

第9期末 (2023年11月20日)

基準価額	19,422円
純資産総額	83億円
騰落率	23.3%
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。



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:2022年11月22日～2023年11月20日

第9期(決算日 2023年11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 J P X 日経400インデックスファンド」は、このたび第9期の決算を行いました。

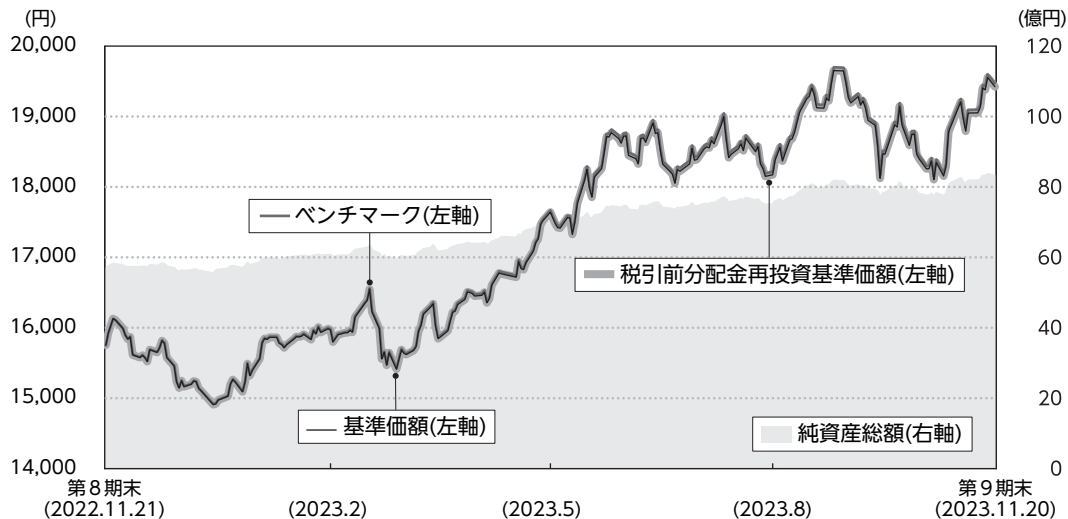
当ファンドは、「ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、J P X 日経インデックス400(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2022年11月22日～2023年11月20日

基準価額等の推移



第9期首	15,751円	既払分配金	0円
第9期末	19,422円	騰落率 (分配金再投資ベース)	23.3%

- (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 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9期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	37円	0.214%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は17,299円です。</p>
(投信会社)	(17)	(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)	(15)	(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)	(5)	(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	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	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	0	0.001	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(0)	(0.001)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	38	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。

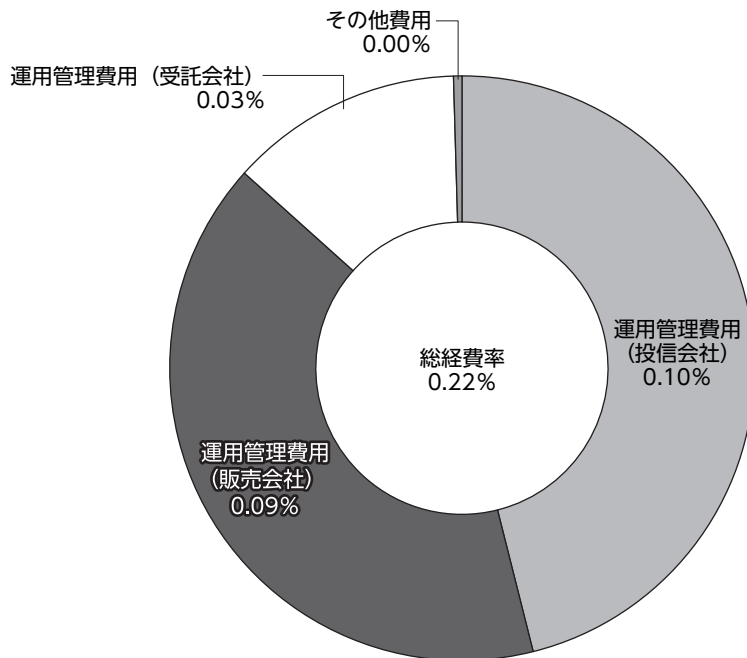
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。



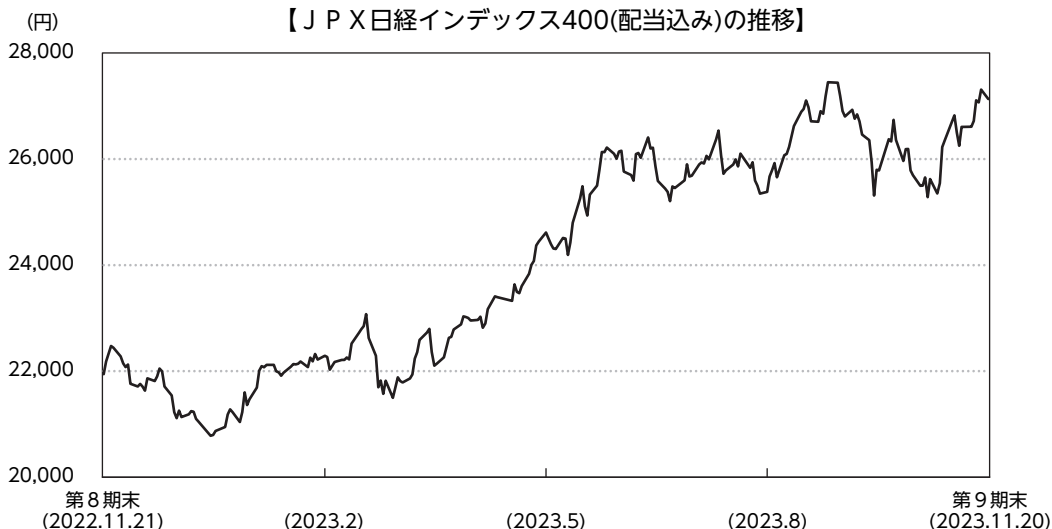
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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上昇しました。

期初以降、米連邦準備制度理事会（F R B）が金融引き締めを継続する姿勢を示したことによる景気減速懸念や日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことによる長期金利の上昇、さらに円高が進行したことなどから株価は下落しました。年明け以降は欧米における金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀による金融緩和の現状維持により市場に安心感が広がったことから株価は上昇に転じたものの、2023年3月中旬に米中堅地銀の経営破綻や欧州大手投資銀行の信用不安等に伴う欧米金融システムに対する懸念を受けて下落しました。

3月下旬以降は米著名投資家による日本株への追加投資の報道や外国人投資家の買い越し、東京証券取引所が株価純資産倍率（P B R）の低い企業に資本効率や株価を意識した経営を求めたことによる日本企業の資本コスト意識の高まりなど日本独自のポジティブ要因に加えて、米経済の軟着陸（ソフトランディング）への期待感や人工知能（A I）ブームによる世界同時株高の追い風を受けて株価は上昇基調で推移しました。7月に入ると米長期金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、Y C C）の運用柔軟化等、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、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を受け上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利の低下を受けて上昇し、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

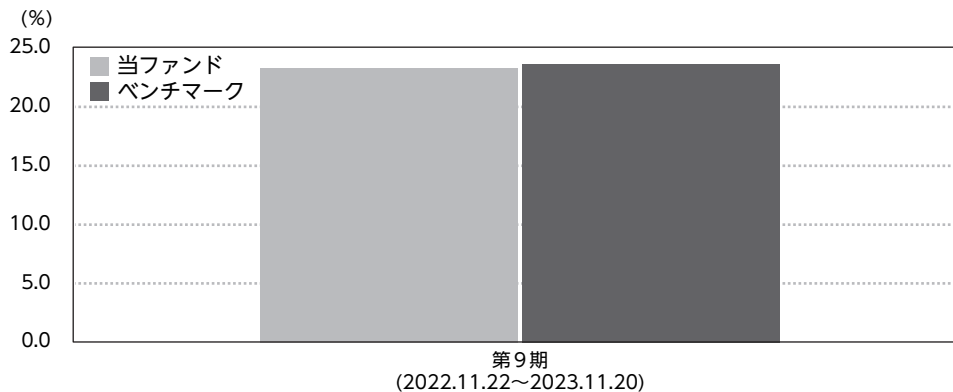
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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 J P X 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+23.3%となり、ベンチマーク騰落率（+23.6%）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
	2022年11月22日～2023年11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	9,422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9期末 2023年11月20日
ニッセイ J P X 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。

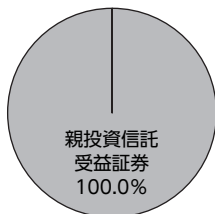
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■ 純資産等

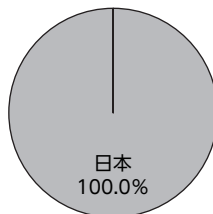
項目	第9期末 2023年11月20日
純資産総額	8,309,911,770円
受益権総口数	4,278,504,186口
1万口当たり基準価額	19,422円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,488,383,854円、同解約元本額は815,726,100円です。

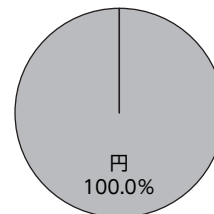
■ 資産別配分



■ 国別配分



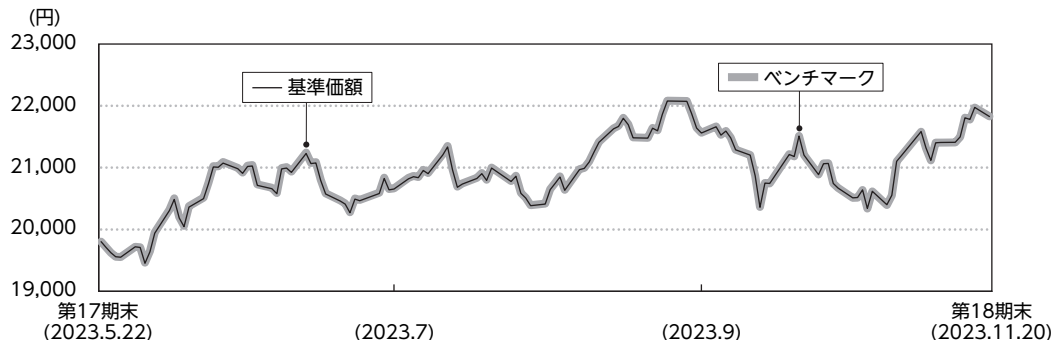
■ 通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年11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

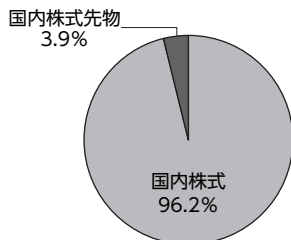
銘柄名	通貨	比率
TOPIX 先物 0512月 買	円	3.9%
トヨタ自動車	円	1.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
信越化学工業	円	1.7
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.7
伊藤忠商事	円	1.7
東京エレクトロン	円	1.6
日立製作所	円	1.6
リクルートホールディングス	円	1.6
三菱商事	円	1.6
組入銘柄数		400

■ 1万口当たりの費用明細

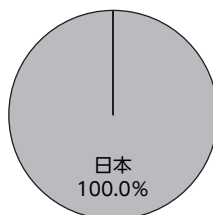
2023.5.23~2023.11.20

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

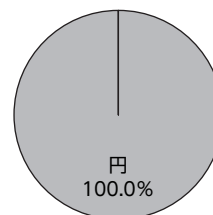
■ 資産別配分



■ 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11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
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
9期(2023年11月20日)	19,422	0	23.3	19,422	20,334	23.6	96.2	3.9	8,309

(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
			%			%		
	円		%			%	%	%
(期首)2022年11月21日	15,751		-	16,447		-	96.2	3.7
11月末	15,839		0.6	16,545		0.6	96.2	3.8
12月末	15,103	△	4.1	15,778	△	4.1	97.1	2.9
2023年1月末	15,779		0.2	16,487		0.2	96.6	3.5
2月末	15,930		1.1	16,647		1.2	96.0	4.0
3月末	16,190		2.8	16,929		2.9	94.2	5.8
4月末	16,603		5.4	17,363		5.6	95.7	4.3
5月末	17,328		10.0	18,131		10.2	96.1	3.9
6月末	18,634		18.3	19,503		18.6	94.9	5.1
7月末	18,881		19.9	19,764		20.2	96.8	3.2
8月末	18,919		20.1	19,804		20.4	95.7	4.4
9月末	18,948		20.3	19,832		20.6	96.3	3.5
10月末	18,292		16.1	19,143		16.4	96.0	3.9
(期末)2023年11月20日	19,422		23.3	20,334		23.6	96.2	3.9

(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11月22日～2023年11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 J P X 日経400インデックス マザーファンド	1,325,907	2,574,276	734,205	1,435,325

(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	4,209,781千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,213,524千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.41

(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11月22日～2023年11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11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 J P X 日経400インデックス マザーファンド	3,215,710	3,807,413	8,310,059

(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5,638,219千口です。

投資信託財産の構成

2023年11月20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	8,310,059	99.5
コール・ローン等、その他	39,197	0.5
投資信託財産総額	8,349,257	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11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	8,349,257,203円
コール・ローン等	7,943,651
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド(評価額)	8,310,059,932
未収入金	31,253,620
(B) 負債	39,345,433
未払解約金	31,106,945
未払信託報酬	8,196,540
その他未払費用	41,948
(C) 純資産総額(A-B)	8,309,911,770
元本	4,278,504,186
次期繰越損益金	4,031,407,584
(D) 受益権総口数	4,278,504,186口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,422円

(注) 期首元本額 3,605,846,432円
 期中追加設定元本額 1,488,383,854円
 期中一部解約元本額 815,726,100円

損益の状況

当期(2022年11月22日～2023年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 1,216円
受取利息	159
支払利息	△ 1,375
(B) 有価証券売買損益	1,366,486,131
売買益	1,491,833,132
売買損	△ 125,347,001
(C) 信託報酬等	△ 14,745,994
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,351,738,921
(E) 前期繰越損益金	570,815,198
(分配準備積立金)	(635,125,245)
(繰越欠損金)	(△ 64,310,047)
(F) 追加信託差損益金*	2,108,853,465
(配当等相当額)	(2,069,157,515)
(売買損益相当額)	(39,695,950)
(G) 合計(D+E+F)	4,031,407,584
次期繰越損益金(G)	4,031,407,584
追加信託差損益金	2,108,853,465
(配当等相当額)	(2,075,176,757)
(売買損益相当額)	(33,676,708)
分配準備積立金	1,922,554,119

(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	170,297,326円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,117,131,548円
(c) 信託約款に定める収益調整金	2,108,853,465円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	635,125,245円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	4,031,407,584円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	9,422.47円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)

■関連会社の実質保有比率

2023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25.7%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 18 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20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。



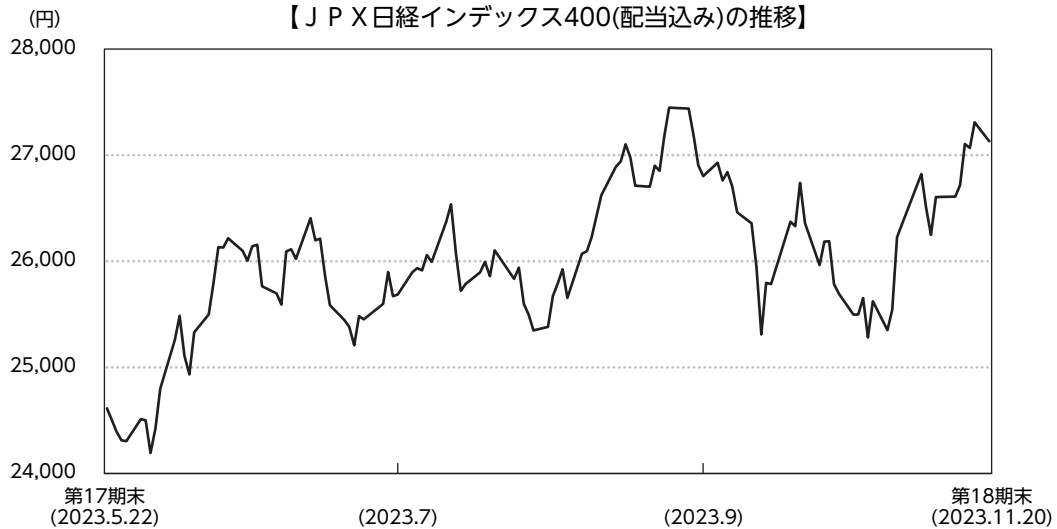
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

国内株式市況

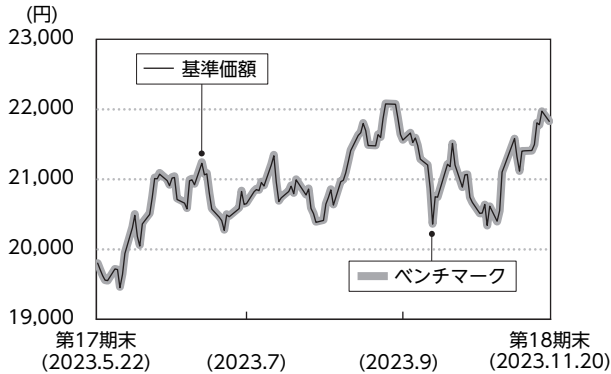


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、相対的な国内銘柄の割安感から海外投資家の買い越しが続いたことなどにより株価は上昇基調で推移しました。7月に入ると米長期金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の運用柔軟化等、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、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を受け上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利の低下を受けて上昇し、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

主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+10.2%となり、ベンチマーク騰落率+10.2%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。

お知らせ

■ 約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)

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
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
17期(2023年5月22日)	19,802		12.1	20,577		12.2	96.9	3.2	10,193
18期(2023年11月20日)	21,826		10.2	22,682		10.2	96.2	3.9	12,305

(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)2023年5月22日	19,802		—	20,577		—	96.9	3.2
5月末	19,452	△	1.8	20,225	△	1.7	96.1	3.9
6月末	20,922		5.7	21,755		5.7	94.9	5.1
7月末	21,204		7.1	22,047		7.1	96.8	3.2
8月末	21,250		7.3	22,091		7.4	95.7	4.4
9月末	21,286		7.5	22,122		7.5	96.3	3.5
10月末	20,553		3.8	21,353		3.8	96.0	3.9
(期末)2023年11月20日	21,826		10.2	22,682		10.2	96.2	3.9

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)	0.001% (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（20,910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

2023年5月23日～2023年11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
		759 (1,023)	1,885,395	356	838,572

(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	2,546	2,455	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
KDDI	9	43,257	4,369	東海旅客鉄道	3	64,061	18,303
ソフトバンクグループ	6	41,540	6,490	三井住友フィナンシャルグループ	7	47,491	6,595
信越化学工業	7	33,413	4,515	三菱商事	6	41,874	6,864
伊藤忠商事	6	32,972	5,405	T&Dホールディングス	11	27,802	2,336
任天堂	5	32,724	6,293	三菱UFJフィナンシャル・グループ	22	25,567	1,136
三菱商事	4	32,134	6,985	キーエンス	0.400	24,417	61,043
リクルートホールディングス	6	30,838	4,818	三井物産	4	23,145	5,260
日本電信電話	175	30,417	173	東京エレクトロン	1	22,819	20,745
三井物産	5	30,007	5,358	信越化学工業	4	18,548	4,523
ローム	2	27,502	11,001	第一三共	4	18,533	4,310

(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11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
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.0%)			
ニッスイ	6	6	4,870
鉱業(0.5%)			
三井松島ホールディングス	-	0.400	1,104
I N P E X	22	25	53,683
建設業(2.2%)			
ウエストホールディングス	0.500	0.600	1,956
ショーボンドホールディングス	0.800	0.900	5,376
ミライト・ワン	2	2	4,209
タマホーム	-	0.400	1,452
安藤・間	3	4	4,336
コムシスホールディングス	2	2	7,004
大成建設	4	4	24,187
大林組	15	17	22,074
清水建設	12	13	13,391
長谷工コーポレーション	4	4	7,970

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
鹿島建設	9	10	24,444
西松建設	0.700	-	-
戸田建設	5	-	-
熊谷組	0.700	-	-
五洋建設	6	-	-
住友林業	3	4	15,976
大和ハウス工業	12	13	56,869
積水ハウス	13	14	44,408
関電工	2	3	3,942
エクシオグループ	2	2	7,543
九電工	1	1	4,401
インフロニア・ホールディングス	4	5	9,027
食料品(3.8%)			
森永製菓	0.800	1	5,373
カルビー	2	2	5,978
森永乳業	0.800	0.900	4,910

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
ヤクルト本社	3	6	23,356
明治ホールディングス	5	6	20,502
プリマハム	0.600	-	-
日本ハム	1	2	9,076
アサヒグループホールディングス	9	11	61,880
キリンホールディングス	19	20	43,773
宝ホールディングス	2	3	3,837
サントリー食品インターナショナル	3	3	16,075
キッコーマン	2	3	30,201
味の素	10	11	64,779
キューピー	2	-	-
カゴメ	2	-	-
ニチレイ	2	2	7,055
東洋水産	2	2	19,830
日清食品ホールディングス	1	1	24,658
日本たばこ産業	28	29	110,861
繊維製品(0.3%)			
帝人	4	-	-
東レ	29	33	25,983
ゴールドウイン	0.800	0.900	9,796
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	18	20	11,809
大王製紙	1	-	-
レンゴー	4	4	4,260
化学(6.8%)			
クラレ	7	7	11,163
旭化成	27	33	33,633
住友化学	32	36	14,171
日産化学	2	2	12,880
東ソー	5	6	12,625
トクヤマ	1	1	3,770
デンカ	1	1	4,674
信越化学工業	36	39	204,852
エア・ウォーター	4	4	9,181
日本酸素ホールディングス	4	4	19,483
三菱瓦斯化学	3	3	8,450
三井化学	3	4	16,769
東京応化工業	-	0.800	7,309
三菱ケミカルグループ	29	36	34,547
K Hネオケム	0.700	0.800	1,836

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイセル	6	6	8,961
住友ベークライト	-	0.700	4,800
積水化学工業	8	10	21,200
日本ゼオン	2	3	4,608
アイカ工業	1	1	4,092
UBE	2	-	-
扶桑化学工業	-	0.500	2,045
ADEKA	-	1	4,799
日油	1	1	10,219
花王	10	11	61,812
日本ペイントホールディングス	19	26	29,894
関西ペイント	4	4	11,335
太陽ホールディングス	-	0.900	2,659
富士フィルムホールディングス	8	9	80,021
資生堂	9	10	44,496
ライオン	5	6	8,716
ファンケル	1	-	-
コーセー	0.900	1	10,570
小林製薬	1	1	9,501
タカラバイオ	1	1	1,561
デクセラアルズ	1	1	5,210
日東電工	3	3	33,968
エフピコ	0.800	-	-
ニフコ	1	1	5,767
ユニ・チャーム	9	10	48,749
医薬品(5.8%)			
協和キリン	5	6	14,646
武田薬品工業	33	38	160,477
アステラス製薬	41	43	78,488
住友ファーマ	3	-	-
塩野義製薬	5	6	44,001
日本新薬	1	1	6,977
中外製薬	13	15	75,640
科研製薬	0.800	-	-
エーザイ	5	6	46,326
ロート製薬	4	4	14,990
小野薬品工業	8	10	28,890
参天製薬	8	-	-
JCRファーマ	1	1	2,159
東和薬品	0.700	-	-

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
第一三共	38	38	150,380
大塚ホールディングス	10	10	56,392
ペプチドリーム	2	2	3,026
石油・石炭製品(0.7%)			
出光興産	4	5	22,660
ENEOSホールディングス	74	78	46,705
コスモエネルギーホールディングス	1	1	8,677
ゴム製品(0.9%)			
横浜ゴム	2	2	7,782
TOYO TIRE	2	2	6,771
ブリヂストン	14	14	85,912
住友ゴム工業	4	4	7,944
ガラス・土石製品(0.6%)			
AGC	4	4	24,780
太平洋セメント	2	-	-
東海カーボン	3	-	-
TOTO	2	3	12,903
日本碍子	5	5	10,379
日本特殊陶業	3	4	13,763
MARUWA	0.200	0.200	5,640
フジミインコーポレーテッド	-	1	3,919
ニチアス	1	1	3,958
鉄鋼(1.0%)			
日本製鉄	20	22	77,542
JFEホールディングス	12	14	31,414
東京製鐵	1	1	2,511
丸一鋼管	-	1	5,694
日本冶金工業	-	0.400	1,650
非鉄金属(0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	-	0.600	717
三井金属鉱業	1	1	6,423
住友金属鉱山	5	5	25,753
DOWAホールディングス	1	1	6,657
住友電気工業	15	19	34,732
AREホールディングス	1	1	3,665
金属製品(0.3%)			
SUMCO	8	9	19,233
三和ホールディングス	4	5	10,526
リンナイ	2	2	7,461
機械(6.1%)			
三浦工業	1	2	5,971

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アマダ	7	7	11,514
FUJII	1	2	5,561
DMG森精機	2	3	7,990
ディスコ	2	2	76,152
オプトラ	0.700	-	-
ナブテスコ	2	3	8,396
SMC	1	1	113,355
小松製作所	20	23	89,215
住友重機械工業	2	2	9,987
日立建機	1	2	8,050
ローツェ	0.200	0.300	4,164
クボタ	23	26	55,579
荏原製作所	1	2	16,506
ダイキン工業	5	5	140,715
オルガノ	-	0.600	3,378
ダイフク	6	8	22,915
SANKYO	-	1	7,281
竹内製作所	0.800	0.900	3,915
セガサミーホールディングス	-	4	9,776
ホシザキ	2	2	13,685
マキタ	5	5	22,355
三菱重工業	7	8	73,845
IHI	2	3	10,602
電気機器(17.5%)			
イビデン	2	2	18,714
ブラザー工業	5	6	16,344
ミネベアミツミ	7	8	24,586
日立製作所	18	19	199,192
三菱電機	45	55	113,708
富士電機	2	3	18,147
安川電機	5	5	30,304
ニデック	10	11	63,679
オムロン	4	3	23,332
MCJ	1	2	2,331
日本電気	6	6	53,709
富士通	4	4	94,760
ルネサスエレクトロニクス	28	32	78,585
セイコーエプソン	5	6	13,776
ワコム	3	3	2,682
アルバック	1	1	7,641
エレコム	1	1	1,953

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
パナソニック ホールディングス	52	58	92,404
シャープ	5	-	-
アンリツ	3	3	4,315
ソニーグループ	11	13	173,262
T D K	7	7	51,389
ヒロセ電機	-	0.700	11,294
横河電機	4	5	15,114
アズビル	3	3	16,751
日本光電工業	2	2	7,742
堀場製作所	1	0.900	8,313
アドバンテスト	3	14	65,480
キーエンス	2	2	161,928
シスメックス	3	4	33,479
フェローテックホールディングス	1	1	4,494
レーザーテック	2	2	71,438
日本電子	-	1	6,786
カシオ計算機	3	-	-
ファナック	21	24	97,056
ローム	-	9	24,242
浜松ホトニクス	3	4	23,472
三井ハイテック	-	0.400	2,858
新光電気工業	1	1	9,095
京セラ	6	7	61,715
太陽誘電	2	2	9,136
村田製作所	13	44	128,863
小糸製作所	5	5	12,208
S C R E E Nホールディングス	0.700	1	16,163
東京エレクトロン	8	8	200,802
輸送用機器(6.8%)			
トヨタ紡織	1	2	5,618
豊田自動織機	3	4	50,463
デンソー	9	40	100,203
いすゞ自動車	12	14	27,062
トヨタ自動車	65	75	208,778
カヤバ	-	0.500	2,230
アイシン	3	3	21,063
マツダ	-	16	27,351
本田技研工業	35	119	187,427
スズキ	8	9	55,728
S U B A R U	13	15	41,706

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマハ発動機	6	7	26,000
豊田合成	1	1	4,183
シマノ	1	2	44,890
テイ・エス テック	2	-	-
精密機器(2.9%)			
テルモ	13	13	65,853
島津製作所	5	6	24,981
ナカニシ	-	2	5,321
東京精密	1	1	8,820
オリンパス	26	30	66,008
H O Y A	9	9	157,510
朝日インテック	4	5	15,743
その他製品(2.0%)			
パンダイナムコホールディングス	12	13	40,783
パイロットコーポレーション	0.700	0.700	3,155
ヤマハ	2	3	10,753
ピジョン	2	3	5,074
任天堂	21	26	180,200
電気・ガス業(1.2%)			
中部電力	16	18	32,887
関西電力	16	19	37,116
九州電力	10	-	-
北海道電力	4	-	-
電源開発	3	4	9,168
イーレックス	0.800	0.900	612
レノバ	1	1	1,474
東京瓦斯	9	10	34,164
大阪瓦斯	8	10	28,760
陸運業(0.5%)			
S B S ホールディングス	0.400	0.400	1,008
東海旅客鉄道	3	-	-
ヤマトホールディングス	5	6	16,313
山九	1	1	6,435
センコーグループホールディングス	2	2	2,722
A Z - C O M 丸和ホールディングス	1	1	2,328
S G ホールディングス	8	8	17,753
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	1	1	12,887
海運業(1.0%)			
日本郵船	11	14	53,157
商船三井	7	10	41,548

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
川崎汽船	3	4	20,092	
N S ユナイテッド海運	-	0.300	1,369	
倉庫・運輸関連業(0.0%)				
三井倉庫ホールディングス	0.400	0.500	2,315	
情報・通信業(8.8%)				
N E C ネットズエスアイ	1	1	4,085	
システナ	7	7	1,987	
日鉄ソリューションズ	0.700	0.800	3,700	
T I S	4	5	17,172	
コーエーテックホールディングス	2	3	5,797	
ネクソン	11	11	33,418	
S H I F T	-	0.300	10,083	
ティーガイア	0.500	0.500	889	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1	1	2,838	
GMO ペイメントゲートウェイ	0.900	1	8,114	
インターネットイニシアティブ	2	2	6,153	
ラクス	2	2	5,991	
チェンジホールディングス	1	1	1,713	
野村総合研究所	8	11	45,727	
インフォコム	0.600	-	-	
オービック	1	1	37,553	
ジャストシステム	0.600	0.700	2,212	
L I N E ヤフー	62	70	30,131	
トレンドマイクロ	2	2	16,695	
日本オラクル	0.800	0.900	10,066	
伊藤忠テクノソリューションズ	2	-	-	
大塚商会	2	2	14,897	
電通国際情報サービス	0.500	0.600	2,775	
東映アニメーション	0.200	0.200	2,978	
デジタルガレージ	0.800	0.800	2,496	
ネットワンシステムズ	1	2	4,130	
B I P R O G Y	1	1	6,564	
USEN-NEXT HOLDINGS	0.500	0.600	2,133	
日本電信電話	34	943	163,766	
K D D I	28	38	176,331	
ソフトバンク	70	79	139,339	
光通信	0.500	0.500	11,305	
GMO インターネットグループ	1	1	4,206	
K A D O K A W A	-	2	7,082	
東宝	2	2	14,162	

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
N T T データグループ	13	12	23,890	
D T S	0.900	1	3,613	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2	2	11,907	
カプコン	4	4	22,206	
S C S K	3	3	9,626	
N S D	1	1	4,710	
コナミグループ	1	1	14,166	
ソフトバンクグループ	18	24	150,304	
卸売業(8.1%)				
双日	4	5	17,684	
アルフレッサ ホールディングス	4	5	12,784	
神戸物産	3	4	14,524	
ダイワボウホールディングス	1	2	6,699	
マクニカホールディングス	-	1	8,178	
T O K A I ホールディングス	2	-	-	
シップヘルスケアホールディングス	1	1	4,065	
メディカルホールディングス	4	5	12,644	
I D O M	-	1	1,258	
伊藤忠商事	28	33	204,180	
丸紅	36	43	101,746	
豊田通商	4	4	39,086	
兼松	1	2	4,415	
三井物産	32	34	188,734	
住友商事	28	31	101,088	
三菱商事	28	27	191,298	
キャノンマーケティングジャパン	-	1	4,356	
阪和興業	0.800	0.900	3,910	
岩谷産業	1	1	8,593	
稲畑産業	-	1	3,125	
伊藤忠エネクス	-	1	2,077	
加賀電子	-	0.500	3,060	
P A L T A C	0.700	0.700	3,343	
日鉄物産	0.100	-	-	
ミスミグループ本社	7	7	19,540	
小売業(4.0%)				
ローソン	1	1	7,986	
エービーシー・マート	0.700	2	5,579	
アスクル	-	1	2,220	
日本マクドナルドホールディングス	2	3	20,416	
セリア	1	1	3,187	

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
MonotaRO	6	7	10,900
マツキヨココカラ&カンパニー	2	9	25,118
ZOZO	3	3	10,614
ウエルシアホールディングス	2	2	6,858
クリエイトSDホールディングス	0.800	0.900	2,844
ネクステージ	1	1	2,673
コスモス薬品	0.500	0.500	7,857
セブン&アイ・ホールディングス	15	18	101,934
ツルハホールディングス	1	1	13,535
クスリのアオキホールディングス	0.400	1	4,704
FOOD & LIFE COMPANIES	2	2	7,891
ノジマ	1	1	2,101
良品計画	5	5	11,878
コーナン商事	0.600	0.600	2,232
バン・ビィック・インターナショナルホールディングス	9	10	35,637
ゼンショーホールディングス	2	2	22,924
ワークマン	0.500	0.600	2,448
V Tホールディングス	-	2	1,032
スギホールディングス	0.900	1	6,993
日本瓦斯	2	2	6,609
ライフコーポレーション	0.400	0.500	1,702
コメリ	-	0.800	2,572
しまむら	-	0.600	8,931
丸井グループ	3	-	-
イズミ	0.700	0.900	3,216
ヤオコー	0.500	0.600	4,722
ケーズホールディングス	3	3	4,736
ニトリホールディングス	1	1	29,668
ファーストリテイリング	2	2	84,686
サンドラッグ	1	1	7,808
銀行業(6.2%)			
めぶきフィナンシャルグループ	21	24	10,820
コンコディア・フィナンシャルグループ	23	26	17,917
SBI新生銀行	1	-	-
あおぞら銀行	2	-	-
三菱UFJフィナンシャル・グループ	166	162	207,605
りそなホールディングス	54	56	44,334
三井住友トラスト・ホールディングス	7	8	46,684
三井住友フィナンシャルグループ	31	27	204,568
千葉銀行	12	13	14,924

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ふくおかフィナンシャルグループ	3	4	14,830
セブン銀行	15	15	4,582
みずほフィナンシャルグループ	62	65	167,811
証券、商品先物取引業(1.0%)			
GMOフィナンシャルホールディングス	1	-	-
SBIホールディングス	-	7	22,542
ジャフコ グループ	1	1	2,347
大和証券グループ本社	30	37	36,678
野村ホールディングス	79	81	50,531
マネックスグループ	4	4	3,105
保険業(3.0%)			
SOMPホールディングス	7	7	50,103
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	8	10	58,674
第一生命ホールディングス	21	23	72,095
東京海上ホールディングス	42	48	177,456
T & Dホールディングス	11	-	-
その他金融業(1.4%)			
全国保証	1	1	6,245
芙蓉総合リース	0.400	0.400	4,766
みずほリース	0.600	0.800	3,884
東京センチュリー	0.800	0.900	5,094
イオンフィナンシャルサービス	2	2	3,543
アコム	7	8	2,931
ジャックス	-	0.500	2,585
オリエントコーポレーション	1	1	1,720
オリックス	28	29	80,171
三菱HCキャピタル	16	21	20,740
日本取引所グループ	12	12	39,090
不動産業(2.3%)			
大東建託	1	1	28,962
ヒューリック	10	11	16,125
野村不動産ホールディングス	2	2	10,068
プレサンスコーポレーション	0.700	0.800	1,187
オープンハウスグループ	1	1	7,443
東急不動産ホールディングス	12	14	13,994
飯田グループホールディングス	3	4	10,708
ケイアイスター不動産	0.200	0.200	671
三井不動産	18	22	77,827
三菱地所	26	31	61,561
東京建物	4	4	8,799

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
住友不動産	7	7	29,162
スターツコーポレーション	0.600	0.700	1,941
日本エスコン	1	-	-
イオンモール	2	-	-
カチタス	1	1	2,837
サービス業(3.4%)			
日本M&Aセンターホールディングス	-	8	5,495
UTグループ	0.700	0.700	1,552
パソナグループ	-	0.600	1,359
エス・エム・エス	1	1	4,801
パーソルホールディングス	5	51	12,667
総合警備保障	1	8	7,190
カカココム	3	3	5,473
ディップ	0.800	0.800	2,500
ベネフィット・ワン	2	1	2,670
エムスリー	8	10	23,940
博報堂DYホールディングス	5	6	7,055
バリューコマース	0.300	-	-
H. U. グループホールディングス	1	1	3,853
ビー・エム・エル	0.600	0.600	1,760
ユー・エス・エス	4	5	16,370
サイバーエージェント	9	11	9,180
フルキャストホールディングス	0.400	0.500	992
エン・ジャパン	0.800	-	-
テクノプロ・ホールディングス	2	3	10,281
ジャパンマテリアル	1	1	3,616

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リクルートホールディングス	31	37	191,925
ベルシステム24ホールディングス	0.600	0.500	822
バイカレント・コンサルティング	3	3	17,186
ジャパエバーターサービスホールディングス	1	1	3,667
リログループ	2	2	3,843
トランス・コスモス	0.600	0.600	1,866
セコム	4	5	55,120
メイテックグループホールディングス	1	1	5,210
イオンディライト	0.500	0.600	2,034
合計	株数・金額	3,207	4,633 11,833,593
	銘柄数<比率>	399	399 <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	473	-

(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11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	11,833,593	95.4
コール・ローン等、その他	573,289	4.6
投資信託財産総額	12,406,882	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11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	13,844,314,948円
コール・ローン等	439,623,801
株式(評価額)	11,833,593,390
未収入金	25,413,360
未収配当金	108,252,377
差入委託証拠金	1,437,432,020
(B)負債	1,538,360,020
未払金	8,177,728
未払解約金	67,969,800
差入委託証拠金代用有価証券	1,462,212,020
その他未払費用	472
(C)純資産総額(A-B)	12,305,954,928
元本	5,638,219,483
次期繰越損益金	6,667,735,445
(D)受益権総口数	5,638,219,483口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,826円

- (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 | 2,211,830,330円 |
|----|----------------|
- (注2) 期首元本額 5,147,893,843円
期中追加設定元本額 916,368,483円
期中一部解約元本額 426,042,843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) 1,830,806,337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 3,807,413,146円

損益の状況

当期 (2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	125,482,586円
受取配当金	125,602,411
受取利息	7,677
その他収益金	575
支払利息	△ 128,077
(B)有価証券売買損益	906,473,128
売買益	1,312,788,506
売買損	△ 406,315,378
(C)先物取引等損益	56,767,550
取引益	72,793,950
取引損	△ 16,026,400
(D)信託報酬等	△ 4,526
(E)当期損益金(A+B+C+D)	1,088,718,738
(F)前期繰越損益金	5,045,790,726
(G)追加信託差損益金	994,713,173
(H)解約差損益金	△ 461,487,192
(I)合計(E+F+G+H)	6,667,735,445
次期繰越損益金(I)	6,667,735,445

- (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。