

第10期末 (2024年11月20日)

基準価額	22,783円
純資産総額	120億円
騰落率	17.3%
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:2023年11月21日~2024年11月20日

第10期(決算日 2024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10期の決算を行いました。

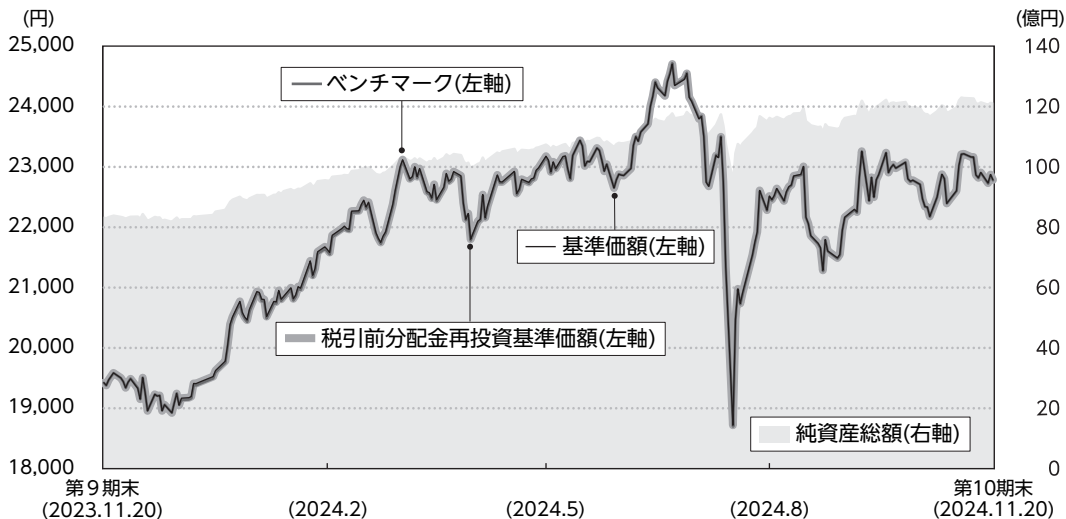
当ファンドは、「ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、J P X 日経インデックス400(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2023年11月21日～2024年11月20日

## 基準価額等の推移



第10期首	19,422円	既払分配金	0円
第10期末	22,783円	騰落率 (分配金再投資ベース)	17.3%

- (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10期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	47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22,060円です。
(投信会社)	(22)	(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)	(19)	(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)	( 6)	(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	0.002	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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)	(0.002)	
その他費用	0	0.001	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	( 0)	(0.001)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	( 0)	(0.000)	・ 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	48	0.217	

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

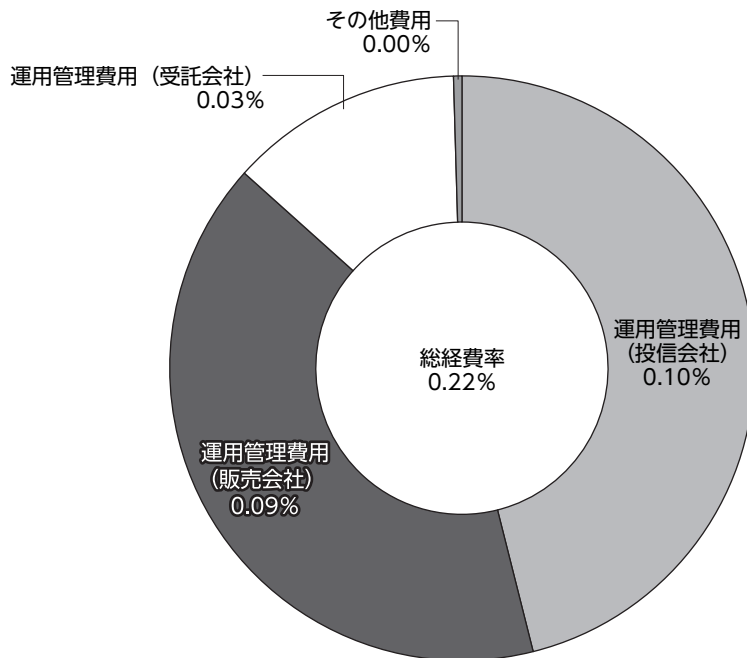
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.22%**です。



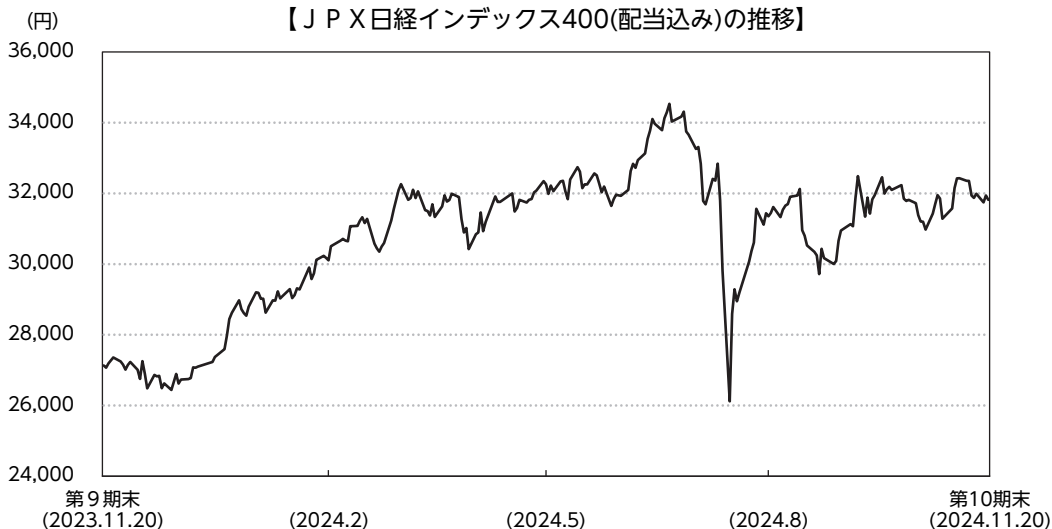
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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) 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、日銀の金融政策修正への思惑等を背景に株価は軟調に推移しましたが、2023年12月以降は米長期金利のピークアウトや日本企業における2023年度7-9月期決算が総じて良好な内容であったことが好感され上昇に転じました。年明け以降は米金利の上昇による円安の進行、さらに海外投資家の買いや新しい少額投資非課税制度 (NISA) に伴う資金流入により日経平均株価がバブル期から約34年ぶりに史上最高値を更新するなど、株価は大幅に上昇しました。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により株価は下落する場面もありましたが、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史上最高値を更新した米国株の上昇を背景におおむね上昇しました。

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、7月11日に日経平均株価は史上最高値を更新しました。7月下旬以降は米国の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たものの、内田日銀副総裁による金融引き締めに慎重な発言を受けて再び円安になると上昇しました。10月以降は為替市場における円安傾向が下支えとなったものの、衆院選の結果を受けた景気刺激的な経済政策への思惑が交錯して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

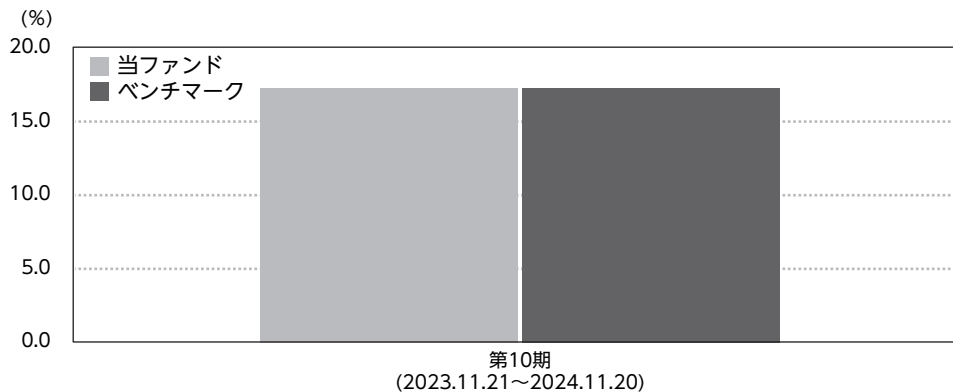
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■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+17.3%となり、ベンチマーク騰落率（+17.3%）に連動しました。

(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
	2023年11月21日～2024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	12,783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10期末 2024年11月20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。

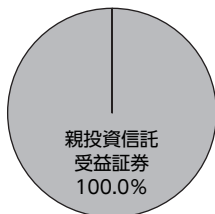
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

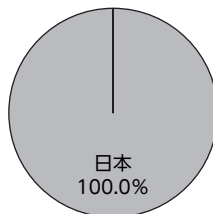
項目	第10期末 2024年11月20日
純資産総額	12,094,961,477円
受益権総口数	5,308,677,891口
1万口当たり基準価額	22,783円

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,307,629,706円、同解約元本額は1,277,456,001円です。

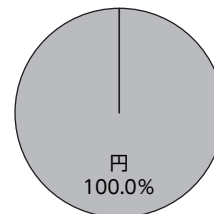
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

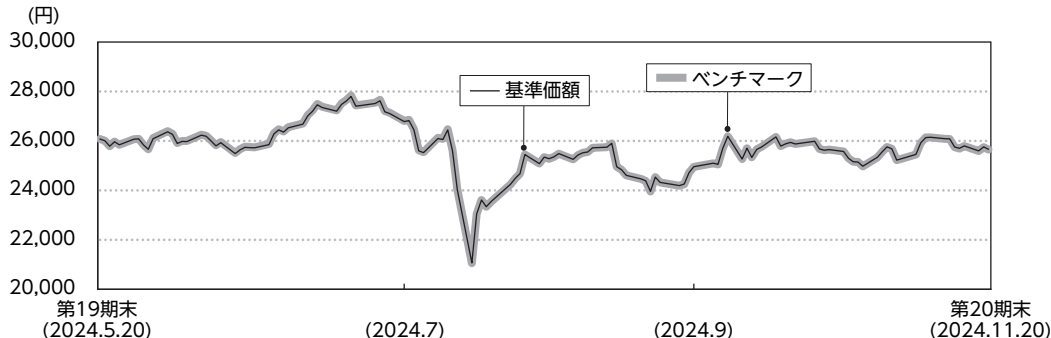


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



## 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

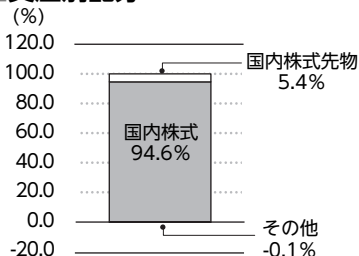
銘柄名	通貨	比率
TOPIX 先物 0612月 買	円	5.4%
リクルートホールディングス	円	1.7
日立製作所	円	1.6
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.6
みずほフィナンシャルグループ	円	1.6
ソニーグループ	円	1.6
三菱重工業	円	1.5
日本電信電話	円	1.5
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.4
伊藤忠商事	円	1.4
組入銘柄数		401

### ■ 1万口当たりの費用明細

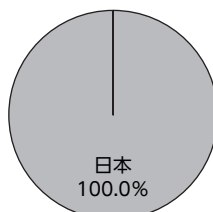
2024.5.21~2024.11.20

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

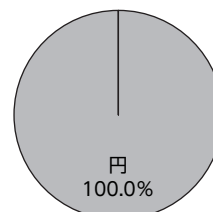
### ■ 資産別配分



### ■ 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(2024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) 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
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
10期(2024年11月20日)	22,783	0	17.3	22,783	23,845	17.3	94.6	5.4	12,094

(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		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11月20日	19,422	-	20,334	-		96.2	3.9
11月末	19,428	0.0	20,345	0.1		96.1	3.9
12月末	19,427	0.0	20,310	△ 0.1		97.4	2.6
2024年1月末	20,951	7.9	21,906	7.7		96.4	3.5
2月末	21,963	13.1	22,968	13.0		95.5	4.3
3月末	22,972	18.3	24,027	18.2		96.6	3.4
4月末	22,864	17.7	23,918	17.6		95.0	4.9
5月末	23,190	19.4	24,277	19.4		94.3	5.7
6月末	23,575	21.4	24,688	21.4		96.2	3.7
7月末	23,496	21.0	24,611	21.0		95.0	5.1
8月末	22,849	17.6	23,910	17.6		97.3	2.8
9月末	22,438	15.5	23,490	15.5		95.6	4.6
10月末	22,803	17.4	23,874	17.4		95.3	4.9
(期末)2024年11月20日	22,783	17.3	23,845	17.3		94.6	5.4

(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**

2023年11月21日～2024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	2,051,227	5,111,379	1,144,698	2,838,494

(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	8,971,193千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,385,817千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.58

(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**

2023年11月21日～2024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**

2024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	3,807,413	4,713,942	12,095,032

(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7,576,521千口です。

## 投資信託財産の構成

2024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	12,095,032	99.7
コール・ローン等、その他	31,849	0.3
投資信託財産総額	12,126,881	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

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>12,126,881,961円</b>
コール・ローン等	11,985,059
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド(評価額)	12,095,032,809
未収入金	19,864,093
<b>(B) 負債</b>	<b>31,920,484</b>
未払解約金	19,507,435
未払信託報酬	12,349,810
その他未払費用	63,239
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>12,094,961,477</b>
元本	5,308,677,891
次期繰越損益金	6,786,283,586
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>5,308,677,891口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>22,783円</b>

(注) 期首元本額 4,278,504,186円  
 期中追加設定元本額 2,307,629,706円  
 期中一部解約元本額 1,277,456,001円

## 損益の状況

当期(2023年11月21日～2024年11月20日)

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>5,645円</b>
受取利息	5,719
支払利息	△ 74
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,235,186,018</b>
売買益	1,495,752,823
売買損	△ 260,566,805
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 22,506,756</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>1,212,684,907</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>1,463,220,897</b>
(分配準備積立金)	(1,463,220,897)
<b>(F) 追加信託差損益金*</b>	<b>4,110,377,782</b>
(配当等相当額)	(3,497,076,244)
(売買損益相当額)	(613,301,538)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>6,786,283,586</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>6,786,283,586</b>
追加信託差損益金	4,110,377,782
(配当等相当額)	(3,506,542,128)
(売買損益相当額)	(603,835,654)
分配準備積立金	2,675,905,804

(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	257,772,620円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	954,912,287円
(c) 信託約款に定める収益調整金	4,110,377,782円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	1,463,220,897円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	6,786,283,586円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	12,783.38円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■関連会社の実質保有比率

2024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18.9%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JPX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、JPX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JPX日経400 インデックスファンド	ニッセイJPX日経400インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイJPX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JPX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JPX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 20 期

(計算期間：2024年5月21日～2024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。



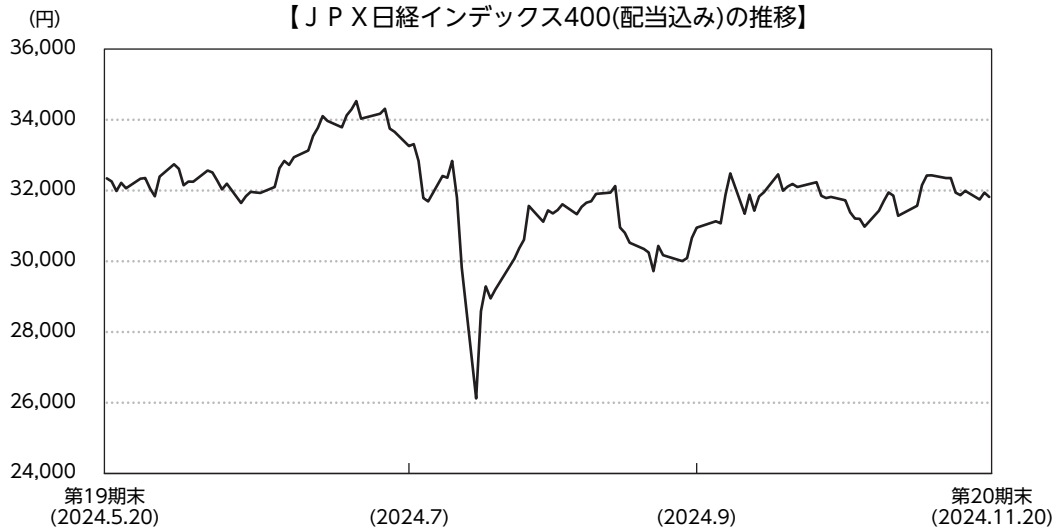
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

## 国内株式市況



(注) プルームバーグのデータを使用しています。

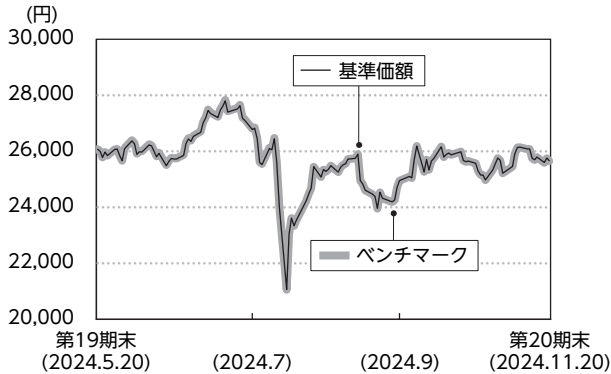
国内株式市場は期を通じて見ると下落しました。

期初以降、米国における継続的なインフレ環境を受けた利下げ観測の後退などにより株価は下落する場面もありましたが、国内企業の積極的な株主還元姿勢や史上最高値を更新した米国株の上昇が下支えとなり、上下する展開となりました。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、7月11日に日経平均株価は史上最高値を更新しました。

7月下旬以降は米国の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たものの、内田日銀副総裁による金融引き締めに関する慎重な発言を受けて再び円安になると上昇しました。10月以降は為替市場における円安傾向が下支えとなったものの、衆院選の結果を受けた景気刺激的な経済政策への思惑が交錯して株価は上下する展開となり、期初をやや下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、当期の基準価額は下落しました。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-1.6%となり、ベンチマーク騰落率-1.6%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	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
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
19期(2024年5月20日)	26,072	19.5	27,040	19.2	94.5	5.5	16,070
20期(2024年11月20日)	25,658	△ 1.6	26,598	△ 1.6	94.6	5.4	19,439

(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5月20日	26,072	—	27,040	—	94.5	5.5
5月末	26,089	0.1	27,080	0.1	94.3	5.7
6月末	26,527	1.7	27,538	1.8	96.2	3.7
7月末	26,443	1.4	27,452	1.5	95.0	5.1
8月末	25,719	△ 1.4	26,671	△ 1.4	97.3	2.8
9月末	25,262	△ 3.1	26,203	△ 3.1	95.6	4.6
10月末	25,677	△ 1.5	26,630	△ 1.5	95.3	4.9
(期末)2024年11月20日	25,658	△ 1.6	26,598	△ 1.6	94.6	5.4

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024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 (株式)	0円 (0)	0.001% (0.000)	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
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（25,674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5月21日～2024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
		2,679 (1,513)	5,641,820	713	2,110,248

(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
	4,867	4,670	－	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024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
キャノン	34	175,861	5,039	ソフトバンクグループ	33	271,343	8,148
オリエンタルランド	42	166,052	3,953	日立製作所	52	182,691	3,473
日本電信電話	845	131,872	155	リクルートホールディングス	16	146,051	8,745
日立製作所	27	102,188	3,689	三井住友フィナンシャルグループ	12	105,535	8,510
リクルートホールディングス	11	99,699	8,449	東京海上ホールディングス	18	100,423	5,457
東海旅客鉄道	27	90,396	3,348	東京エレクトロン	3	89,711	25,631
武田薬品工業	20	86,686	4,249	ニデック	15	88,909	5,888
ソニーグループ	6	85,582	13,372	三菱UFJフィナンシャル・グループ	51	78,145	1,514
三菱UFJフィナンシャル・グループ	52	81,240	1,562	伊藤忠商事	9	74,289	7,504
キーエンス	1	80,005	66,671	三菱商事	19	56,819	2,990

(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

2024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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.0%)</b>					鹿島建設	11	14	14	40,155
ニッセイ	7	9	9	8,800	住友林業	4	5	5	31,470
<b>鉱業(0.4%)</b>					大和ハウス工業	14	20	20	94,821
I N P E X	25	29	29	58,782	積水ハウス	16	20	20	72,358
石油資源開発	-	5	5	5,792	関電工	3	3	3	8,413
<b>建設業(2.2%)</b>					エクシオグループ	5	7	7	12,780
ウエストホールディングス	0.700	-	-	-	九電工	1	1	1	7,777
ショーボンドホールディングス	1	1	1	6,787	高砂熟学工業	-	1	1	9,672
ミライト・ワン	2	-	-	-	インフロンティア・ホールディングス	6	7	7	8,536
タマホーム	0.500	0.600	0.600	2,211	<b>食料品(3.6%)</b>				
安藤・間	4	5	5	6,669	森永製菓	2	2	2	7,632
コムシスホールディングス	2	3	3	11,230	寿スピリッツ	-	4	4	7,880
大成建設	4	6	6	41,693	カルビー	2	3	3	9,507
大林組	18	22	22	45,998	森永乳業	1	2	2	7,641
清水建設	15	-	-	-	ヤクルト本社	7	9	9	28,982
長谷工コーポレーション	4	6	6	11,727	明治ホールディングス	6	9	9	29,853

## 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
日本ハム	2	2	14,589
アサヒグループホールディングス	12	50	82,057
キリンホールディングス	22	28	59,024
宝ホールディングス	3	4	5,595
サントリー食品インターナショナル	3	4	24,364
キッコーマン	17	22	37,564
味の素	12	15	99,454
ニチレイ	2	2	11,435
東洋水産	2	3	31,976
日清食品ホールディングス	5	8	33,094
日本たばこ産業	32	41	172,036
<b>繊維製品(0.3%)</b>			
東レ	36	50	46,274
ゴールドウイン	1	1	10,098
<b>パルプ・紙(0.1%)</b>			
王子ホールディングス	22	26	14,510
レンゴー	4	-	-
<b>化学(5.5%)</b>			
クラレ	7	10	19,655
旭化成	36	-	-
住友化学	40	-	-
日産化学	2	3	18,966
東ソー	7	9	19,168
トクヤマ	1	-	-
デンカ	2	-	-
信越化学工業	42	44	251,214
エア・ウォーター	5	6	12,090
日本酸素ホールディングス	5	6	29,379
三菱瓦斯化学	3	5	16,077
三井化学	4	6	21,129
東京応化工業	2	3	11,550
三菱ケミカルグループ	39	50	42,474
KHネオケム	0.800	1	2,452
ダイセル	6	7	10,323
住友ベークライト	1	2	8,404
積水化学工業	10	13	32,105
日本ゼオン	3	-	-
アイカ工業	1	-	-
扶桑化学工業	0.600	0.600	2,070
ADEKA	1	2	6,796

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日油	4	8	18,812
花王	12	16	104,258
日本ペイントホールディングス	28	30	30,360
関西ペイント	4	5	12,258
太陽ホールディングス	0.900	1	4,956
富士フイルムホールディングス	30	41	135,746
資生堂	11	14	39,463
ライオン	6	8	16,033
コーセー	1	-	-
小林製薬	1	1	10,285
タカラバイオ	1	2	2,362
デクセリアルズ	1	6	14,478
日東電工	3	21	53,457
ニフコ	1	2	9,570
ユニ・チャーム	11	14	54,082
<b>医薬品(5.8%)</b>			
協和キリン	6	8	20,982
武田薬品工業	41	61	255,938
アステラス製薬	47	60	94,821
塩野義製薬	6	22	46,956
日本新薬	1	1	7,232
中外製薬	16	21	137,256
エーザイ	6	9	42,269
ロート製薬	5	7	19,841
小野薬品工業	11	14	24,604
JCRファーマ	1	-	-
第一三共	41	54	246,259
大塚ホールディングス	11	17	154,800
ペプチドリーム	2	3	8,434
<b>石油・石炭製品(0.8%)</b>			
出光興産	28	32	32,404
ENEOSホールディングス	85	116	92,172
コスモエネルギーホールディングス	1	2	15,474
<b>ゴム製品(0.8%)</b>			
横浜ゴム	2	3	10,664
TOYO TIRE	3	4	9,644
ブリヂストン	15	20	108,479
住友ゴム工業	5	6	12,033
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>			
AGC	4	6	31,094

## 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	
東海カーボン	-	6	5,887	
TOTO	3	5	20,215	
日本碍子	6	8	16,124	
日本特殊陶業	4	5	27,344	
MARUWA	0.200	0.300	13,332	
フジインコーポレーテッド	1	1	4,276	
ニチアス	1	1	10,081	
<b>鉄鋼(1.1%)</b>				
日本製鉄	24	35	111,517	
神戸製鋼所	-	14	23,011	
JFEホールディングス	15	21	37,221	
東京製鐵	1	2	2,908	
大和工業	-	1	10,559	
丸一鋼管	1	2	7,332	
大同特殊鋼	-	4	5,307	
日本冶金工業	0.400	0.500	2,007	
<b>非鉄金属(0.9%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	0.700	-	-	
三井金属鉱業	1	1	8,386	
住友金属鉱山	6	8	34,380	
DOWAホールディングス	1	1	8,633	
住友電気工業	20	24	70,418	
フジクラ	-	7	42,886	
AREホールディングス	2	2	5,141	
<b>金属製品(0.4%)</b>				
SUMCO	9	13	16,969	
三和ホールディングス	5	7	31,031	
リンナイ	2	3	11,989	
日本発条	-	6	11,415	
<b>機械(6.6%)</b>				
三浦工業	2	3	12,086	
ツガミ	-	1	2,070	
アマダ	8	9	13,929	
FUJI	2	-	-	
DMG森精機	3	4	11,728	
ディスコ	2	3	139,623	
野村マイクロ・サイエンス	-	1	2,032	
ナブテスコ	3	4	10,216	
SMC	1	2	139,650	
小松製作所	25	35	142,625	
住友重機械工業	3	4	13,230	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
日立建機	2	2	9,438	
TOWA	-	2	3,381	
ローツェ	0.300	3	6,508	
クボタ	28	36	69,540	
荏原製作所	2	14	32,972	
ダイキン工業	6	9	164,745	
オルガノ	0.700	1	9,383	
ダイフク	9	11	37,767	
SANKYO	5	8	17,044	
竹内製作所	1	1	6,279	
セガサミーホールディングス	4	6	16,653	
ホシザキ	3	4	27,045	
マキタ	6	8	40,179	
三菱重工業	95	121	288,702	
IHI	4	-	-	
<b>電気機器(17.2%)</b>				
イビデン	2	4	18,712	
ブラザー工業	7	9	25,170	
ミネベアミツミ	9	12	30,114	
日立製作所	21	83	316,728	
三菱電機	60	70	184,518	
富士電機	3	4	35,746	
安川電機	5	7	31,275	
ニデック	12	-	-	
JVCケンウッド	-	5	8,167	
オムロン	4	6	32,123	
MCJ	2	2	3,941	
日本電気	7	9	121,128	
富士通	50	63	177,914	
ルネサスエレクトロニクス	34	52	107,104	
セイコーエプソン	7	8	23,852	
ワコム	4	-	-	
アルバック	1	1	9,396	
エレコム	1	-	-	
パナソニック ホールディングス	64	81	124,704	
アンリツ	3	-	-	
ソニーグループ	14	102	308,439	
TDK	8	59	114,726	
メイコー	-	0.700	6,104	
ヒロセ電機	0.800	1	17,715	
横河電機	6	7	25,840	

## 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
アズビル	3	18	23,048	
日本光電工業	2	6	13,325	
堀場製作所	1	1	10,533	
アドバンテクト	15	21	206,085	
キーエンス	2	4	259,520	
シスメックス	14	17	54,374	
フェローテックホールディングス	1	2	5,429	
レーザーテック	2	3	54,002	
日本電子	1	1	9,112	
ファナック	26	33	135,190	
ローム	10	12	17,961	
浜松ホトニクス	4	11	19,195	
三井ハイテック	0.500	3	2,304	
新光電気工業	1	2	12,528	
京セラ	33	42	62,749	
太陽誘電	2	3	6,460	
村田製作所	49	61	156,733	
小糸製作所	5	7	13,969	
S C R E E Nホールディングス	1	2	26,758	
キャノン	-	34	170,794	
東京エレクトロン	9	8	174,960	
<b>輸送用機器(5.7%)</b>				
トヨタ紡織	2	2	5,776	
豊田自動織機	4	5	67,019	
デンソー	44	72	166,773	
三菱ロジスネクスト	-	1	1,423	
いすゞ自動車	15	21	41,827	
トヨタ自動車	82	84	228,562	
三菱自動車工業	-	26	11,937	
カヤバ	0.500	0.600	3,024	
アイシン	4	14	23,606	
マツダ	17	21	21,226	
本田技研工業	127	162	221,185	
スズキ	39	55	91,770	
S U B A R U	16	21	52,962	
ヤマハ発動機	23	28	39,246	
豊田合成	1	2	5,107	
シマノ	2	3	61,965	
<b>精密機器(3.2%)</b>				
テルモ	30	45	140,591	

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
島津製作所	7	9	42,273	
ナカニシ	2	2	6,443	
東京精密	1	1	10,799	
オリンパス	31	39	98,937	
H O Y A	10	13	268,920	
ノーリツ鋼機	-	0.600	2,484	
朝日インテック	6	8	21,499	
シチズン時計	-	6	5,682	
<b>その他製品(2.5%)</b>				
三井松島ホールディングス	0.400	0.500	1,782	
フルヤ金属	-	0.700	2,450	
パンダイナムコホールディングス	14	18	58,236	
パイロットコーポレーション	0.800	1	5,431	
大日本印刷	-	14	34,009	
アシックス	-	25	73,395	
ローランド	-	0.500	1,997	
ヤマハ	3	12	13,656	
ビジョン	3	-	-	
任天堂	29	32	268,167	
<b>電気・ガス業(1.3%)</b>				
中部電力	19	25	41,985	
関西電力	20	28	54,505	
九州電力	-	15	23,273	
電源開発	4	5	13,509	
イーレックス	1	-	-	
レノバ	1	-	-	
東京瓦斯	10	13	57,389	
大阪瓦斯	10	13	43,278	
<b>陸運業(1.2%)</b>				
S B Sホールディングス	0.500	0.600	1,440	
京浜急行電鉄	-	8	10,450	
小田急電鉄	-	11	17,475	
東海旅客鉄道	-	26	83,846	
西武ホールディングス	-	7	25,680	
近鉄グループホールディングス	-	7	23,987	
ヤマトホールディングス	6	8	13,786	
山九	1	1	8,957	
センコーグループホールディングス	2	4	5,980	
A Z - C O M 丸和ホールディングス	1	2	2,247	
S Gホールディングス	9	11	16,588	

## 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
NIPPON EXPRESSホールディングス	1	2	18,350	
<b>海運業(1.0%)</b>				
日本郵船	15	14	71,397	
商船三井	11	13	71,240	
川崎汽船	13	15	33,937	
NSユナイテッド海運	0.300	0.400	1,600	
飯野海運	-	2	2,915	
<b>倉庫・運輸関連業(0.0%)</b>				
三井倉庫ホールディングス	0.500	0.700	5,250	
<b>情報・通信業(7.8%)</b>				
NECネットエスアイ	2	2	8,883	
システナ	8	9	3,400	
日鉄ソリューションズ	0.900	2	9,696	
T I S	5	7	28,105	
コーエーテックホールディングス	3	5	8,517	
ネクソン	11	15	32,389	
S H I F T	0.400	0.500	7,590	
ティーガイア	0.600	-	-	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1	1	5,244	
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	12,220	
インターネットイニシアティブ	2	3	11,371	
ラクス	2	3	6,461	
チェンジホールディングス	1	-	-	
ビジョナル	-	0.800	6,299	
野村総合研究所	11	14	67,020	
オービック	1	12	62,272	
ジャストシステム	0.800	1	3,280	
L I N E ヤフー	77	110	45,551	
トレンドマイクロ	2	3	28,926	
日本オラクル	1	1	19,604	
フューチャー	-	1	3,286	
大塚商会	5	7	28,321	
電通総研	0.700	0.700	3,654	
東映アニメーション	1	2	9,841	
デジタルガレージ	0.900	-	-	
ネットワンシステムズ	2	2	13,026	
B I P R O G Y	1	2	9,954	
U-NEXT HOLDINGS	0.600	0.800	3,952	
日本電信電話	1,033	1,836	286,310	
K D D I	41	50	252,190	
ソフトバンク	86	1,100	213,108	

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
光通信	0.500	0.800	26,272	
GMOインターネットグループ	2	2	5,716	
K A D O K A W A	2	-	-	
東宝	3	4	26,285	
NTTデータグループ	14	18	50,976	
D T S	1	-	-	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2	3	21,147	
カプコン	9	13	46,333	
S C S K	3	5	16,114	
N S D	1	2	8,780	
コナミグループ	2	2	37,700	
ソフトバンクグループ	26	-	-	
<b>卸売業(7.1%)</b>				
東京エレクトロン デバイス	-	0.700	2,142	
双日	6	8	24,948	
アルフレッサ ホールディングス	5	-	-	
神戸物産	4	5	19,762	
ダイワボウホールディングス	2	3	10,182	
マクニカホールディングス	1	5	9,833	
シップヘルスケアホールディングス	2	2	6,223	
メディパルホールディングス	5	7	19,453	
I D O M	1	2	2,660	
伊藤忠商事	36	35	273,243	
丸紅	47	60	144,389	
豊田通商	5	21	58,914	
兼松	2	3	8,250	
三井物産	37	76	250,286	
住友商事	34	43	141,723	
三菱商事	86	88	235,808	
キャノンマーケティングジャパン	1	1	6,650	
阪和興業	1	1	6,000	
岩谷産業	1	7	13,737	
稲畑産業	1	2	6,850	
伊藤忠エネクス	1	1	2,890	
サンリオ	-	5	28,797	
加賀電子	0.500	1	4,123	
P A L T A C	0.800	-	-	
ミスミグループ本社	8	11	27,549	
<b>小売業(4.5%)</b>				
ローソン	1	-	-	
エービーシー・マート	2	3	9,833	



## 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
アスクル	1	1	3,187
アダストリア	-	1	3,430
日本マクドナルドホールディングス	3	4	27,676
パルグループホールディングス	-	1	4,960
セリア	1	2	5,812
MonotaRO	8	10	25,564
マツキヨココカラ&カンパニー	10	12	26,624
ZOZO	3	5	25,245
ウエルシアホールディングス	3	3	7,094
クリエイトSDホールディングス	0.800	1	2,881
ネクステージ	1	1	2,534
コスモス薬品	0.500	1	8,120
セブン&アイ・ホールディングス	58	80	208,019
ツルハホールディングス	1	1	12,102
クスリのアオキホールディングス	1	2	7,646
FOOD & LIFE COMPANIES	3	3	12,113
ノジマ	1	2	5,476
良品計画	6	8	25,997
コーナン商事	0.700	-	-
パ・パ・フィック・インターナショナルホールディングス	11	14	54,875
ゼンショーホールディングス	2	4	37,277
ワークマン	0.700	1	3,840
V Tホールディングス	2	-	-
スギホールディングス	3	3	9,913
日本瓦斯	3	3	7,245
ライフコーポレーション	0.600	0.800	2,704
コメリ	0.900	-	-
しまむら	1	1	13,615
丸井グループ	-	4	11,580
イズミ	1	-	-
ヤオコー	0.700	0.900	8,478
ケーズホールディングス	3	-	-
ニトリホールディングス	2	2	45,240
ファーストリテイリング	3	4	203,606
サンドラッグ	1	2	8,268
<b>銀行業(6.6%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	24	33	22,119
コンソルディア・フィナンシャルグループ	28	35	31,161
三菱UFJフィナンシャル・グループ	173	173	315,257
りそなホールディングス	61	83	101,789

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井住友トラストグループ	19	24	87,480
三井住友フィナンシャルグループ	30	77	279,801
千葉銀行	14	20	24,860
ふくおかフィナンシャルグループ	4	5	24,148
セブン銀行	16	24	8,131
みずほフィナンシャルグループ	71	83	315,234
<b>証券、商品先物取引業(1.1%)</b>			
F P G	-	2	7,171
S B Iホールディングス	8	10	38,727
ジャフコ グループ	1	-	-
大和証券グループ本社	41	48	48,783
野村ホールディングス	89	113	105,977
マネックスグループ	5	6	6,586
<b>保険業(3.7%)</b>			
S O M P Oホールディングス	24	33	131,043
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	35	49	174,141
第一生命ホールディングス	25	31	122,112
東京海上ホールディングス	51	46	261,278
<b>その他金融業(1.6%)</b>			
全国保証	1	1	9,747
クレディセゾン	-	4	14,792
芙蓉総合リース	0.500	0.600	6,654
みずほリース	4	5	5,242
東京センチュリー	4	5	7,400
イオンフィナンシャルサービス	3	3	4,849
アコム	9	16	6,336
ジャックス	0.600	0.800	3,028
オリエントコーポレーション	1	-	-
オリックス	31	40	134,257
三菱HCキャピタル	23	33	34,543
日本取引所グループ	13	40	72,762
<b>不動産業(2.2%)</b>			
大東建託	1	2	39,698
ヒューリック	12	15	22,633
野村不動産ホールディングス	3	4	15,913
プレサンスコーポレーション	0.700	-	-
オープンハウスグループ	1	2	14,355
東急不動産ホールディングス	16	20	19,554
飯田グループホールディングス	5	6	14,293
ケイアイスター不動産	0.300	0.400	1,738

## 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
三井不動産	73	93	117,921
三菱地所	34	39	82,305
東京建物	4	5	15,578
住友不動産	7	11	51,513
スターツコーポレーション	0.800	1	4,075
レーサム	-	0.400	2,356
カチタス	1	1	3,722
<b>サービス業(4.1%)</b>			
ジェイエイシーリクルートメント	-	2	1,730
日本M&Aセンターホールディングス	8	10	6,622
UTグループ	0.700	0.900	1,800
パソナグループ	0.700	0.900	1,757
エス・エム・エス	1	2	4,301
パーソルホールディングス	56	65	15,311
総合警備保障	9	11	12,974
カカクコム	3	5	11,821
ディップ	0.800	1	3,067
エムスリー	11	13	19,133
博報堂DYホールディングス	7	8	9,124
H. U. グループホールディングス	1	-	-
オリエンタルランド	-	42	147,420
ラウンドワン	-	6	6,659
ビー・エム・エル	0.700	0.900	2,523
ユー・エス・エス	12	14	20,010
サイバーエージェント	12	15	15,919
フルキャストホールディングス	0.500	-	-
テクノプロ・ホールディングス	3	4	11,248
ジャパンマテリアル	1	2	3,542

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	40	35	335,731
バルシステム24ホールディングス	0.600	0.800	1,028
ペイカレント	4	5	28,818
ジャパリエーターサービスホールディングス	1	2	7,371
アンビスホールディングス	-	1	1,464
リログループ	2	-	-
トランス・コスモス	0.700	0.900	3,105
セコム	5	14	74,088
メイテックグループホールディングス	1	2	7,454
イオンディライト	0.600	0.800	3,516
<b>合計</b>	<b>株数・金額</b>	<b>5,570</b>	<b>18,397,323</b>
	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>398</b>	<b>400 &lt;94.6%&gt;</b>

(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
	百万円	百万円
<b>国内</b>		
<b>TOPIX</b>	1,055	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	18,397,323	94.3
コール・ローン等、その他	1,104,480	5.7
<b>投資信託財産総額</b>	<b>19,501,804</b>	<b>100.0</b>

(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

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>23,826,180,382円</b>
コール・ローン等 株式(評価額)	879,473,808 18,397,323,590
未収入金	38,233,550
未収配当金	185,229,314
差入委託証拠金	4,325,920,120
<b>(B)負債</b>	<b>4,386,321,307</b>
未払解約金	20,036,187
差入委託証拠金代用有価証券	4,366,285,120
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>19,439,859,075</b>
元本	7,576,521,432
次期繰越損益金	11,863,337,643
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>7,576,521,432口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>25,658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 4,978,389,200円

(注2) 期首元本額 6,164,015,149円

期中追加設定元本額 1,962,078,590円

期中一部解約元本額 549,572,307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) 2,862,579,266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 4,713,942,166円

## 損益の状況

当期 (2024年5月21日~2024年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>210,733,151円</b>
受取配当金	210,129,652
受取利息	603,143
その他収益金	356
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 325,125,810</b>
売買益	1,288,567,456
売買損	△ 1,613,693,266
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>△ 28,457,650</b>
取引益	109,234,700
取引損	△ 137,692,350
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 142,850,309</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>9,906,565,674</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>2,959,948,426</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>△ 860,326,148</b>
<b>(H)合計(D+E+F+G)</b>	<b>11,863,337,643</b>
<b>次期繰越損益金(H)</b>	<b>11,863,337,643</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) (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、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) (G)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。