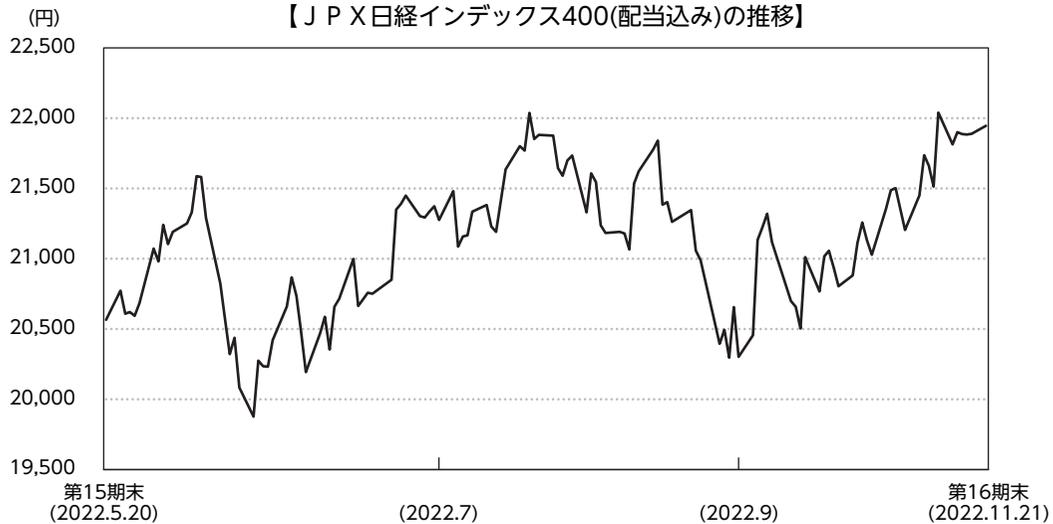
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

## 国内株式市況

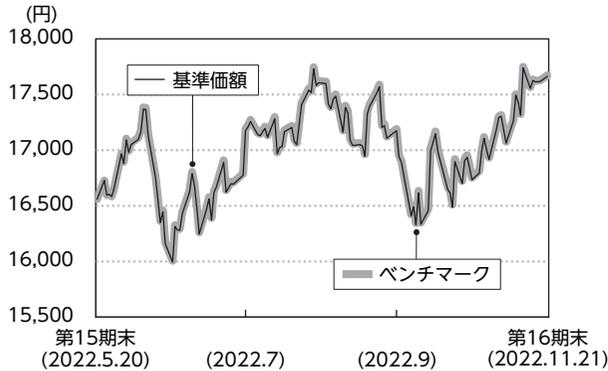


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

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、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（C P I）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や、参院選で自民党が改選議席の過半数を単独で確保し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月から当期末にかけては、米長期金利の上昇懸念がやや緩和し株価は上昇基調で推移しました。

## 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

主に国内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

主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、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+6.7%となり、ベンチマーク騰落率+6.7%に連動しました。

## 今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、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。

## 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	%			%		%	%	百万円
12期(2020年11月20日)	14,795	17.4		15,359	17.5		97.0	2.9	8,431
13期(2021年5月20日)	16,355	10.5		16,970	10.5		97.4	2.6	10,320
14期(2021年11月22日)	17,813	8.9		18,499	9.0		96.0	4.0	11,654
15期(2022年5月20日)	16,560	△	7.0	17,192	△	7.1	96.2	3.7	11,579
16期(2022年11月21日)	17,662	6.7		18,346	6.7		96.2	3.7	10,002

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入比率	株式先物比率
	円	%			%		%	%
(期首)2022年5月20日	16,560	-		17,192	-		96.2	3.7
5月末	16,879	1.9		17,540	2.0		96.1	3.7
6月末	16,479	△	0.5	17,122	△	0.4	97.5	2.5
7月末	17,115	3.4		17,786	3.5		96.7	3.3
8月末	17,334	4.7		18,012	4.8		96.3	3.9
9月末	16,334	△	1.4	16,972	△	1.3	94.2	5.7
10月末	17,184	3.8		17,853	3.8		96.1	3.8
(期末)2022年11月21日	17,662	6.7		18,346	6.7		96.2	3.7

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.001)	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	0.002	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（16,993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5月21日～2022年11月21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
		525 ( 73)	1,387,738	1,239	3,403,110

(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	2,165	2,263	805	805

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21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
ソフトバンク	97	149,854	1,533	オリエンタルランド	6	137,002	20,448
ソフトバンクグループ	15	86,227	5,563	日本電信電話	27	106,613	3,891
日本製鉄	27	60,451	2,222	KDDI	16	70,181	4,332
キーエンス	0.800	42,204	52,756	日立製作所	10	66,409	6,640
リクルートホールディングス	9	40,544	4,406	三菱UFJフィナンシャル・グループ	86	62,233	716
日本電信電話	7	30,653	3,980	ソフトバンクグループ	9	58,227	5,941
信越化学工業	1	27,735	16,314	三菱商事	13	56,321	4,111
JFEホールディングス	15	23,893	1,512	ソニーグループ	5	55,063	10,389
サイバーエージェント	14	19,516	1,374	トヨタ自動車	25	53,080	2,049
第一三共	4	18,637	4,437	東京エレクトロン	1	48,593	40,494

(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

2022年11月21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
<b>水産・農林業(0.0%)</b>				
日本水産	8	6		3,360
<b>鉱業(0.4%)</b>				
INPEX	30	24		36,294
<b>建設業(2.1%)</b>				
ウエストホールディングス	-	0.600		2,748
ショーボンドホールディングス	-	0.900		5,463
ミライト・ワン	2	2		3,489
安藤・間	4	3		3,268
東急建設	2	-		-
コムシスホールディングス	2	2		5,475
東建コーポレーション	0.200	-		-
大成建設	5	4		18,090
大林組	18	16		16,414
清水建設	17	13		9,973
長谷工コーポレーション	5	4		7,073

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
鹿島建設	13	10		15,382
西松建設	1	0.800		3,036
三井住友建設	4	-		-
戸田建設	7	5		3,948
熊谷組	0.900	0.800		1,997
五洋建設	7	6		4,218
住友林業	4	3		8,162
大和ハウス工業	16	12		40,448
積水ハウス	20	14		35,771
関電工	3	2		2,200
エクシオグループ	2	2		4,635
九電工	1	1		3,619
インフロニア・ホールディングス	7	4		5,016
<b>食料品(3.9%)</b>				
森永製菓	1	0.900		3,334
カルビー	2	2		6,041

## ニッセイ J P X 日経400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
森永乳業	1	0.800	3,536
ヤクルト本社	4	3	27,390
明治ホールディングス	3	2	18,704
プリマハム	0.800	0.600	1,234
日本ハム	2	1	6,687
アサヒグループホールディングス	13	10	45,622
キリンホールディングス	22	20	45,208
宝ホールディングス	-	3	3,261
サントリー食品インターナショナル	4	3	14,832
伊藤園	1	-	-
キッコーマン	4	3	23,100
味の素	12	11	47,275
キューピー	3	2	6,217
カゴメ	2	2	6,384
アリアケジャパン	0.600	-	-
ニチレイ	2	2	5,835
東洋水産	2	2	12,903
日清食品ホールディングス	2	1	16,752
日本たばこ産業	33	30	84,409
<b>繊維製品(0.4%)</b>			
帝人	5	4	5,814
東レ	41	31	23,013
ゴールドウイン	1	0.800	7,600
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
王子ホールディングス	24	19	10,262
大王製紙	2	2	2,293
レンゴー	5	4	3,738
<b>化学(7.1%)</b>			
クラレ	8	7	7,962
旭化成	38	29	29,551
昭和電工	5	-	-
住友化学	43	34	17,023
日産化学	3	2	14,454
東ソー	8	6	9,982
トクヤマ	1	1	2,758
デンカ	2	1	5,644
信越化学工業	8	8	139,600
エア・ウォーター	5	4	7,044
日本酸素ホールディングス	5	4	10,291
三菱瓦斯化学	5	3	6,797
三井化学	5	3	12,070

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱ケミカルグループ	39	31	22,648
KHネオケム	-	0.800	2,271
ダイセル	8	6	6,782
積水化学工業	12	9	18,662
日本ゼオン	5	2	3,802
アイカ工業	1	1	3,924
UBE	2	2	4,816
日油	1	1	7,868
花王	13	11	63,042
日本ペイントホールディングス	22	20	22,515
関西ペイント	5	4	8,075
DIC	2	-	-
富士フィルムホールディングス	10	9	66,015
資生堂	11	9	56,683
ライオン	6	5	8,260
ファンケル	2	2	5,298
コーセー	1	0.900	13,131
ポーラ・オルビスホールディングス	2	-	-
小林製薬	1	1	12,096
タカラバイオ	-	1	2,354
デクセリアルズ	-	1	4,270
日東電工	3	3	29,376
エフピコ	1	0.900	3,415
ニフコ	2	1	6,154
ユニ・チャーム	11	9	49,353
<b>医薬品(7.4%)</b>			
協和キリン	6	5	18,312
武田薬品工業	45	35	142,092
アステラス製薬	52	44	94,281
住友ファーマ	3	3	3,755
塩野義製薬	7	6	41,868
日本新薬	1	1	9,372
中外製薬	19	14	51,275
科研製薬	0.900	0.800	3,156
エーザイ	7	5	50,975
ロート製薬	3	2	9,947
小野薬品工業	13	9	31,545
参天製薬	11	9	10,210
JCRファーマ	1	1	3,128
東和薬品	0.900	0.700	1,465
第一三共	46	40	187,830

## ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
大塚ホールディングス	12	10	10	49,776
ペプチドリーム	3	2	2	4,158
サワイグループホールディングス	1	-	-	-
<b>石油・石炭製品(0.6%)</b>				
出光興産	6	5	5	16,380
ENEOSホールディングス	92	84	84	39,119
コスモエネルギーホールディングス	2	1	1	6,948
<b>ゴム製品(1.0%)</b>				
横浜ゴム	3	2	2	5,769
TOYO TIRE	3	2	2	4,139
ブリヂストン	17	14	14	78,716
住友ゴム工業	5	4	4	5,303
<b>ガラス・土石製品(0.8%)</b>				
AGC	5	4	4	21,840
太平洋セメント	3	3	3	6,306
東海カーボン	5	3	3	4,126
TOTO	4	3	3	14,585
日本碍子	6	5	5	9,647
日本特殊陶業	4	3	3	9,554
MARUWA	-	0.200	0.200	3,672
ニチアス	1	1	1	2,902
<b>鉄鋼(0.7%)</b>				
日本製鉄	-	21	21	47,902
JFEホールディングス	-	12	12	19,123
東京製鐵	-	1	1	1,933
<b>非鉄金属(0.7%)</b>				
三井金属鉱業	1	1	1	4,396
住友金属鉱山	7	5	5	25,435
DOWAホールディングス	-	1	1	4,900
住友電気工業	22	16	16	26,750
アサヒホールディングス	2	1	1	3,817
<b>金属製品(0.3%)</b>				
SUMCO	9	9	9	18,755
三和ホールディングス	5	4	4	5,574
リンナイ	1	0.900	0.900	9,153
<b>機械(5.6%)</b>				
日本製鋼所	1	-	-	-
三浦工業	2	2	2	6,670
アマダ	9	7	7	8,317
FUJI	2	2	2	4,190
オーエスジー	2	-	-	-

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
DMG森精機	3	2	2	5,344
ディスコ	0.900	0.800	0.800	32,400
オプトラン	0.800	0.700	0.700	1,836
ナブテスコ	3	3	3	9,990
S MC	1	1	1	96,360
小松製作所	27	22	22	68,156
住友重機械工業	3	2	2	8,008
日立建機	2	1	1	5,880
ローツェ	-	0.200	0.200	1,706
クボタ	29	24	24	51,169
荏原製作所	2	1	1	9,557
ダイキン工業	7	5	5	126,448
ダイフク	3	2	2	16,968
竹内製作所	0.900	0.900	0.900	2,745
ホンザキ	1	3	3	13,815
日本精工	11	-	-	-
マキタ	7	5	5	17,995
三菱重工業	9	8	8	42,607
I H I	3	3	3	10,200
<b>電気機器(17.4%)</b>				
イビデン	-	2	2	15,039
ブラザー工業	7	6	6	13,841
ミネベアミツミ	10	8	8	18,154
日立製作所	27	19	19	145,210
三菱電機	59	48	48	67,651
富士電機	3	2	2	17,023
安川電機	6	5	5	24,668
日本電産	14	11	11	98,952
オムロン	5	4	4	30,358
MCJ	2	1	1	1,894
日本電気	7	6	6	32,595
富士通	5	4	4	87,091
ルネサスエレクトロニクス	33	30	30	42,504
セイコーエプソン	7	6	6	13,545
ワコム	4	3	3	2,412
アルバック	1	1	1	6,600
エレコム	1	1	1	1,643
パナソニックホールディングス	65	55	55	70,139
シャープ	-	5	5	5,574
アンリツ	3	3	3	4,986
ソニーグループ	16	12	12	139,562

## ニッセイ J P X 日経400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	
TDK	8	7	36,593	
横河電機	6	5	12,739	
アズビル	3	3	13,447	
日本光電工業	2	2	7,106	
堀場製作所	1	1	6,450	
アドバンテスト	4	3	33,744	
キーエンス	2	2	170,404	
シスメックス	4	4	33,816	
フェローテックホールディングス	-	1	4,515	
レーザーテック	2	2	57,810	
スタンレー電気	4	-	-	
カシオ計算機	4	3	4,760	
ファナック	5	4	94,369	
浜松ホトニクス	4	3	26,603	
新光電気工業	-	1	6,408	
京セラ	8	7	50,536	
太陽誘電	2	2	10,108	
村田製作所	17	14	107,724	
小糸製作所	3	5	12,488	
S C R E E Nホールディングス	1	0.800	7,176	
東京エレクトロン	3	3	134,250	
<b>輸送用機器(5.8%)</b>				
トヨタ紡織	2	2	3,950	
豊田自動織機	4	3	26,146	
デンソー	13	9	72,998	
いすゞ自動車	18	13	24,246	
トヨタ自動車	88	69	139,408	
日野自動車	7	-	-	
アイシン	4	3	13,752	
本田技研工業	47	37	126,554	
スズキ	13	8	43,412	
S U B A R U	17	14	33,957	
ヤマハ発動機	8	7	24,783	
豊田合成	1	1	3,269	
シマノ	2	1	43,776	
テイ・エス テック	2	2	3,546	
<b>精密機器(3.4%)</b>				
テルモ	17	14	57,260	
島津製作所	7	5	23,883	
ブイ・テクノロジー	0.300	-	-	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
東京精密	1	1	4,420	
オリンパス	31	29	79,530	
H O Y A	11	10	144,430	
朝日インテック	6	6	15,268	
<b>その他製品(2.1%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	5	4	38,076	
パイロットコーポレーション	1	0.700	3,461	
ヤマハ	3	2	15,486	
ピジョン	3	3	6,111	
任天堂	2	23	135,989	
<b>電気・ガス業(1.1%)</b>				
中部電力	18	17	21,723	
関西電力	22	18	20,826	
中国電力	9	-	-	
東北電力	14	-	-	
九州電力	12	10	7,789	
北海道電力	5	4	2,007	
電源開発	5	3	7,255	
イーレックス	0.900	0.800	1,949	
レノバ	1	1	3,279	
東京瓦斯	11	9	24,411	
大阪瓦斯	10	9	19,589	
<b>陸運業(1.3%)</b>				
S B Sホールディングス	-	0.400	1,190	
東海旅客鉄道	4	3	58,914	
阪急阪神ホールディングス	7	-	-	
ヤマトホールディングス	8	6	13,728	
山九	1	1	5,862	
センコーグループホールディングス	2	2	2,510	
日立物流	1	1	8,900	
AZ-COM丸和ホールディングス	1	1	1,629	
九州旅客鉄道	4	-	-	
S Gホールディングス	10	8	18,191	
NIPPON EXPRESSホールディングス	1	1	13,345	
<b>海運業(0.7%)</b>				
日本郵船	4	12	34,013	
商船三井	9	8	25,256	
川崎汽船	-	4	10,088	
<b>倉庫・運輸関連業(0.0%)</b>				
三井倉庫ホールディングス	-	0.400	1,422	

## ニッセイ J P X 日経400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
近鉄エクスプレス	1	-	-
<b>情報・通信業(9.4%)</b>			
NEC ネットエスアイ	2	1	2,707
システナ	8	7	3,428
日鉄ソリューションズ	0.900	0.800	2,792
T I S	5	5	20,774
コーエーテクモホールディングス	1	2	7,003
ネクソン	13	12	33,650
ティーガイア	0.500	0.500	834
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1	1	2,997
GMO ペイメントゲートウェイ	1	1	13,959
インターネットイニシアティブ	-	2	6,175
ラクス	2	2	4,206
アカツキ	0.300	-	-
チェンジ	-	1	2,200
野村総合研究所	11	9	32,208
インフォコム	0.700	0.600	1,227
オービック	1	1	34,880
ジャストシステム	0.900	0.700	2,320
Zホールディングス	86	66	23,906
トレンドマイクロ	3	2	19,332
日本オラクル	1	0.900	7,722
伊藤忠テクノソリューションズ	2	2	8,212
大塚商会	3	2	12,155
電通国際情報サービス	0.800	0.600	2,820
東映アニメーション	0.200	0.200	2,786
デジタルガレージ	1	0.800	3,284
ネットワンシステムズ	-	1	6,077
B I P R O G Y	1	1	5,414
USEN-NEXT HOLDINGS	0.500	0.400	922
日本電信電話	56	36	139,885
KDDI	43	30	125,808
ソフトバンク	-	75	110,775
光通信	0.700	0.500	10,005
GMO インターネットグループ	-	1	4,370
東宝	3	2	15,370
エヌ・ティ・ティ・データ	16	14	30,752
D T S	-	1	3,435
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2	2	14,651
カプコン	5	4	20,240

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
S C S K	4	3	8,192
N S D	-	1	4,326
コナミグループ	2	2	13,540
ソフトバンクグループ	17	22	139,163
<b>卸売業(6.7%)</b>			
双日	6	5	12,568
アルフレッサ ホールディングス	6	4	8,168
神戸物産	4	3	13,186
ダイワボウホールディングス	2	2	4,432
T O K A I ホールディングス	2	2	2,133
シップヘルスケアホールディングス	1	1	5,011
コメダホールディングス	1	-	-
メディパルホールディングス	6	5	9,139
日本ライフライン	1	-	-
伊藤忠商事	40	30	127,984
丸紅	57	38	58,136
豊田通商	5	4	22,016
兼松	2	1	2,888
三井物産	45	36	138,348
住友商事	37	30	67,008
三菱商事	43	31	137,795
阪和興業	-	0.900	3,285
岩谷産業	1	1	6,215
P A L T A C	0.800	0.800	3,520
日鉄物産	0.400	0.300	1,545
ミスミグループ本社	7	7	25,752
<b>小売業(4.1%)</b>			
ローソン	1	1	6,024
エービーシー・マート	0.900	0.700	4,935
日本マクドナルドホールディングス	2	2	14,560
セリア	1	1	3,504
ビックカメラ	3	-	-
M o n o t a R O	7	7	16,828
マツキヨココカラ&カンパニー	2	3	17,370
Z O Z O	4	3	10,312
ウエルシアホールディングス	3	2	8,138
クリエイトSDホールディングス	0.900	0.800	2,648
ネクステージ	-	1	3,219
コスモス薬品	0.600	0.600	8,826
セブン&アイ・ホールディングス	22	17	94,826

## ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ツルハホールディングス	1	1	1	11,292
クスリのアオキホールディングス	0.600	0.500	0.500	3,855
FOOD & LIFE COMPANIES	3	2	2	7,252
ノジマ	1	1	1	2,100
良品計画	6	6	6	9,286
コーナン商事	0.900	0.700	0.700	2,313
バン・バンフィク・インターナショナルホールディングス	12	11	11	26,587
ゼンショーホールディングス	2	2	2	9,625
ワークマン	0.700	0.600	0.600	3,060
スギホールディングス	1	1	1	6,320
日本瓦斯	-	2	2	5,592
ライフコーポレーション	0.500	0.400	0.400	984
丸井グループ	4	3	3	8,319
イズミ	1	0.700	0.700	2,177
ヤオコー	0.700	0.600	0.600	4,080
ケーズホールディングス	5	3	3	4,368
アインホールディングス	0.800	-	-	-
ニトリホールディングス	2	2	2	31,090
ファーストリテイリング	0.800	0.700	0.700	57,512
サンドラッグ	2	1	1	7,068
<b>銀行業(5.4%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	27	22	22	6,771
コンソルディア・フィナンシャルグループ	33	25	25	11,789
新生銀行	3	1	1	3,056
あおぞら銀行	3	2	2	7,461
三菱UFJフィナンシャル・グループ	265	186	186	134,008
りそなホールディングス	67	58	58	36,819
三井住友トラスト・ホールディングス	10	8	8	36,133
三井住友フィナンシャルグループ	40	33	33	153,396
千葉銀行	19	12	12	10,368
ふくおかフィナンシャルグループ	4	3	3	9,361
セブン銀行	17	16	16	4,231
みずほフィナンシャルグループ	75	66	66	108,069
<b>証券、商品先物取引業(0.7%)</b>				
F P G	2	-	-	-
GMOフィナンシャルホールディングス	1	1	1	522
S B I ホールディングス	7	-	-	-
ジャフコ グループ	2	1	1	3,432
大和証券グループ本社	44	32	32	19,614
野村ホールディングス	92	84	84	41,405

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
マネックスグループ	-	5	5	2,279
<b>保険業(3.0%)</b>				
S O M P Oホールディングス	9	7	7	44,484
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	13	10	10	40,818
第一生命ホールディングス	28	23	23	55,197
東京海上ホールディングス	18	46	46	128,944
T & Dホールディングス	14	12	12	18,696
<b>その他金融業(1.3%)</b>				
全国保証	1	1	1	6,072
芙蓉総合リース	0.600	0.400	0.400	3,420
みずほリース	0.900	0.700	0.700	2,271
東京センチュリー	1	0.900	0.900	4,347
イオンフィナンシャルサービス	3	2	2	3,757
アコム	11	8	8	2,591
オリエントコーポレーション	16	1	1	1,428
オリックス	35	30	30	66,373
三菱HCキャピタル	21	17	17	11,384
日本取引所グループ	14	12	12	25,245
<b>不動産業(2.5%)</b>				
大東建託	2	1	1	26,078
いちご	6	-	-	-
ヒューリック	14	10	10	12,230
野村不動産ホールディングス	3	2	2	9,352
サムティ	0.900	-	-	-
プレサンスコーポレーション	0.700	0.600	0.600	952
オープンハウスグループ	1	1	1	9,979
東急不動産ホールディングス	17	13	13	9,977
飯田グループホールディングス	5	4	4	8,836
ケイアイスター不動産	-	0.200	0.200	969
三井不動産	26	19	19	53,152
三菱地所	37	29	29	55,522
東京建物	5	4	4	8,465
住友不動産	12	8	8	30,369
スターツコーポレーション	0.800	0.700	0.700	2,016
日本エスコン	1	1	1	836
イオンモール	3	2	2	4,063
カチタス	1	1	1	3,936
<b>サービス業(3.9%)</b>				
M I X I	1	-	-	-
日本M&Aセンターホールディングス	9	-	-	-

## ニッセイ J P X 日経400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
U Tグループ	0.800	0.700	1,978
エス・エム・エス	2	1	6,678
パーソルホールディングス	5	5	16,281
総合警備保障	2	1	6,714
カカクコム	4	3	8,262
ディップ	1	0.800	3,148
ベネフィット・ワン	2	2	4,631
エムスリー	10	9	41,952
アウトソーシング	3	-	-
博報堂DYホールディングス	7	6	8,119
バリューコマース	-	0.400	844
H. U. グループホールディングス	-	1	3,906
オリエンタルランド	6	-	-
ビー・エム・エル	-	0.600	2,088
ユー・エス・エス	6	4	10,584
サイバーエージェント	-	11	14,110
フルキャストホールディングス	0.500	0.500	1,450
エン・ジャパン	1	0.900	2,095
テクノプロ・ホールディングス	3	3	12,256
アイ・アールジャパンホールディングス	0.300	-	-
ジャパンマテリアル	1	1	3,760
リクルートホールディングス	34	33	149,734
ベルシステム24ホールディングス	0.800	0.600	784
ペイカレント・コンサルティング	0.400	3	16,568

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
ジャパンエパーターサービスホールディングス	1	1	2,850	
リログループ	3	2	6,147	
カナモト	1	-	-	
トランス・コスモス	-	0.600	1,998	
セコム	5	4	40,469	
メイテック	0.700	1	4,759	
イオンディライト	0.700	0.500	1,482	
合計	株数・金額	4,017	3,377	9,625,749
	銘柄数<比率>	399	400	<96.2%>

(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。

(注4) 業種は東証33業種分類によるものです。

### (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	374	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	9,625,749	95.7
コール・ローン等、その他	433,293	4.3
投資信託財産総額	10,059,042	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# ニッセイ J P X 日経400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

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>11,809,885,460円</b>
コール・ローン等 株 式(評価額)	293,856,703 9,625,749,610
未 収 入 金	9,679,550
未 収 配 当 金	129,757,077
差入委託証拠金	1,750,842,520
<b>(B)負債</b>	<b>1,807,687,182</b>
未 払 解 約 金	48,294,438
差入委託証拠金代用有価証券 そ の 他 未 払 費 用	1,759,392,520 224
<b>(C)純資産総額(A - B)</b>	<b>10,002,198,278</b>
元 本	5,663,082,674
次 期 繰 越 損 益 金	4,339,115,604
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>5,663,082,674口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C / D)</b>	<b>17,662円</b>

(注1) 担保に供している資産  
先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れています。

株式 2,187,859,340円

(注2) 期首元本額 6,992,571,741円

期中追加設定元本額 539,221,669円

期中一部解約元本額 1,868,710,736円

(注3) 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 J P X 日経400インデックスファンド  
(適格機関投資家限定) 2,447,371,797円

<購入・換金手数料なし>ニッセイ J P X 日経400

インデックスファンド 3,215,710,877円

## 損益の状況

当期 (2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>150,470,880円</b>
受 取 配 当 金	150,577,109
受 取 利 息	4,715
そ の 他 収 益 金	679
支 払 利 息	△ 111,623
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>501,567,380</b>
売 買 損 益	835,847,768
売 買 損	△ 334,280,388
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>39,874,300</b>
取 引 損 益	43,578,800
取 引 損	△ 3,704,500
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 5,720</b>
<b>(E)当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>691,906,840</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>4,587,401,608</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>372,110,400</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△1,312,303,244</b>
<b>(I)合計(E + F + G + H)</b>	<b>4,339,115,604</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(I)</b>	<b>4,339,115,604</b>

(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。

### ■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ J P X日経インデックス400（配当込み）

「J P X日経インデックス400」は、株式会社J P X総研（以下「J P X総研」といいます）および株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P X総研および日経は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「J P X日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJ P X総研、株式会社日本取引所グループおよび日経に帰属しています。当ファンドは、ニッセイアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、J P X総研および日経は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P X総研および日経は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。J P X総研および日経は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。