

第5期末 (2022年11月21日)

基準価額	10,887円
純資産総額	126百万円
騰落率	△3.0%
分配金	0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)

【愛称】 ファンドパック日本

追加型投信／国内／資産複合／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5期(決算日 2022年11月21日)

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

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・インデックスパッケージ(国内・株式／リート／債券)」は、このたび第5期の決算を行いました。

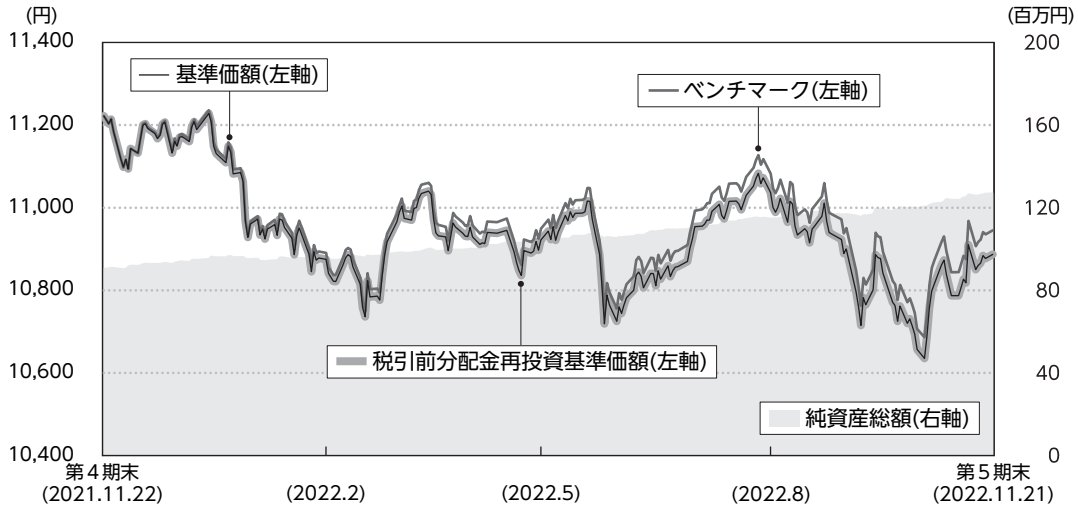
当ファンドは、投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の株式、リート(不動産投資信託)および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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5期首	11,222円	既払分配金	0円
第5期末	10,887円	騰落率(分配金再投資ベース)	△3.0%

- (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)、東証REIT指数(配当込み)をそれぞれ15%ずつ、NOMURA-BPI総合を70%組み合わせて合成したもので、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

当期の基準価額は2022年1月から2月下旬にかけて、米国の利上げ観測が高まったことなどから金利が上昇(債券価格は下落)したことで下落しましたが、2月下旬から3月上旬にかけては、ロシア・ウクライナ情勢の緊迫化などを背景に金利が低下したことで上昇しました。

その後、7月から8月中旬にかけて、日銀による金融政策の現状維持が決定されたことや海外の景気減速懸念を受けて金利が低下したことで上昇しましたが、8月中旬から10月中旬にかけては、パウエル米連邦準備制度理事会(FRB)議長による金融引き締めに向き発言や、欧州中央銀行(ECB)の利上げを受けて金利が上昇したことで下落し、期を通じてみると下落して当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	15%	15.3%	△0.9%
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	15	15.0	△0.7
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	70	69.7	△3.6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	34円	0.309%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,937円です。</p>
(投信会社)	(16)	(0.143)	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)	(16)	(0.143)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.024)	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	0.000	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p>
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
その他費用	1	0.011	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(1)	(0.011)	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	35	0.320	

(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。

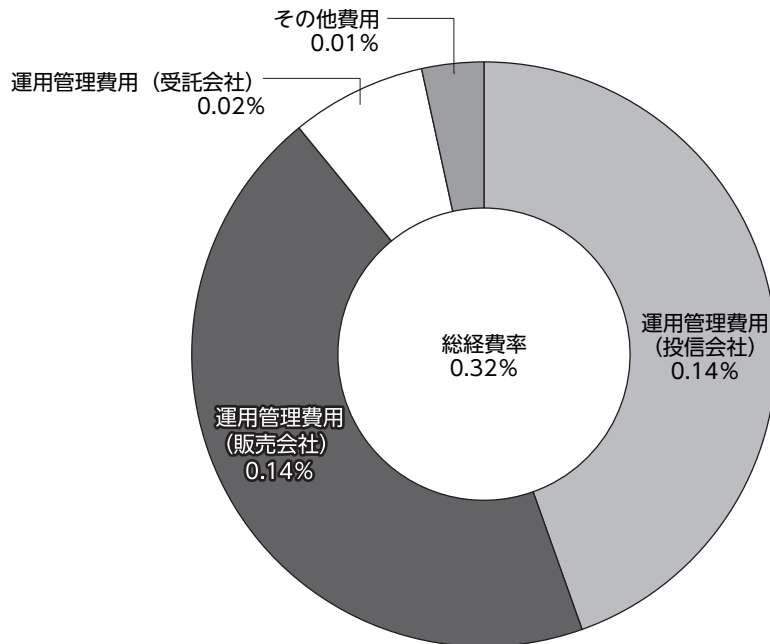
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.32%**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。

投資環境

■ 国内株式市況

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。

■ Jリート市況

当期のJリート市場は期初から2月にかけて、オミクロン型の感染拡大や世界的に金融引き締めが意識されたことによる長期金利の上昇を受けて下落しました。3月中旬以降は円安進行に伴って海外投資家からの資金流入が進んだことや、市場の調整が進行し割安となったバリュエーション（企業の利益・資産など本来の企業価値と比較して、相対的な株価の割高・割安を判断する指標）に注目が集まったことを受けて買い戻されました。9月以降は再び世界的に金融引き締めが意識されたほか、Jリーートの公募増資を受けて需給環境の悪化が懸念されたことで下落しましたが、当期末にかけては、米国におけるインフレ見通しが鈍化したことなどを背景に上昇基調となり当期末を迎えました。

■ 国内債券市況

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初は、オミクロン型の感染拡大への警戒感などから金利は低下する展開となりました。2022年1月になると、米利上げ観測が高まったことなどから上昇に転じましたが、2月中旬以降はロシア・ウクライナ情勢の緊迫化を背景に再び低下しました。

その後、3月中旬以降は各国中央銀行の利上げ発表や日銀の金融政策修正観測も高まり金利は上昇しましたが、7月下旬に日銀が金融政策の現状維持を決定したことに加え、海外の景気後退懸念も強まったことから再び低下しました。8月中旬以降は、パウエルFRB議長による金融引き締めに前向きな発言や9月に開催されたECB理事会で利上げが実施されたことを受けて米金利が上昇し、国内金利も上昇しました。10月以降はおおむね横ばいでの推移となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

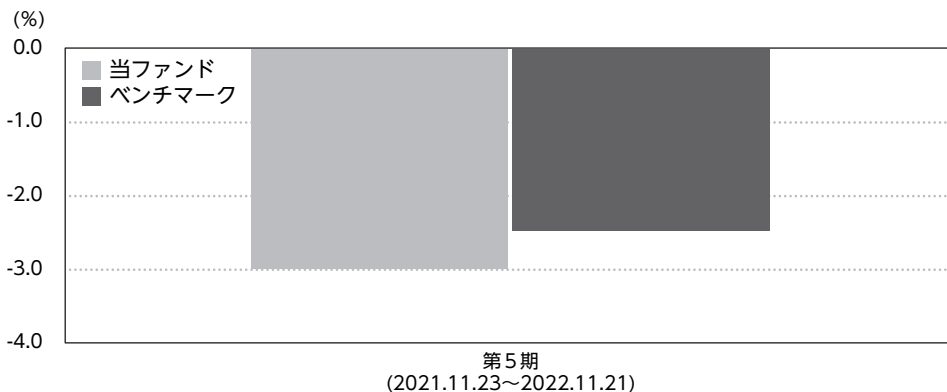
国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合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-3.0%となり、ベンチマーク騰落率(-2.5%)を下回りました。

当ファンドは投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行っています。相場変動による基本投資割合からの変動についてはリバランスを行い基本投資割合に戻しますが、当期の市場変動の中でリバランスに伴って一時的に発生したキャッシュ(未収入金)部分や当ファンドにおいて信託報酬等の費用を控除した影響などがマイナスに働きました。

(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	886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

投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリート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。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債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。

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5期末 2022年11月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	15.3%
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	15.0
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	69.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

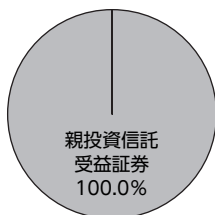
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

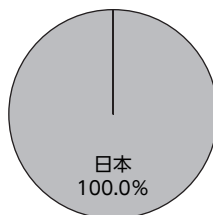
項目	第5期末 2022年11月21日
純資産総額	126,773,131円
受益権総口数	116,445,866口
1万口当たり基準価額	10,887円

(注) 当期間中における追加設定元本額は49,748,629円、同解約元本額は13,794,112円です。

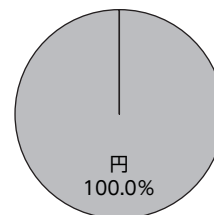
■資産別配分



■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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

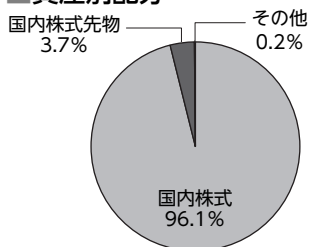
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	4.0%
TOPIX 先物 0403月	円	3.7
ソニーグループ	円	2.7
キーエンス	円	1.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
東京エレクトロン	円	1.3
リクルートホールディングス	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
任天堂	円	1.2
ソフトバンクグループ	円	1.1
組入銘柄数		1,841

■ 1万口当たりの費用明細

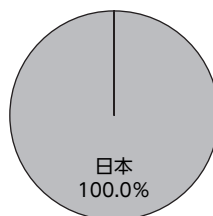
2021.2.23~2022.2.21

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

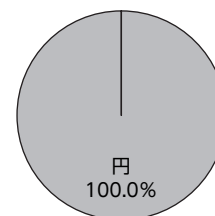
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



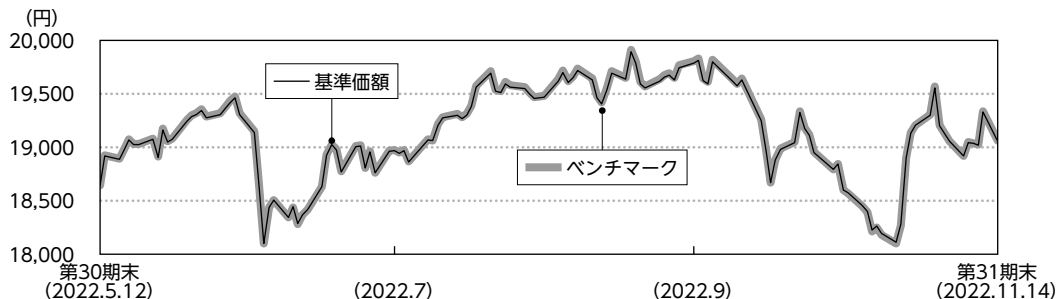
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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2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。

ニッセイJ-REIT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

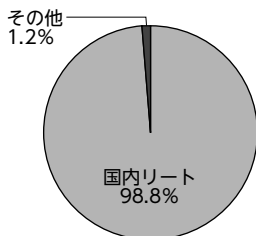
銘柄名	通貨	比率
日本ビルファンド投資法人	円	6.8%
ジャパンリアルエステイト投資法人	円	5.5
日本プロロジスリート投資法人	円	5.0
野村不動産マスターファンド投資法人	円	4.9
日本都市ファンド投資法人	円	4.8
GLP投資法人	円	4.6
大和ハウスリート投資法人	円	4.2
オリックス不動産投資法人	円	3.4
ユナイテッド・アーバン投資法人	円	3.1
アドバンス・レジデンス投資法人	円	3.1
組入銘柄数	61	

■ 1万口当たりの費用明細

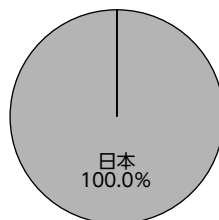
2022.5.13~2022.11.14

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

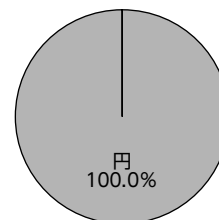
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



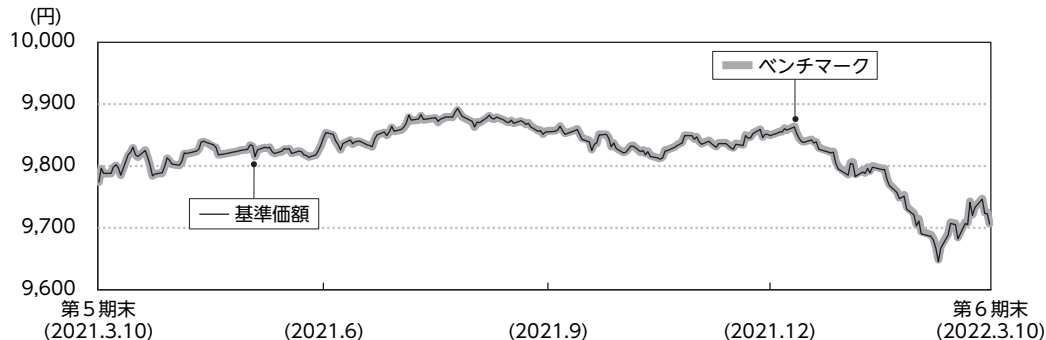
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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14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。

ニッセイ国内債券パッシブ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

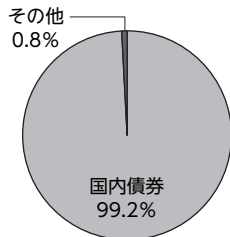
銘柄名	通貨	比率
第350回 利付国債 (10年)	円	1.0%
第 3 回 利付国債 (40年)	円	0.8
第363回 利付国債 (10年)	円	0.8
第361回 利付国債 (10年)	円	0.8
第430回 利付国債 (2年)	円	0.8
第431回 利付国債 (2年)	円	0.8
第364回 利付国債 (10年)	円	0.8
第429回 利付国債 (2年)	円	0.8
第428回 利付国債 (2年)	円	0.8
第340回 利付国債 (10年)	円	0.7
組入銘柄数		355

■ 1万口当たりの費用明細

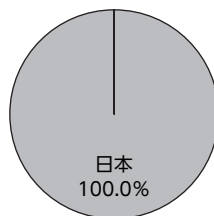
2021.3.11~2022.3.10

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

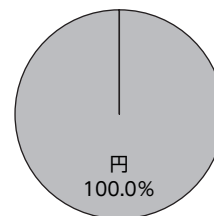
■ 資産別配分



■ 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3月10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。

設定以来の運用実績

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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2017年11月17日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2018年11月20日)	10,114	0	1.1	10,114	10,151	1.5	14.4	0.4	69.3	15.0	10
2期(2019年11月20日)	10,807	0	6.9	10,807	10,893	7.3	14.7	0.4	69.3	14.7	34
3期(2020年11月20日)	10,555	0	△2.3	10,555	10,635	△2.4	15.1	0.6	68.9	14.5	60
4期(2021年11月22日)	11,222	0	6.3	11,222	11,354	6.8	14.6	0.5	68.4	14.6	90
5期(2022年11月21日)	10,887	0	△3.0	10,887	11,074	△2.5	14.9	0.4	69.0	14.8	126

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注3) 「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4) 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」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注7) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
(期首)2021年11月22日	11,222	-	11,354	-	14.6	0.5	68.4	14.6
11月末	11,098	△1.1	11,227	△1.1	13.8	0.6	70.4	14.4
12月末	11,189	△0.3	11,329	△0.2	14.9	0.3	69.0	15.1
2022年1月末	10,959	△2.3	11,100	△2.2	13.8	0.4	70.5	14.5
2月末	10,862	△3.2	11,007	△3.1	14.2	0.6	69.8	14.6
3月末	11,022	△1.8	11,172	△1.6	15.2	0.6	68.1	15.4
4月末	10,940	△2.5	11,095	△2.3	14.3	0.4	69.9	14.5
5月末	10,968	△2.3	11,128	△2.0	14.7	0.4	69.2	14.9
6月末	10,834	△3.5	10,998	△3.1	14.4	0.3	69.8	14.8
7月末	10,991	△2.1	11,163	△1.7	15.0	0.3	68.9	15.0
8月末	11,009	△1.9	11,186	△1.5	14.8	0.3	69.1	14.9
9月末	10,765	△4.1	10,941	△3.6	14.1	0.5	70.0	14.5
10月末	10,861	△3.2	11,046	△2.7	14.8	0.4	69.2	14.9
(期末)2022年11月21日	10,887	△3.0	11,074	△2.5	14.9	0.4	69.0	14.8

(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

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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4,652	10,110	2,044	4,480
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	4,941	9,369	1,951	3,696
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	43,027	41,413	14,233	13,733

(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	129,254,719千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	147,359,205千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.87

(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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5,931	8,540	19,405
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	6,900	9,889	19,011
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	64,432	93,226	88,359

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,542,683千口、ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンドが16,947,494千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,708,390千口です。

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	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	19,405	15.3
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	19,011	15.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	88,359	69.6
コール・ローン等、その他	247	0.2
投資信託財産総額	127,023	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
(A) 資産	127,023,758円
コール・ローン等	178,648
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド (評価額)	19,405,644
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド (評価額)	19,011,035
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド (評価額)	88,359,794
未収入金	68,637
(B) 負債	250,627
未払解約金	65,313
未払信託報酬	179,049
その他未払費用	6,265
(C) 純資産総額 (A-B)	126,773,131
元本	116,445,866
次期繰越損益金	10,327,265
(D) 受益権総口数	116,445,866口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,887円

(注) 期首元本額 80,491,349円
 期中追加設定元本額 49,748,629円
 期中一部解約元本額 13,794,112円

損益の状況

当期 (2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	△ 2,202,277円
売 買 益	663,559
売 買 損	△ 2,865,836
(B) 信託報酬等	△ 337,090
(C) 当期損益金 (A+B)	△ 2,539,367
(D) 前期繰越損益金	3,813,861
(分配準備積立金)	(3,813,861)
(E) 追加信託差損益金*	9,052,771
(配当等相当額)	(6,096,581)
(売買損益相当額)	(2,956,190)
(F) 合計 (C+D+E)	10,327,265
次期繰越損益金 (F)	10,327,265
追加信託差損益金	9,052,771
(配当等相当額)	(6,096,581)
(売買損益相当額)	(2,956,190)
分配準備積立金	3,813,861
繰越欠損金	△ 2,539,367

(注1) (A)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) (B)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) (D)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) (E)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	0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	6,513,404円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	3,813,861円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	10,327,265円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	886.87円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

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

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

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信/国内/資産複合/インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の株式、リート（不動産投資信託）および債券市場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	ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」 「ニッセイ J-R E I T インデックスマザーファンド」 「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」 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
	ニッセイ J-R E I T インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所に上場している Jリート
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	国内の公社債
運用方法	ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の通りとします。 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド…15% ニッセイ J-R E I T インデックスマザーファンド…15% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド…70%
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ J-R E I T 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。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限ります。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 22 期

(計算期間：2021年2月23日～2022年2月21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。



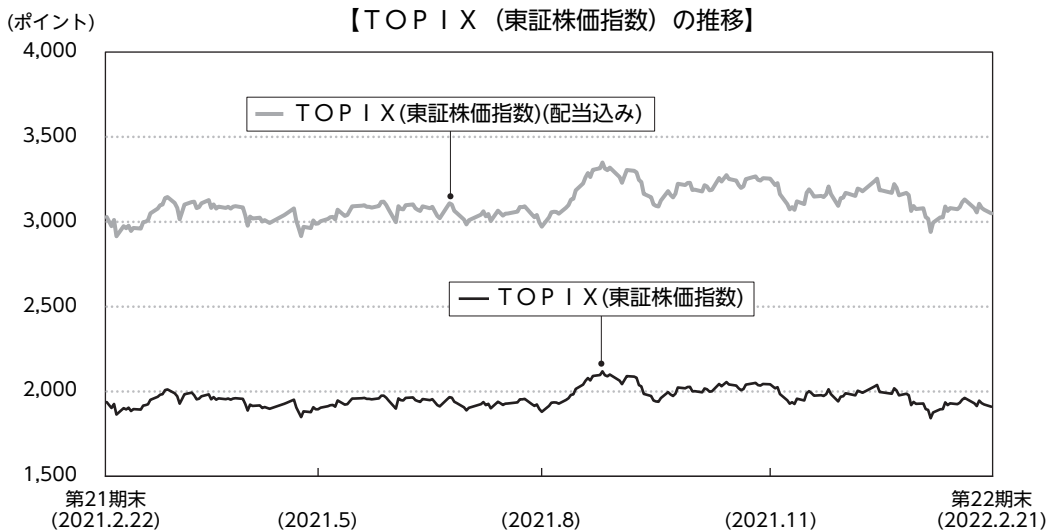
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年2月23日～2022年2月21日

国内株式市況

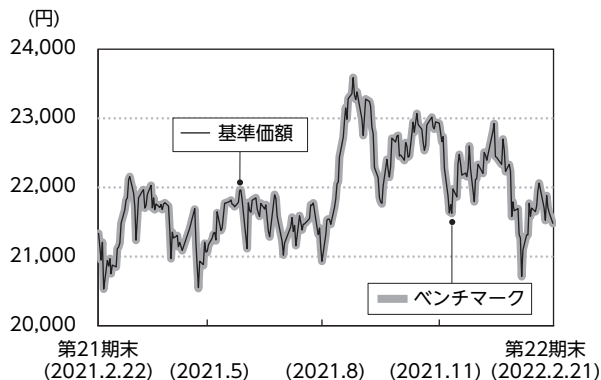


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場はおおむね横ばいとなりました。

期初から8月下旬までは、新型コロナウイルスや米金融政策をめぐるニュースで一喜一憂する展開となりボックス圏での推移となりましたが、その後は良好な企業決算やワクチン接種拡大に伴う景気回復への思惑などから株価は上昇に転じました。9月には菅前首相が自民党総裁選への不出馬を表明したことで新政権に対する期待感から上昇が継続し、約31年ぶりの高値を付けましたが、その後は中国の不動産大手の債務問題やインフレ圧力の高まりによる米連邦準備制度理事会（FRB）の早期利上げ観測などを受け軟調な展開に転じました。年末にかけては国内企業の良好な決算発表が支援材料となる一方で、半導体不足や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株価は一進一退の展開となりました。しかし、年明け以降は米金融政策の転換に伴う利上げ加速への警戒感やウクライナ情勢の緊迫化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、株価は再び軟調な展開となり当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄*に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流入などに対応するため、TOPIX（東証株価指数）先物も一部利用しました。

*東京証券取引所の東証一部、東証二部などの市場は、2022年4月に新しい市場区分への再編が予定されています。これに併せ、TOPIXの算出方法についても変更が予定されています。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+0.7%となり、ベンチマーク騰落率（+0.7%）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等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	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
18期(2018年2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868
19期(2019年2月20日)	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5	58,316
20期(2020年2月20日)	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6	68,225
21期(2021年2月22日)	21,336	18.5	21,558	18.6	99.3	0.7	170,293
22期(2022年2月21日)	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7	117,060

(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
		%		%		
(期首)2021年2月22日	21,336	－	21,558	－	99.3	0.7
2月末	20,530	△3.8	20,743	△3.8	98.3	1.7
3月末	21,701	1.7	21,927	1.7	96.5	3.4
4月末	21,090	△1.2	21,305	△1.2	97.5	2.5
5月末	21,378	0.2	21,599	0.2	97.3	3.0
6月末	21,627	1.4	21,855	1.4	96.6	3.3
7月末	21,158	△0.8	21,379	△0.8	98.2	1.8
8月末	21,827	2.3	22,057	2.3	97.4	2.6
9月末	22,779	6.8	23,017	6.8	95.7	4.2
10月末	22,454	5.2	22,691	5.3	97.3	2.9
11月末	21,632	1.4	21,873	1.5	96.1	4.1
12月末	22,394	5.0	22,627	5.0	98.2	1.8
2022年1月末	21,315	△0.1	21,534	△0.1	97.2	2.8
(期末)2022年2月21日	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年2月23日～2022年2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) (0.002)	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（21,895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

2021年2月23日～2022年2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
		9,593 (2,776)	21,321,180	31,893	78,125,057

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(注2) ()内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	43,239	40,129	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2021年2月23日～2022年2月21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
ソフトバンク	406	625,586	1,538	トヨタ自動車	928	2,571,349	2,770
トヨタ自動車	193	603,803	3,126	ソフトバンクグループ	286	2,165,826	7,549
東芝	131	501,122	3,816	ソニーグループ	167	2,154,577	12,832
リクルートホールディングス	73	497,629	6,816	キーエンス	29	1,848,888	62,887
ソニーグループ	38	470,172	12,276	リクルートホールディングス	192	1,303,706	6,786
三菱商事	118	414,142	3,488	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,999	1,236,815	618
キーエンス	5	360,666	62,183	日本電信電話	352	1,082,458	3,070
東京エレクトロン	6	337,934	51,989	信越化学工業	53	1,035,824	19,217
日本電産	25	321,823	12,522	日本電産	67	871,471	12,910
日本郵政	355	314,383	885	東京エレクトロン	16	860,406	52,145

(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2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
水産・農林業(0.1%)				
極洋	2	2	2	6,730
日本水産	80	58	58	32,175
マルハニチロ	13	9	9	23,468
雪国まいたけ	5	4	4	5,250
カネコ種苗	2	2	2	3,092
サカタのタネ	10	7	7	23,800
ホフト	7	4	4	9,599
鉱業(0.3%)				
住石ホールディングス	2	11	11	1,630
日鉄鉱業	2	1	1	8,281
三井松島ホールディングス	5	2	2	3,931
I N P E X	318	234	234	264,281
石油資源開発	11	6	6	18,492
K&Oエナジーグループ	4	2	2	4,276

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
建設業(2.4%)				
ヒノキヤグループ	2	1	1	3,099
ショーボンドホールディングス	12	8	8	43,409
ミライト・ホールディングス	30	18	18	36,378
タマホーム	5	3	3	8,011
ファーストコーポレーション	5	4	4	3,074
スペースバリューホールディングス	10	6	6	6,984
ダイセキ環境ソリューション	3	-	-	-
安藤・間	55	29	29	27,086
東急建設	25	17	17	12,465
コムシスホールディングス	30	18	18	52,640
ピーアールホールディングス	10	8	8	3,036
高松コンストラクショングループ	5	3	3	7,196
東建コーポレーション	2	1	1	16,596
ソネット	5	2	2	2,987

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマウラ	4	3	3,081
オリエンタル白石	-	19	4,743
大成建設	62	39	148,395
大林組	199	135	130,815
清水建設	187	126	98,670
飛島建設	5	3	4,060
長谷工コーポレーション	65	40	60,782
松井建設	7	5	3,927
銭高組	1	0.800	3,268
鹿島建設	146	98	154,778
不動テトラ	4	2	4,495
大末建設	5	-	-
鉄建建設	4	2	5,579
西松建設	14	8	31,775
三井住友建設	48	30	13,619
大豊建設	4	2	7,350
前田建設工業	50	-	-
佐田建設	9	6	3,033
ナカノフドー建設	10	8	2,984
奥村組	11	8	25,800
東鉄工業	8	6	15,913
浅沼組	2	1	7,980
戸田建設	83	56	43,140
熊谷組	9	6	19,851
北野建設	1	1	3,008
植木組	1	2	3,158
矢作建設工業	8	6	4,698
ピーエス三菱	6	4	2,993
日本ハウスホールディングス	13	9	4,176
大東建託	21	13	176,088
新日本建設	8	5	4,235
NIPPPO	16	11	44,800
東亜道路工業	1	0.700	3,514
前田道路	12	-	-
日本道路	1	1	12,857
東亜建設工業	5	3	8,820
日本国土開発	19	13	6,969
若築建設	3	2	4,365
東洋建設	22	15	8,939
五洋建設	84	53	33,223
世紀東急工業	9	6	5,317

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
福田組	2	1	5,908
住友林業	47	34	78,315
日本基礎技術	8	5	3,596
巴コーポレーション	10	6	3,168
大和ハウス工業	184	124	417,994
ライト工業	11	8	16,507
積水ハウス	216	146	347,480
日特建設	5	4	3,385
北陸電気工事	3	3	2,576
ユアテック	11	7	5,490
日本リーテック	4	2	4,026
四電工	1	1	2,718
中電工	9	6	13,342
関電工	32	21	19,228
きんでん	43	30	49,377
東京エネシス	6	4	4,252
トーエネック	2	1	4,662
住友電設	5	3	7,395
日本電設工業	11	7	11,373
エクシオグループ	30	20	48,537
新日本空調	5	3	7,329
九電工	14	10	32,344
三機工業	14	8	13,217
日揮ホールディングス	66	41	45,468
中外炉工業	2	1	3,003
ヤマト	6	4	2,832
太平電業	4	3	8,064
高砂熱学工業	18	12	24,217
三晃金属工業	1	1	3,032
朝日工業社	1	0.700	2,131
明星工業	12	8	6,298
大気社	9	6	20,229
ダイダン	4	3	6,921
日比谷総合設備	6	4	8,118
テスホールディングス	-	2	3,132
インフロニア・ホールディングス	-	57	61,056
OSJBホールディングス	29	-	-
東洋エンジニアリング	-	5	3,226
レイズネクスト	10	6	7,280
食料品(3.5%)			
ニッポン	18	12	21,369

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清製粉グループ本社	72	48	80,715
昭和産業	5	4	11,070
鳥越製粉	5	4	2,943
中部飼料	7	4	5,105
フィード・ワン	8	5	3,955
日本甜菜製糖	3	2	3,912
DM三井製糖ホールディングス	5	3	7,796
塩水港精糖	18	14	3,059
日新製糖	3	2	3,590
森永製菓	15	10	36,461
中村屋	1	1	3,375
江崎グリコ	17	11	46,112
名糖産業	3	1	3,184
井村屋グループ	3	2	5,414
不二家	4	2	6,040
山崎製パン	48	32	49,960
モロゾフ	1	1	3,823
亀田製菓	3	2	10,287
寿スピリッツ	6	4	26,124
カルビー	29	19	50,510
森永乳業	11	8	44,880
六甲バター	4	3	5,008
ヤクルト本社	44	32	197,120
明治ホールディングス	42	28	196,482
雪印メグミルク	15	10	20,716
プリマハム	9	5	13,111
日本ハム	24	16	72,600
林兼産業	7	5	2,961
丸大食品	6	4	6,505
S F o o d s	5	3	12,558
柿安本店	2	1	3,850
伊藤ハム米久ホールディングス	41	27	19,154
サッポロホールディングス	21	14	35,397
アサヒグループホールディングス	139	101	519,684
キリンホールディングス	271	158	319,505
宝ホールディングス	47	29	34,574
オエノンホールディングス	18	12	4,255
養命酒製造	2	1	3,017
コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス	49	30	45,965
サントリー食品インターナショナル	42	28	135,396
ダイドーグループホールディングス	3	2	11,440

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤園	19	13	87,901
キーコーヒー	6	4	8,698
日清オイリオグループ	8	5	16,173
不二製油グループ本社	15	9	21,018
かどや製油	1	-	-
J-オイルミルズ	3	4	6,968
キッコーマン	46	31	279,589
味の素	152	95	317,109
ブルドックソース	-	1	3,609
キューピー	35	22	55,410
ハウス食品グループ本社	23	16	48,843
カゴメ	26	16	49,774
アリアケジャパン	5	3	22,386
ピエトロ	2	1	3,068
エバラ食品工業	0.900	-	-
ニチレイ	30	19	50,806
東洋水産	32	20	101,947
イートアンドホールディングス	2	1	3,678
大冷	2	1	2,643
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4	4	2,503
日清食品ホールディングス	25	17	156,400
永谷園ホールディングス	3	1	3,828
一正蒲鉾	3	3	3,028
フジッコ	6	4	7,824
ロック・フィールド	6	4	7,473
日本たばこ産業	343	231	538,239
ケンコーマヨネーズ	3	2	3,374
わらべや日洋ホールディングス	4	2	5,132
なとり	3	2	4,968
ビッグラスコーポレーション	1	2	3,175
ファーマフーズ	-	4	6,416
ユーグレナ	27	22	16,588
紀文食品	-	3	3,695
ミヨシ油脂	3	2	2,610
理研ビタミン	6	4	8,010
繊維製品(0.5%)			
片倉工業	8	4	10,758
グンゼ	4	2	10,752
東洋紡	24	16	20,891
ユニチカ	18	11	3,584
富士紡ホールディングス	3	1	6,878

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
倉敷紡績	5	3	6,879
日本毛織	20	12	11,341
帝国繊維	7	4	9,158
帝人	58	39	56,294
東レ	452	305	201,498
サカイオーベックス	1	-	-
日本フェルト	9	6	3,060
イチカワ	3	-	-
アツギ	8	5	3,349
セーレン	15	8	19,117
ソトー	5	3	3,096
東海染工	3	2	3,029
小松マテール	10	6	8,914
ワコールホールディングス	15	10	21,136
ホグメディカル	8	5	18,810
クラウディアホールディングス	16	12	3,022
T S Iホールディングス	19	14	4,512
マツオカコーポレーション	2	2	2,791
ワールド	8	5	6,787
三陽商会	0.400	0.400	350
オンワードホールディングス	37	25	7,387
ゴールドウイン	10	7	45,524
デサント	10	8	23,616
ヤマトインターナショナル	12	10	3,007
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	3	2	10,673
王子ホールディングス	281	176	106,777
日本製紙	27	20	23,189
三菱製紙	11	6	1,890
北越コーポレーション	44	27	20,755
中越パルプ工業	3	-	-
大王製紙	30	20	36,073
阿波製紙	0.200	9	3,003
レンゴー	64	39	34,267
トーモク	3	2	4,495
ザ・パック	4	3	8,640
化学(6.6%)			
北の達人コーポレーション	22	15	3,337
クラレ	98	61	66,882
旭化成	413	279	304,546
昭和電工	47	36	81,947

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友化学	491	309	170,080
住友精化	3	1	6,270
日産化学	34	22	148,621
ラサ工業	2	1	2,867
クレハ	5	3	29,436
多木化学	2	1	7,528
テイカ	4	3	4,085
石原産業	11	7	7,238
片倉コープアグリ	3	2	3,060
日本曹達	8	5	18,117
東ソー	96	60	111,264
トクヤマ	18	13	24,732
セントラル硝子	11	6	14,227
東亜合成	38	24	25,776
大阪ソーダ	6	3	12,168
関東電化工業	14	9	10,865
デンカ	22	15	54,285
信越化学工業	115	72	1,267,724
日本カーバイド工業	3	2	3,176
堺化学工業	4	3	5,988
第一稀元素化学工業	6	3	3,853
エア・ウォーター	63	39	66,912
日本酸素ホールディングス	51	40	92,016
日本化学工業	1	1	3,198
日本パーカラライジング	31	21	21,236
高压ガス工業	9	6	4,616
四国化成工業	8	5	7,903
戸田工業	-	0.900	2,291
ステラケミファ	3	2	5,016
保土谷化学工業	1	1	5,538
日本触媒	11	7	40,328
大日精化工業	5	3	7,703
カネカ	16	10	40,929
三菱瓦斯化学	62	39	77,694
三井化学	53	38	114,057
J S R	62	39	134,013
東京応化工業	10	7	51,912
大阪有機化学工業	5	3	10,746
三菱ケミカルホールディングス	417	281	232,992
K Hネオケム	10	7	19,544
ダイセル	83	60	52,748

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友ベークライト	9	6	32,208
積水化学工業	132	88	171,990
日本ゼオン	56	38	50,578
アイカ工業	17	11	37,323
宇部興産	31	19	43,322
積水樹脂	10	6	12,300
タキロンシーアイ	13	9	5,077
旭有機材	3	2	4,905
ニチバン	3	2	4,472
リケンテクノス	15	10	4,779
大倉工業	2	2	4,105
積水化成成品工業	8	6	2,802
群栄化学工業	1	1	3,505
タイガースポリマー	10	-	-
ダイキョーニシカワ	13	8	5,108
森六ホールディングス	3	2	4,268
恵和	-	1	4,878
日本化薬	38	33	37,416
カーリットホールディングス	6	2	2,001
日本精化	4	3	6,813
扶桑化学工業	4	3	17,024
トリケミカル研究所	5	4	11,936
ADEKA	28	19	50,420
日油	23	14	72,432
新日本理化	15	11	2,760
ハリマ化成グループ	4	3	2,944
花王	152	95	507,130
第一工業製薬	2	1	4,329
石原ケミカル	-	2	2,807
日華化学	4	3	2,660
ニイタカ	1	-	-
三洋化成工業	3	2	12,700
有機合成薬品工業	13	11	3,012
大日本塗料	7	5	4,253
日本ペイントホールディングス	51	158	167,904
関西ペイント	70	43	104,836
中国塗料	15	9	8,979
日本特殊塗料	4	3	2,988
藤倉化成	8	6	2,766
太陽ホールディングス	4	6	18,724
DIC	26	17	47,294

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サカティンクス	13	8	7,854
東洋インキSCホールディングス	13	8	16,821
T & K T O K A	5	-	-
富士フィルムホールディングス	112	75	570,096
資生堂	126	80	541,029
ライオン	82	52	78,832
高砂香料工業	4	3	8,133
マンダム	13	9	12,528
ミルボン	8	5	31,906
ファンケル	23	17	56,637
コーセー	12	8	108,216
コタ	3	2	4,311
シーボン	2	1	3,290
ポーラ・オルビスホールディングス	27	18	34,260
ノビアホールディングス	5	3	19,166
アジュバンホールディングス	4	2	2,977
エステー	4	2	4,370
アグロカネショウ	2	2	2,727
コニシ	10	7	11,054
長谷川香料	11	7	17,353
星光PMC	5	4	2,528
小林製薬	17	12	118,943
荒川化学工業	5	3	4,057
メック	4	3	9,148
日本高純度化学	1	1	3,037
タカラバイオ	16	11	27,402
JCU	7	4	22,056
新田ゼラチン	6	5	3,260
OATアグリオ	3	-	-
デクセリアルズ	17	11	33,152
アース製薬	4	3	19,845
北興化学工業	5	4	3,348
大成ラミック	2	1	3,595
クミアイ化学工業	26	16	12,688
日本農薬	11	7	4,104
アキレス	4	2	3,553
有沢製作所	8	6	6,255
日東電工	40	26	214,760
レック	7	5	5,280
三光合成	5	7	2,718
きもと	-	13	2,848

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
藤森工業	5	3	15,619
前澤化成工業	4	2	3,431
未来工業	2	1	2,888
ウェブロックホールディングス	4	—	—
J S P	3	2	3,972
エフピコ	11	7	25,240
天馬	4	3	8,792
信越ポリマー	9	7	8,369
東リ	17	14	3,178
ニフコ	23	14	50,328
バルカー	5	3	8,907
ユニ・チャーム	135	83	361,465
医薬品(4.9%)			
協和キリン	64	50	154,025
武田薬品工業	530	338	1,182,020
アステラス製薬	552	373	742,854
大日本住友製薬	47	26	33,170
塩野義製薬	80	54	410,348
わかもと製薬	13	5	1,537
あすか製薬	7	—	—
日本新薬	18	11	85,541
中外製薬	199	134	526,151
科研製薬	10	6	28,152
エーザイ	70	51	297,309
ロート製薬	30	22	82,985
小野薬品工業	146	98	282,161
久光製薬	18	11	41,553
持田製薬	8	5	20,979
参天製薬	110	80	103,105
扶桑薬品工業	2	1	3,472
ツムラ	21	13	42,493
日医工	18	13	11,202
キッセイ薬品工業	11	7	18,293
生化学工業	11	7	6,817
栄研化学	11	7	13,216
日水製薬	4	2	2,868
鳥居薬品	4	2	6,805
J C R ファーマ	18	12	25,942
東和薬品	9	6	18,631
富士製薬工業	4	2	2,929
沢井製薬	14	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	11	7	15,272
第一三共	547	338	862,495
キョーリン製薬ホールディングス	14	8	15,738
大幸薬品	7	6	3,906
ダイト	4	2	8,234
大塚ホールディングス	132	89	360,685
大正製薬ホールディングス	15	10	58,344
ペプチドリーム	32	22	46,171
あすか製薬ホールディングス	—	4	5,233
サワイグループホールディングス	—	9	41,595
石油・石炭製品(0.4%)			
日本コークス工業	53	36	4,914
ニチレキ	7	5	7,199
ユシロ化学工業	3	2	2,829
富士石油	18	11	3,162
M O R E S C O	3	2	2,969
出光興産	70	47	144,117
ENEOSホールディングス	959	647	294,204
コスモエネルギーホールディングス	20	12	31,487
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	36	24	43,948
T O Y O T I R E	33	22	36,365
ブリヂストン	169	124	636,616
住友ゴム工業	57	38	45,433
藤倉コンポジット	—	3	2,329
オカモト	3	2	10,413
フコク	5	1	1,558
ニッタ	6	4	12,303
住友理工	12	8	4,971
三ツ星ベルト	7	5	10,977
バンダー化学	11	6	5,878
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	9	6	19,872
A G C	58	39	221,200
日本板硝子	32	20	10,536
日本山村硝子	4	3	3,059
日本電気硝子	23	17	48,855
オハラ	2	—	—
住友大阪セメント	11	8	28,360
太平洋セメント	37	24	56,864
日本ヒューム	5	4	3,010

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本コンクリート工業	13	10	3,259	
三谷セキサン	3	2	12,520	
アジアパイルホールディングス	9	6	2,930	
東海カーボン	62	36	41,045	
日本カーボン	3	2	9,152	
東洋炭素	3	2	8,806	
ノリタケカンパニーリミテド	3	2	10,692	
TOTO	45	30	155,649	
日本碍子	70	46	86,536	
日本特殊陶業	48	32	69,389	
MARUWA	2	1	21,435	
品川リフラクトリーズ	1	1	3,915	
黒崎播磨	1	0.700	3,062	
ヨータイ	4	2	3,407	
イソライト工業	7	2	3,038	
ニッカトー	5	4	2,459	
フジミンコーポレートッド	5	3	22,715	
クニミネ工業	3	2	2,943	
ニチアス	16	10	26,230	
ニチハ	8	6	15,510	
鉄鋼(0.8%)				
日本製鉄	300	190	395,097	
神戸製鋼所	115	79	48,813	
中山製鋼所	11	7	3,269	
合同製鐵	3	2	3,171	
ジェイエフイーホールディングス	182	115	196,305	
東京製鐵	24	14	16,588	
共英製鋼	7	4	7,742	
大和工業	13	8	29,727	
東京鐵鋼	2	2	3,151	
大阪製鐵	3	-	-	
淀川製鋼所	8	5	15,288	
丸一鋼管	20	15	44,831	
モリ工業	1	1	3,300	
大同特殊鋼	10	7	29,295	
日本高周波鋼業	12	9	3,164	
日本冶金工業	4	3	9,030	
山陽特殊製鋼	7	4	9,138	
愛知製鋼	3	2	6,312	
日立金属	59	45	95,196	
大平洋金属	4	2	8,723	

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
新日本電工	40	27	9,425	
栗本鐵工所	2	1	2,924	
三菱製鋼	2	2	3,199	
日亜鋼業	14	11	3,096	
日本精線	1	0.700	3,090	
エンビプロ・ホールディングス	-	1	2,302	
シンニッタン	20	13	2,983	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	9	6	10,707	
日本輕金属ホールディングス	17	10	19,699	
三井金属鋁業	17	11	38,237	
東邦亜鉛	3	2	6,465	
三菱マテリアル	41	28	58,700	
住友金属鋁山	80	54	295,881	
DOWAホールディングス	15	11	56,840	
古河機械金属	10	7	9,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6	4	4,214	
東邦チタニウム	11	7	6,916	
UACJ	9	6	15,359	
CKサンエツ	1	0.900	3,622	
古河電気工業	19	13	31,706	
住友電気工業	220	159	251,536	
フジクラ	76	47	31,112	
昭和電線ホールディングス	6	3	6,870	
東京特殊電線	1	1	2,851	
タツタ電線	11	7	3,382	
平河ヒューテック	3	2	2,930	
リョービ	7	5	5,777	
アーレスティ	10	5	2,084	
アサヒホールディングス	11	17	36,601	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	3	2	3,127	
宮地エンジニアリンググループ	2	1	4,654	
トーカロ	16	11	14,586	
アルファ	4	2	2,948	
SUMCO	80	65	128,444	
川田テクノロジーズ	1	0.900	3,442	
RSTechnologies	2	1	7,350	
東洋製鐵グループホールディングス	40	27	43,034	
ホッカンホールディングス	3	2	3,215	
コロナ	4	3	2,973	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	10	7	15,258
三和ホールディングス	59	40	51,368
文化シャッター	18	13	14,269
三協立山	8	5	3,514
アルインコ	4	3	2,827
L I X I L	86	67	174,460
日本フィルコン	8	5	2,802
ノーリツ	13	8	12,692
長府製作所	6	4	8,522
リンナイ	12	8	76,800
ダイニチ工業	4	3	2,718
日東精工	9	5	2,703
三洋工業	2	1	3,134
岡部	12	8	6,200
ジーテクト	7	5	7,716
東プレ	11	7	9,677
高周波熱錬	12	7	4,537
東京製綱	4	3	3,038
サンコール	6	5	2,607
モリテックスチール	9	8	2,612
パイオラックス	9	6	10,778
エイチワン	6	4	2,956
日本発条	62	39	34,955
立川プラインド工業	3	-	-
三益半導体工業	4	3	8,007
機械(5.2%)			
日本製鋼所	19	12	47,407
三浦工業	27	18	58,052
タクマ	21	14	20,822
ツガミ	13	9	11,938
オークマ	7	5	23,775
芝浦機械	6	4	14,664
アマダ	92	67	69,753
アイダエンジニアリング	16	11	10,811
滝澤鉄工所	4	2	3,130
F U J I	25	19	45,530
牧野フライス製作所	7	4	17,390
オーエスジー	31	19	38,868
ダイジェット工業	3	3	3,216
旭ダイヤモンド工業	16	11	6,417
DMG森精機	39	25	42,782

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソディック	13	9	7,209
ディスコ	8	6	213,885
日東工器	3	2	3,689
日進工具	2	3	4,672
豊和工業	4	3	3,131
東洋機械金属	9	5	3,214
エンシュウ	4	5	3,315
島精機製作所	9	6	11,339
オプトラン	7	5	10,096
NCホールディングス	7	0.500	927
イワキ	5	2	2,759
フリーュー	6	3	3,849
ヤマシンフィルタ	12	8	3,087
日阪製作所	7	5	4,269
やまびこ	12	8	10,897
野村マイクロ・サイエンス	-	1	3,844
平田機工	3	2	10,540
ベガサスミシン製造	12	5	3,026
マルマエ	1	1	4,073
タツモ	2	2	3,150
ナプテスコ	37	24	76,666
三井海洋開発	6	4	5,292
レオン自動機	6	4	4,664
S M C	18	12	850,374
ホソカワミクロン	2	3	7,941
ユニオンツール	2	1	5,744
オイレス工業	8	6	9,336
日精エー・エス・ビー機械	1	1	4,139
サトーホールディングス	8	5	11,205
技研製作所	5	3	13,965
カワタ	4	3	3,027
日精樹脂工業	4	3	3,006
オカダアイオン	3	1	2,703
ワイエイシイホールディングス	-	2	3,100
小松製作所	288	195	531,745
住友重機械工業	36	24	67,576
日立建機	29	17	50,533
日工	9	5	3,613
巴工業	2	1	3,927
井関農機	6	4	4,872
TOWA	5	3	8,561

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸山製作所	2	1	2,867
北川鉄工所	3	2	2,688
ローツェ	2	2	21,861
タカキタ	6	4	2,767
クボタ	334	210	432,180
荏原実業	1	2	4,314
三菱化工機	2	1	2,811
月島機械	11	7	8,231
帝国電機製作所	4	3	4,191
新東工業	15	9	6,650
澁谷工業	5	3	9,264
アイチコーポレーション	11	6	5,239
小森コーポレーション	16	10	8,022
鶴見製作所	4	3	5,890
荏原製作所	26	17	101,135
石井鐵工所	1	1	3,005
西島製作所	6	3	3,740
北越工業	6	4	3,584
ダイキン工業	81	54	1,175,460
オルガノ	2	1	9,288
トーヨーカネツ	2	1	3,844
栗田工業	34	23	110,209
椿本チエイン	9	5	18,396
大同工業	5	3	2,775
木村化工機	-	3	2,948
アネスト岩田	10	6	5,467
ダイフク	35	23	198,606
サムコ	1	1	2,527
加藤製作所	4	3	3,030
タダノ	30	22	22,050
フジテック	21	16	43,088
CKD	14	12	25,654
キトー	5	3	6,201
平和	17	12	23,340
理想科学工業	4	3	7,815
SANKYO	15	9	29,992
日本金銭機械	8	4	2,763
マースグループホールディングス	4	2	4,414
フクシマガリレイ	4	2	11,179
ダイコク電機	4	2	3,107
竹内製作所	10	6	16,913

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アマノ	16	11	25,481
JUKI	8	6	4,056
ジャノメ	5	4	3,091
マックス	8	5	9,752
グローリー	16	11	23,165
新晃工業	5	4	6,880
大和冷機工業	10	6	6,987
セガサミーホールディングス	58	42	91,591
日本ピストンリング	4	2	3,151
リケン	3	1	4,886
TPR	8	5	8,212
ツバキ・ナカシマ	12	9	9,061
ホシザキ	20	12	99,162
大豊工業	-	3	2,656
日本精工	130	81	59,778
NTN	147	92	20,905
ジェイテクト	61	41	42,497
不二越	5	3	15,503
日本トムソン	17	11	6,301
THK	39	24	65,707
ユーシン精機	4	4	2,736
前澤給装工業	2	3	3,136
イーグル工業	7	5	5,633
日本ピラー工業	6	4	12,438
キッツ	19	14	9,729
マキタ	83	52	216,726
三井E&Sホールディングス	24	15	5,564
日立造船	50	36	28,137
三菱重工業	100	67	225,716
IHI	42	26	72,038
スター精密	9	6	9,704
電気機器(17.6%)			
日清紡ホールディングス	39	26	27,378
イビデン	30	22	122,944
コニカミノルタ	129	94	47,144
ブラザー工業	77	52	109,986
ミネベアミツミ	109	74	186,687
日立製作所	306	207	1,243,863
東芝	-	75	339,603
三菱電機	637	430	613,462
富士電機	38	25	156,954

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋電機製造	3	2	2,696
安川電機	68	46	215,989
シンフォニアテクノロジー	8	5	6,656
明電舎	10	7	17,279
オリジン	3	2	2,959
山洋電気	3	1	9,329
デンヨー	5	3	6,345
P H Cホールディングス	-	4	7,599
東芝テック	6	4	22,586
芝浦メカトロニクス	1	0.800	6,144
マブチモーター	17	10	42,218
日本電産	153	111	1,111,089
トレックス・セミコンダクター	3	2	5,467
東光高岳	3	2	3,444
ダブル・スコープ	12	12	13,230
ダイヘン	7	4	19,505
ヤーマン	10	7	6,517
J V Cケンウッド	55	35	6,633
ミマキエンジニアリング	8	3	2,831
I - P E X	3	2	2,932
日新電機	14	10	14,281
大崎電気工業	12	7	3,847
オムロン	53	35	281,638
日東工業	9	5	9,102
I D E C	8	5	12,757
不二電機工業	3	2	2,766
ジーエス・ユアサコーポレーション	22	14	33,530
サクサホールディングス	3	2	3,084
メルコホールディングス	2	1	4,476
日本電気	81	54	280,064
富士通	57	38	625,005
沖電気工業	25	17	15,522
岩崎通信機	-	3	2,937
電気興業	3	2	5,432
サンケン電気	7	4	20,880
アイホン	3	2	5,073
ルネサスエレクトロニクス	274	233	324,892
セイコーエプソン	79	53	98,149
ワコム	46	33	28,390
アルバック	11	7	45,820
E I Z O	5	3	12,094

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジャパンディスプレイ	217	147	6,468
日本信号	14	11	9,691
京三製作所	13	9	3,882
能美防災	8	5	11,519
ホーチキ	4	3	3,760
エレコム	7	9	15,325
パナソニック	679	459	555,051
シャープ	73	49	57,987
アンリツ	38	27	44,984
富士通ゼネラル	19	11	30,033
ソニーグループ	399	269	3,206,733
T D K	30	62	297,024
帝国通信工業	3	-	-
タムラ製作所	22	16	9,976
アルプスアルパイン	52	38	46,062
池上通信機	4	4	2,889
日本電波工業	6	3	4,449
メイコー	-	3	13,475
日本トリム	1	0.900	2,430
ローランドディー・ジー・	3	2	7,097
フォスター電機	6	4	3,323
S M K	1	1	3,052
ヨコオ	4	3	8,396
ホシデン	17	10	12,542
ヒロセ電機	9	6	112,068
日本航空電子工業	14	9	18,285
T O A	7	4	3,528
マクセル	12	8	10,423
古野電気	8	5	5,365
ユニデンホールディングス	2	0.900	3,091
スミダコーポレーション	5	4	3,356
アイコム	2	1	3,772
リオン	2	1	3,326
横河電機	63	43	78,226
新電元工業	2	1	5,072
アズビル	43	25	103,572
東亜ディーケーケー	4	3	3,100
日本光電工業	26	17	55,892
共和電業	10	7	2,804
日本電子材料	2	2	4,384
堀場製作所	12	8	52,480

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドバンテクト	47	32	300,160
小野測器	7	6	2,946
エスパック	5	3	7,122
キーエンス	62	39	2,047,500
日置電機	3	2	13,797
シスメックス	49	36	303,212
日本マイクロニクス	11	7	12,727
メガチップス	6	4	15,220
OBARAGROUP	3	2	6,280
澤藤電機	1	1	2,914
原田工業	4	3	2,973
コーセル	7	5	4,340
イリソ電子工業	5	3	14,760
オプテックスグループ	10	7	11,402
千代田インテグレ	2	1	3,450
アイ・オー・データ機器	-	3	5,058
レーザーテック	28	18	400,113
スタンレー電気	44	30	85,514
岩崎電気	3	1	3,649
ウシオ電機	32	22	41,304
岡谷電機産業	11	9	2,855
エノモト	2	-	-
日本セラミック	6	4	9,960
遠藤照明	7	2	2,825
古河電池	4	3	3,893
双信電機	9	-	-
山一電機	4	3	5,936
図研	4	2	8,366
日本電子	11	9	58,590
カシオ計算機	51	31	40,435
ファナック	55	37	813,645
日本シイエムケイ	13	8	4,989
エンプラス	2	1	2,880
大真空	2	5	6,223
ローム	26	19	177,753
浜松ホトニクス	45	30	174,276
三井ハイテック	6	4	34,272
新光電気工業	21	12	59,913
京セラ	97	60	415,352
太陽誘電	28	20	107,635
村田製作所	187	126	1,004,157

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
双葉電子工業	10	7	4,995
北陸電気工業	4	0.100	129
ニチコン	20	13	16,673
日本ケミコン	6	4	7,785
KOA	8	6	9,191
市光工業	9	5	2,884
小糸製作所	38	23	147,500
ミツバ	11	8	3,152
SCREENホールディングス	11	7	86,700
キャノン電子	5	3	6,286
キャノン	316	213	603,839
リコー	162	119	125,236
象印マホービン	17	11	16,553
MUTOHホールディングス	2	1	3,677
東京エレクトロン	37	27	1,505,322
輸送用機器(8.6%)			
トヨタ紡織	18	17	38,016
芦森工業	4	3	2,986
ユニプレス	10	6	5,209
豊田自動織機	51	34	316,332
モリタホールディングス	10	6	8,604
三櫻工業	8	6	4,278
デンソー	140	94	799,258
東海理化電機製作所	16	11	17,661
川崎重工業	49	31	65,437
日本車輛製造	2	1	3,368
三菱ロジスネクスト	8	5	5,340
近畿車輛	3	3	3,198
日産自動車	751	507	303,655
いすゞ自動車	184	135	221,293
トヨタ自動車	645	2,180	4,738,226
日野自動車	79	53	58,911
三菱自動車工業	236	159	51,805
エフテック	6	5	2,740
武蔵精密工業	14	9	18,000
日産車体	9	6	4,239
新明和工業	18	12	11,407
極東開発工業	11	8	11,808
トピー工業	5	3	3,913
ティラド	3	1	3,028
曙ブレーキ工業	35	23	4,035

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
タチエス	9	7	8,587	
NOK	30	20	25,646	
フタバ産業	16	10	4,352	
K Y B	7	4	13,927	
大同メタル工業	13	8	5,278	
プレス工業	31	21	8,094	
ミクニ	15	9	3,866	
太平洋工業	13	9	9,144	
河西工業	9	10	2,995	
アイシン	46	31	137,812	
マツダ	200	135	125,778	
今仙電機製作所	5	5	3,019	
本田技研工業	501	338	1,241,051	
スズキ	126	98	479,104	
S U B A R U	182	123	243,776	
ヤマハ発動機	90	56	148,705	
T B K	9	-	-	
エクセディ	8	6	11,186	
豊田合成	20	13	31,372	
愛三工業	10	6	5,018	
ヨロズ	5	4	3,892	
エフ・シー・シー	10	7	10,213	
シマノ	23	17	460,526	
テイ・エステック	14	18	28,537	
ジャムコ	6	3	2,514	
精密機器(2.6%)				
テルモ	195	121	442,864	
日機装	20	12	10,087	
日本エム・ディ・エム	3	2	3,910	
島津製作所	82	55	222,708	
JMS	5	5	3,045	
長野計器	4	3	3,971	
ブイ・テクノロジー	3	1	6,697	
東京計器	4	3	3,138	
愛知時計電機	1	1	3,405	
インターアクション	3	2	4,404	
オーバル	4	12	3,348	
東京精密	10	7	34,492	
マニー	25	17	27,000	
ニコン	97	65	82,125	
トプコン	32	20	30,247	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
オリンパス	352	225	523,059	
理研計器	5	3	16,607	
タムロン	5	3	7,623	
HOYA	126	84	1,257,900	
ノーリツ鋼機	5	3	6,981	
エー・アンド・デイ	5	3	3,556	
朝日インテック	67	47	108,040	
シチズン時計	80	50	25,502	
リズム	6	2	3,492	
大研医器	7	-	-	
メニコン	9	14	41,398	
松風	2	1	3,211	
セイコーホールディングス	9	6	14,298	
ニプロ	47	32	35,342	
その他製品(2.4%)				
スノーピーク	3	5	14,274	
パラマウントベッドホールディングス	6	8	16,517	
トランザクション	-	2	2,727	
粧美堂	10	0.200	83	
ニホンフラッシュ	5	3	3,803	
前田工織	7	4	15,157	
永大産業	14	10	3,139	
アートネイチャー	6	4	2,972	
バンダイナムコホールディングス	52	38	300,694	
アイフェイスジャパン	-	4	2,822	
共立印刷	34	21	3,504	
S H O E I	5	4	18,360	
フランスベッドホールディングス	8	5	5,032	
パイロットコーポレーション	11	7	33,908	
萩原工業	3	2	3,396	
トッパン・フォームズ	11	-	-	
フジシールインターナショナル	13	10	18,301	
タカラトミー	28	18	22,806	
広済堂ホールディングス	4	3	3,306	
プロネクサス	5	3	3,567	
ホクシン	37	-	-	
大建工業	4	2	5,577	
凸版印刷	96	65	148,654	
大日本印刷	77	50	150,256	
共同印刷	2	1	3,400	
N I S S H A	13	8	11,932	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
TAKARA&COMPANY	3	2	3,876
アシックス	56	38	85,801
ツツミ	2	1	2,803
ローランド	3	3	12,240
小松ウオール工業	2	1	2,815
ヤマハ	37	25	139,776
河合楽器製作所	1	1	3,565
ピジョン	40	26	60,086
オリバー	1	-	-
キングジム	5	3	3,083
リンテック	13	9	24,048
イトーキ	12	7	2,836
任天堂	36	24	1,428,111
三菱鉛筆	10	7	8,875
タカラスタンダード	13	8	11,979
コクヨ	30	20	32,774
ナカバヤシ	6	5	2,991
グローブライド	3	3	9,994
オカムラ	24	14	17,360
美津濃	6	4	9,769
電気・ガス業(1.2%)			
東京電力ホールディングス	540	322	118,247
中部電力	195	131	149,611
関西電力	241	163	189,196
中国電力	91	67	60,906
北陸電力	58	39	21,985
東北電力	149	100	74,491
四国電力	53	38	31,583
九州電力	140	88	74,951
北海道電力	59	37	18,924
沖縄電力	12	9	12,894
電源開発	50	36	67,968
エフオン	3	2	1,393
イーレックス	9	6	10,483
レノバ	10	8	11,314
東京瓦斯	122	82	191,647
大阪瓦斯	115	78	164,658
東邦瓦斯	31	19	59,241
北海道瓦斯	3	2	3,173
広島ガス	13	8	2,861
西部ガスホールディングス	7	4	10,737

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
静岡ガス	18	11	9,464
メタウォーター	7	4	9,189
陸運業(3.1%)			
SBSホールディングス	4	3	9,696
東武鉄道	66	42	123,058
相鉄ホールディングス	21	13	30,870
東急	160	108	171,913
京浜急行電鉄	81	55	70,231
小田急電鉄	102	64	136,128
京王電鉄	35	22	117,744
京成電鉄	47	30	102,000
富士急行	8	5	20,757
新京成電鉄	1	1	3,049
東日本旅客鉄道	112	75	543,713
西日本旅客鉄道	56	52	265,750
東海旅客鉄道	53	35	570,294
西武ホールディングス	76	56	69,294
鴻池運輸	10	6	8,024
西日本鉄道	17	11	31,606
ハマキョウレックス	4	3	8,697
サカイ引越センター	2	2	8,950
近鉄グループホールディングス	60	40	146,064
阪急阪神ホールディングス	80	51	179,010
南海電気鉄道	28	18	43,388
京阪ホールディングス	26	18	55,783
神戸電鉄	1	1	3,410
名古屋鉄道	49	33	71,355
山陽電気鉄道	4	3	6,187
アルプス物流	-	2	3,053
日本通運	20	-	-
ヤマトホールディングス	84	57	124,820
山九	15	10	42,693
丸全昭和運輸	4	3	10,527
センコーグループホールディングス	33	20	19,176
トナミホールディングス	1	1	3,810
ニッコンホールディングス	20	13	29,852
日本石油輸送	1	0.500	1,320
福山通運	7	6	27,470
セイノーホールディングス	45	27	33,832
神奈川中央交通	1	1	3,570
日立物流	13	7	47,005

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸和運輸機関	12	8	9,038
C&Fロジホールディングス	6	4	5,108
九州旅客鉄道	46	31	81,144
S Gホールディングス	114	77	193,809
NIPPONEXPRESSホールディングス	-	14	103,353
海運業(0.6%)			
日本郵船	50	34	347,479
商船三井	35	22	207,016
川崎汽船	18	12	96,012
N S ユナイテッド海運	2	2	9,119
明治海運	-	4	4,503
飯野海運	28	18	16,310
乾汽船	4	2	7,324
空運業(0.4%)			
日本航空	147	93	221,127
ANAホールディングス	162	103	270,655
パスコ	1	0.700	917
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	1	1	7,942
日新	4	3	5,662
三菱倉庫	20	13	35,932
三井倉庫ホールディングス	6	4	10,296
住友倉庫	21	14	30,729
澁澤倉庫	3	2	5,335
東陽倉庫	13	9	2,962
日本トランスシティ	13	9	5,553
ケイヒン	3	-	-
中央倉庫	-	3	2,940
安田倉庫	5	3	3,237
東洋埠頭	3	2	3,183
宇徳	9	-	-
上組	33	22	49,100
キューソー流通システム	2	-	-
近鉄エクスプレス	11	7	22,707
東海運	13	9	2,987
エーアイティー	2	2	3,658
内外トランスライン	3	1	3,016
日本コンセプト	-	1	2,620
情報・通信業(7.9%)			
NEC ネットズエスアイ	20	14	24,612
クロスキャット	3	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システナ	22	60	23,275
デジタルアーツ	3	2	13,800
日鉄ソリューションズ	9	6	21,533
キューブシステム	3	0.900	816
コア	2	1	2,739
ラクーンホールディングス	4	3	3,351
ソリトンシステムズ	3	-	-
ソフトクリエイトホールディングス	2	1	7,335
T I S	62	40	104,135
電算システム	2	-	-
グリーン	38	25	20,927
コーエーテックモホールディングス	12	13	53,797
三菱総合研究所	2	1	6,678
電算	1	-	-
AGS	5	3	2,692
ファンデックス	5	3	2,498
ブレインパッド	1	3	3,498
K L a b	11	7	3,064
ポルトワイン・ビットクルーホールディングス	8	6	6,276
イーブックイニシアティブジャパン	1	-	-
ネクソン	158	95	239,012
アイスタイル	19	12	2,438
エムアップホールディングス	1	4	4,326
エイチーム	4	3	2,410
エニグモ	5	4	3,100
テクノスジャパン	6	5	2,464
コロプラ	20	13	8,757
ブロードリーフ	31	20	6,855
クロス・マーケティンググループ	11	-	-
デジタルハーツホールディングス	-	1	2,794
システム情報	4	3	3,528
メディアドゥ	2	1	3,640
じげん	15	11	3,546
ブイキューブ	3	4	3,259
サイバーリンクス	2	2	2,610
フィックスターズ	6	4	3,051
CARTAHOLDINGS	3	1	4,000
オプティム	4	2	2,537
セレス	2	1	1,981
SHIFT	2	2	41,832
ティーガイア	6	3	6,378

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セック	1	-	-
日本アジアグループ	6	-	-
テクマトリックス	9	7	11,054
プロシップ	2	-	-
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15	11	32,637
GMOペイメントゲートウェイ	13	8	83,558
ザッパラス	8	5	2,607
インターネットイニシアティブ	16	11	38,476
さくらインターネット	6	5	2,821
ヴェインクス	3	3	3,398
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1	0.900	3,753
S R Aホールディングス	3	2	5,726
朝日ネット	5	5	3,044
e B A S E	7	5	3,090
アバント	6	4	4,698
アドソル日進	2	1	2,721
フリービット	4	2	2,592
コムチュア	5	4	12,981
サイバーコム	2	2	2,438
アステリア	4	3	2,118
アイル	3	2	2,978
マークラインズ	2	2	5,512
メディカル・データ・ビジョン	7	5	5,379
g u m i	8	5	3,203
モバイルファクトリー	3	-	-
テラスカイ	2	1	2,427
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2	2	2,893
P R T I M E S	1	1	2,882
ラクス	-	14	24,273
ランドコンピュータ	3	3	2,992
ダブルスタンダード	0.900	1	2,360
オープンドア	3	2	4,860
アカツキ	2	1	5,287
Ub i c o mホールディングス	1	1	2,246
カナミックネットワーク	5	6	2,841
ノムラシステムコーポレーション	-	10	2,408
チェンジ	8	7	12,565
シンクロ・フード	11	8	2,270
オークネット	3	2	3,379
キャピタル・アセット・プランニング	-	4	3,184
AOITYHOLDINGS	9	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マクロミル	12	8	10,130
ビーグリー	-	1	2,228
オロ	2	1	3,135
ユーザーローカル	1	1	2,502
マネーフォワード	-	6	28,704
電算システムホールディングス	-	1	4,683
プロトコーポレーション	5	4	5,530
ハイマックス	3	2	3,291
野村総合研究所	114	81	308,856
サイバネットシステム	4	4	2,633
C Eホールディングス	6	6	2,963
インテージホールディングス	7	5	9,322
東邦システムサイエンス	4	2	2,679
ソースネクスト	29	18	2,821
インフォコム	5	4	9,250
シンプレクス・ホールディングス	-	4	7,015
H E R O Z	1	2	2,042
ラクスル	5	4	14,076
F I G	16	8	2,388
イーソル	3	4	2,361
アルテリア・ネットワークス	6	5	6,953
E D U L A B	0.600	-	-
ウイングアーク1 s t	-	2	2,908
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2	-	-
サーバーワークス	-	0.900	2,071
トビラシステムズ	3	3	3,042
S a n s a n	-	15	14,730
ギフトィ	2	3	3,169
ベース	-	0.700	3,486
J M D C	-	4	21,920
フォーカスシステムズ	4	3	2,697
クレスコ	4	3	5,499
フジ・メディア・ホールディングス	64	40	51,078
オービック	19	13	234,878
ジャストシステム	8	6	31,980
T D Cソフト	5	3	4,088
Zホールディングス	859	614	342,489
トレンドマイクロ	33	22	133,114
I Dホールディングス	3	3	2,801
日本オラクル	12	8	69,918
アルファシステムズ	1	1	4,086

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
フューチャー	7	8	11,819	
CACHoldings	4	2	3,242	
S Bテクノロジー	2	1	4,530	
トーセ	5	4	3,019	
オービックビジネスコンサルタント	6	4	16,620	
伊藤忠テクノソリューションズ	28	19	55,814	
アイティフォー	8	5	3,972	
東計電算	1	0.600	2,985	
大塚商会	33	22	97,096	
サイボウズ	7	5	7,207	
電通国際情報サービス	7	6	22,661	
ACCESS	5	4	2,788	
デジタルガレージ	10	7	27,335	
イーエムシステムズ	10	7	4,942	
ウェザーニューズ	1	1	9,880	
C I J	4	3	2,747	
ビジネスエンジニアリング	1	0.800	2,872	
日本エンタープライズ	17	16	2,769	
WOWOW	3	2	3,496	
スカラ	5	4	2,948	
IMAGI CAGROUP	10	-	-	
ネットワンシステムズ	25	16	44,291	
システムソフト	44	-	-	
アルゴグラフィックス	4	3	10,477	
マーベラス	9	6	4,917	
エイベックス	10	7	9,957	
日本ユニシス	21	13	40,062	
兼松エレクトロニクス	3	2	8,958	
都築電気	2	2	3,047	
TBSホールディングス	41	25	48,547	
日本テレビホールディングス	52	35	46,878	
朝日放送グループホールディングス	6	4	3,183	
テレビ朝日ホールディングス	19	10	15,983	
スカパーJ SATホールディングス	41	35	15,895	
テレビ東京ホールディングス	4	3	6,360	
日本BS放送	3	2	2,769	
ビジョン	7	7	8,308	
USEN-NEXTHOLDINGS	2	4	9,296	
コネクシオ	3	3	4,173	
日本通信	55	35	6,072	
日本電信電話	731	441	1,471,527	

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
KDDI	501	308	1,168,244	
ソフトバンク	568	639	941,785	
光通信	7	5	70,950	
エムティーアイ	6	4	2,275	
GMOインターネット	22	15	36,945	
ファイバーゲート	2	2	3,230	
アйдマーケティングコミュニケーション	9	10	3,013	
KADOKAWA	16	23	57,957	
学研ホールディングス	8	6	6,006	
ゼンリン	11	6	7,410	
インプレスホールディングス	22	13	2,727	
アイネット	3	2	2,783	
松竹	4	2	32,704	
東宝	36	24	118,897	
東映	2	1	23,968	
エヌ・ティ・ティ・データ	166	112	239,962	
ピー・シー・エー	0.900	2	3,550	
ビジネスブレイン太田昭和	2	1	2,251	
DT S	13	8	22,080	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26	19	109,138	
シーイーシー	6	4	4,905	
カプコン	26	39	112,196	
アイ・エス・ビー	3	2	2,842	
ジャステック	4	2	3,036	
S C S K	14	29	55,859	
日本システムウエア	2	1	3,340	
アイネス	6	3	5,798	
T K C	5	7	21,584	
富士ソフト	6	4	24,885	
N S D	20	13	29,063	
コナミホールディングス	22	15	104,346	
福井コンピュータホールディングス	2	1	5,776	
J B C Cホールディングス	4	2	4,193	
ミロク情報サービス	6	3	5,165	
ソフトバンクグループ	496	253	1,307,028	
卸売業(5.8%)				
オルパヘルスケアホールディングス	2	2	3,056	
伊藤忠食品	1	1	5,030	
エレマテック	5	3	3,627	
J A L U X	-	1	3,069	
あらた	5	3	13,260	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
	千株	千株	千円	千円
トーメンデバイス	1	0.600	3,708	
東京エレクトロンデバイス	2	1	6,968	
双日	346	46	91,634	
アルフレッサホールディングス	65	47	82,519	
横浜冷凍	16	11	10,317	
ラサ商事	4	3	3,042	
アルコニックス	6	5	7,123	
神戸物産	43	32	124,033	
ハイパー	-	5	2,618	
あいホールディングス	9	6	10,870	
ディーブイエックス	4	2	2,934	
ダイワボウホールディングス	5	20	36,462	
マクニカ・富士エレホールディングス	15	10	26,593	
ラクト・ジャパン	2	1	3,058	
グリムス	1	1	4,039	
バイタルケーエスケーホールディングス	10	7	5,979	
八洲電機	4	3	2,963	
メディアスホールディングス	5	3	2,824	
レスターホールディングス	6	4	7,908	
ジュテックホールディングス	4	2	3,321	
OCHIホールディングス	3	2	3,121	
TOKAIホールディングス	30	20	18,593	
Cominix	5	4	2,980	
三洋貿易	6	4	4,368	
ビューティガレージ	1	-	-	
ウイン・パートナーズ	4	3	3,236	
シップヘルスケアホールディングス	11	13	31,293	
明治電機工業	2	2	2,505	
コメダホールディングス	13	9	19,799	
アセンテック	2	3	2,166	
協栄産業	3	1	2,670	
フルサト・マルカホールディングス	-	4	9,635	
ヤマエグループホールディングス	-	2	2,951	
小野建	5	4	6,650	
南陽	-	1	3,116	
佐鳥電機	5	-	-	
伯東	3	2	6,117	
コンドーテック	4	3	3,369	
中山福	7	8	3,523	
ナガイレーベン	8	5	12,012	
三菱食品	6	4	12,915	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
	千株	千株	千円	千円
松田産業	4	3	7,049	
第一興商	9	8	28,880	
メディパルホールディングス	62	45	95,905	
S P K	3	2	2,742	
萩原電気ホールディングス	2	1	3,339	
アズワン	4	6	40,626	
スズデン	3	1	3,468	
シモジマ	3	2	2,659	
ドウシシャ	5	4	6,188	
小津産業	2	1	3,007	
高速	3	2	3,802	
丸文	7	3	2,634	
ハピネット	5	3	5,561	
橋本総業ホールディングス	1	1	3,012	
日本ライフライン	20	12	13,066	
マルカ	2	-	-	
I DOM	21	12	8,475	
進和	3	2	5,062	
ダイトロン	2	1	3,220	
シークス	8	6	6,893	
田中商事	6	4	3,022	
オーハシテクニカ	3	2	3,137	
白銅	3	1	3,574	
ダイコー通産	2	-	-	
伊藤忠商事	439	296	1,136,781	
丸紅	619	418	517,104	
高島	2	-	-	
長瀬産業	35	23	43,244	
蝶理	4	2	4,274	
豊田通商	63	42	214,704	
三共生興	9	5	3,197	
兼松	25	15	22,230	
三井物産	509	329	1,012,597	
日本紙パルプ商事	3	2	9,152	
カメイ	8	5	5,210	
OUGホールディングス	1	1	2,993	
スターゼン	2	3	6,584	
山善	24	17	18,156	
椿本興業	1	0.900	3,703	
住友商事	396	267	508,172	
内田洋行	2	1	8,730	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱商事	382	317	1,290,179
第一実業	2	1	8,189
キャノンマーケティングジャパン	15	10	25,893
西華産業	3	2	3,526
佐藤商事	5	3	4,287
菱洋エレクトロ	4	2	5,340
東京産業	6	3	2,722
ユアサ商事	6	4	11,944
神鋼商事	2	0.900	3,465
阪和興業	12	8	27,837
正栄食品工業	4	2	11,245
カナデン	5	3	3,451
菱電商事	4	3	5,987
フルサト工業	3	-	-
岩谷産業	15	10	54,672
ナイス	-	1	3,124
昭光通商	6	-	-
極東貿易	-	1	2,692
アステナホールディングス	8	6	2,579
三愛石油	15	10	9,703
稲畑産業	15	9	23,157
明和産業	9	3	4,344
ヤマエ久野	4	-	-
ワキタ	12	9	9,000
東邦ホールディングス	20	13	25,486
サンゲツ	16	11	17,684
ミツウロコグループホールディングス	9	6	6,466
シナネンホールディングス	2	1	5,272
伊藤忠エネクス	13	9	9,635
サンリオ	17	13	31,793
サンワテクノス	4	2	3,507
リョーサン	6	4	10,889
新光商事	8	6	5,868
トーホー	2	2	2,652
三信電気	3	2	3,390
東陽テクニカ	6	4	4,498
モスフードサービス	8	5	16,884
加賀電子	5	3	11,951
ソーダニッカ	7	4	3,263
立花エレテック	4	3	5,399
フォーバル	5	3	2,694

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
PALTAC	10	5	26,255
三谷産業	9	9	2,961
西本Wismettacホールディングス	-	1	2,815
国際紙パルプ商事	17	9	3,375
ヤマタネ	3	2	3,250
丸紅建材リース	2	1	2,992
日鉄物産	4	3	15,990
泉州電業	1	1	7,512
トラスコ中山	14	8	22,290
オートボックスセブン	23	14	20,434
モリト	6	4	2,997
加藤産業	9	6	19,062
イノテック	3	2	3,715
イエローハット	11	7	12,047
J Kホールディングス	5	3	3,600
日伝	5	3	7,822
北沢産業	15	12	2,887
杉本商事	3	2	4,312
因幡電機産業	16	11	29,617
東テク	2	1	3,409
ミスミグループ本社	78	53	191,786
タキヒヨー	2	1	2,422
蔵王産業	3	1	2,833
スズケン	26	16	59,843
ジェコス	4	3	2,980
小売業(4.3%)			
ローソン	15	9	45,637
サンエー	4	3	13,120
カワチ薬品	4	3	7,939
エービーシー・マート	9	6	34,452
ハードオフコーポレーション	5	4	3,280
アスクル	5	6	11,674
ゲオホールディングス	8	5	8,618
アダストリア	8	4	7,999
ジーフット	10	-	-
くら寿司	3	4	16,698
キャンドウ	3	2	4,132
アイケイ	-	7	2,978
バルグループホールディングス	5	3	5,912
エディオン	26	19	23,283
サーラコーポレーション	12	8	5,529

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハローズ	2	1	5,249
フジオフードグループ本社	5	3	4,741
あみやき亭	1	1	3,020
大黒天物産	1	1	6,566
ハニーズホールディングス	5	3	3,485
アルペン	4	3	6,851
ハブ	-	4	2,736
クオールホールディングス	8	5	6,718
ジンズホールディングス	3	2	18,937
ビックカメラ	37	25	25,376
DCMホールディングス	38	26	29,003
MonotaRO	44	53	117,384
東京一番フーズ	7	5	3,054
きちりホールディングス	7	-	-
アークランドサービスホールディングス	5	3	6,987
J. フロントリテイリング	75	50	52,118
ドトール・日レスホールディングス	9	7	11,723
マツキヨココカラ&カンパニー	26	26	118,102
ブロンコピリー	3	2	5,378
ZOZO	37	29	95,776
トレジャー・ファクトリー	5	3	2,941
物語コーポレーション	1	2	15,272
ココカラファイン	5	-	-
三越伊勢丹ホールディングス	109	74	71,751
Hamee	2	0.300	340
ウエルシアホールディングス	33	22	69,216
クリエイトSDホールディングス	9	6	19,719
丸善CHIホールディングス	11	8	3,124
ミサワ	5	4	2,717
ティーライフ	3	2	2,961
チムニー	3	-	-
シュッピン	4	3	3,976
オイシックス・ラ・大地	6	6	15,957
ネクステージ	10	8	22,170
ジョイフル本田	18	12	19,294
鳥貴族ホールディングス	2	-	-
ホットランド	4	3	4,208
すかいらーくホールディングス	70	54	81,776
SFPホールディングス	2	2	2,971
綿半ホールディングス	4	3	4,227
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18	12	13,001

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	4	2	2,776
BEENOS	2	2	3,070
あさひ	4	3	4,571
日本調剤	3	2	3,590
コスモス薬品	6	4	67,768
オンリー	9	-	-
セブン&アイ・ホールディングス	245	165	949,943
クワイート・レストランズ・ホールディングス	33	22	16,611
ツルハホールディングス	13	9	84,640
サンマルクホールディングス	5	3	5,382
フェリシモ	3	2	2,604
トリドールホールディングス	15	10	27,037
TOKYOBASE	9	4	2,165
ウイルプラスホールディングス	-	3	2,712
JMホールディングス	4	2	5,167
アレンザホールディングス	3	3	3,382
パロックジャパンリミテッド	5	3	2,975
クスリのアオキホールディングス	6	4	29,232
FOOD&LIFECOMPANIES	34	24	93,124
メディカルシステムネットワーク	7	5	2,616
ノジマ	11	6	17,595
カッパ・クリエイト	8	5	8,118
ライトオン	6	3	2,776
良品計画	83	48	86,083
アドヴァングループ	6	4	4,042
アルビス	2	1	3,101
コナカ	13	9	3,177
G-7ホールディングス	3	4	7,933
イオン北海道	8	7	8,580
コジマ	10	7	4,007
ヒマラヤ	4	3	3,103
コーナン商事	8	6	22,020
エコス	2	1	3,126
ワタミ	8	5	4,850
マルシェ	8	-	-
バ・バフィカ・インターナショナルホールディングス	125	84	159,084
西松屋チェーン	13	9	12,610
ゼンショーホールディングス	33	20	56,076
幸楽苑ホールディングス	4	2	3,852
サイゼリヤ	9	6	18,225
VTホールディングス	23	16	7,856

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フジ・コーポレーション	－	2	3,060
ユナイテッドアローズ	7	4	7,792
ハイデイ日高	9	6	10,498
YU-WACREATIONHOLDINGS	19	14	2,974
コロワイド	20	17	30,154
ピーシーデポコーポレーション	7	9	2,735
壱番屋	4	3	13,845
スギホールディングス	12	8	54,485
薬王堂ホールディングス	2	2	5,065
スクロール	9	6	6,077
ヨンドシーホールディングス	5	3	6,727
木曾路	8	5	12,443
S R S ホールディングス	7	5	4,773
千趣会	－	7	2,864
リテールパートナーズ	7	5	5,997
ケーヨー	11	7	6,856
上新電機	7	4	10,231
日本瓦斯	10	20	35,802
ロイヤルホールディングス	11	7	14,242
東天紅	4	3	2,948
いなげや	7	5	7,388
島忠	4	－	－
チヨダ	6	4	3,075
ライフコーポレーション	4	4	11,832
リンガーハット	7	5	11,554
MrMaxHD	8	5	3,201
テンアライド	12	－	－
AOKIホールディングス	12	8	5,002
オークワ	9	6	6,418
コメリ	9	6	18,044
青山商事	14	8	6,494
しまむら	7	4	49,392
はせがわ	14	－	－
高島屋	45	30	35,874
松屋	13	8	6,120
エイチ・ツー・オーリテイリング	29	20	17,366
近鉄百貨店	2	1	4,147
丸井グループ	53	33	76,849
アクシアルリテイリング	5	3	10,840
イオン	241	163	426,343
イズミ	12	7	24,640

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
平和堂	11	7	15,545
フジ	7	5	10,704
ヤオコー	7	4	31,536
ゼビオホールディングス	7	5	5,498
ケーズホールディングス	55	39	48,992
日産東京販売ホールディングス	－	13	3,078
GenkyDrugStores	2	1	7,087
ナルミヤ・インターナショナル	－	3	3,171
ブックオフグループホールディングス	4	2	2,987
アインホールディングス	9	6	40,114
元気寿司	1	1	3,120
ヤマダホールディングス	210	155	62,930
アークランドサカモト	9	6	10,190
ニトリホールディングス	24	16	277,620
グルメ杵屋	4	3	3,549
愛眼	18	17	3,145
吉野家ホールディングス	20	14	35,446
松屋フーズホールディングス	3	2	7,300
サガミホールディングス	8	6	7,936
関西フードマーケット	4	3	3,545
王将フードサービス	4	2	16,912
プレナス	7	4	9,381
ミニストップ	4	3	4,445
アークス	12	8	17,755
パローホールディングス	12	9	20,623
ベルク	3	1	10,089
大庄	4	－	－
ファーストリテイリング	8	5	367,137
サンドラッグ	23	15	50,880
サックスパーホールディングス	7	5	2,912
ヤマザワ	－	1	2,988
やまや	1	1	3,076
ベルーナ	13	9	6,615
銀行業(5.5%)			
島根銀行	6	5	3,052
じもとホールディングス	5	4	3,205
めぶきフィナンシャルグループ	326	220	61,988
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7	5	10,992
九州フィナンシャルグループ	128	86	35,893
ゆうちょ銀行	178	100	101,602
富山第一銀行	15	10	3,264

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
コンソルディア・フィナンシャルグループ	383	242	118,825	
西日本フィナンシャルホールディングス	41	27	23,351	
関西みらいフィナンシャルグループ	29	-	-	
三十三フィナンシャルグループ	5	3	5,935	
第四北越フィナンシャルグループ	10	6	18,650	
ひろぎんホールディングス	92	62	42,881	
おきなわフィナンシャルグループ	-	3	9,165	
十六フィナンシャルグループ	-	5	13,833	
北國フィナンシャルホールディングス	-	3	12,909	
新生銀行	51	27	59,887	
あおぞら銀行	37	23	64,203	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,301	2,662	1,968,001	
りそなホールディングス	683	486	260,836	
三井住友トラスト・ホールディングス	118	80	333,887	
三井住友フィナンシャルグループ	435	293	1,257,010	
千葉銀行	209	141	109,675	
群馬銀行	129	81	32,476	
武蔵野銀行	9	6	12,152	
千葉興業銀行	17	11	3,229	
筑波銀行	26	-	-	
七十七銀行	19	13	20,694	
青森銀行	4	3	6,369	
秋田銀行	3	2	4,687	
山形銀行	7	4	4,795	
岩手銀行	4	2	5,457	
東邦銀行	56	35	7,894	
みちのく銀行	4	3	3,311	
ふくおかフィナンシャルグループ	56	35	85,311	
静岡銀行	153	103	93,060	
十六銀行	7	-	-	
スルガ銀行	55	37	16,777	
八十二銀行	141	95	42,064	
山梨中央銀行	7	4	4,429	
大垣共立銀行	12	8	17,262	
福井銀行	5	3	5,313	
北國銀行	5	-	-	
清水銀行	2	1	3,114	
富山銀行	1	1	3,865	
滋賀銀行	12	8	18,096	
南都銀行	9	6	14,051	
百五銀行	56	40	14,647	

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
京都銀行	22	15	84,816	
紀陽銀行	22	14	22,334	
ほくほくフィナンシャルグループ	41	26	25,625	
山陰合同銀行	39	25	17,337	
中国銀行	54	33	30,815	
鳥取銀行	3	1	2,012	
伊予銀行	83	56	35,750	
百十四銀行	6	4	8,064	
四国銀行	8	6	5,265	
阿波銀行	9	6	15,047	
大分銀行	3	2	4,900	
宮崎銀行	3	2	6,064	
佐賀銀行	3	2	3,758	
沖縄銀行	5	-	-	
琉球銀行	13	9	7,912	
セブン銀行	210	126	31,146	
みずほフィナンシャルグループ	854	543	864,456	
山口フィナンシャルグループ	78	49	36,432	
長野銀行	3	2	3,175	
名古屋銀行	5	3	10,000	
北洋銀行	94	64	17,152	
愛知銀行	2	1	7,237	
中京銀行	2	1	2,943	
大光銀行	3	2	3,397	
愛媛銀行	8	5	5,787	
京葉銀行	26	18	9,412	
栃木銀行	30	20	4,776	
北日本銀行	2	1	3,309	
東和銀行	11	7	4,321	
トモニホールディングス	48	32	11,611	
フィデアホールディングス	61	3	5,506	
池田泉州ホールディングス	72	48	9,223	
証券、商品先物取引業(0.8%)				
F P G	19	14	12,512	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3	3	3,785	
S B Iホールディングス	77	52	159,558	
ジャフコグループ	9	16	27,669	
大和証券グループ本社	470	318	219,865	
野村ホールディングス	960	648	348,926	
岡三証券グループ	53	33	13,059	
丸三証券	18	12	6,892	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東洋証券	27	15	2,433	
東海興フィナンシャル・ホールディングス	67	48	20,496	
光世証券	6	6	2,903	
水戸証券	16	11	3,164	
いちよし証券	12	7	5,237	
松井証券	30	20	16,993	
マネックスグループ	56	34	17,715	
極東証券	8	5	4,400	
岩井コスモホールディングス	6	4	5,664	
アイザワ証券グループ	11	7	6,286	
スパークス・グループ	29	19	5,115	
保険業(2.3%)				
かんぽ生命保険	77	42	88,773	
SOMPOホールディングス	110	69	372,128	
アニコムホールディングス	17	13	10,010	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	152	95	379,086	
第一生命ホールディングス	332	209	551,446	
東京海上ホールディングス	208	139	983,213	
T&Dホールディングス	187	110	195,164	
アドバンスクリエイト	1	2	2,407	
その他金融業(1.2%)				
全国保証	16	10	48,783	
ジェイリース	-	1	2,610	
イントラスト	5	3	1,943	
アルヒ	9	6	6,438	
プレミアグループ	2	2	8,736	
クレディセゾン	36	27	37,046	
芙蓉総合リース	6	4	34,650	
みずほリース	9	6	20,930	
東京センチュリー	14	8	46,740	
日本証券金融	26	16	15,130	
アイフル	105	71	25,845	
リコーリース	4	3	14,421	
イオンフィナンシャルサービス	38	23	28,644	
アコム	126	83	27,067	
ジャックス	6	4	15,345	
オリエントコーポレーション	170	114	14,247	
日立キャピタル	14	-	-	
オリックス	390	257	610,470	
三菱HCキャピタル	141	156	96,275	
九州リースサービス	6	5	3,010	

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
日本取引所グループ	169	107	235,693	
イー・ギャランティ	7	6	12,889	
アサックス	5	4	2,885	
NECキャピタルソリューション	2	1	3,706	
不動産業(2.0%)				
いちご	70	47	13,196	
日本駐車場開発	62	46	6,477	
スター・マイカ・ホールディングス	3	2	2,849	
SREホールディングス	-	1	3,590	
ADワークスグループ	26	19	2,707	
ヒューリック	133	101	108,193	
三栄建築設計	2	1	2,745	
野村不動産ホールディングス	38	22	62,524	
三重交通グループホールディングス	12	8	4,042	
サムティ	8	6	14,511	
ディア・ライフ	9	5	2,843	
コーセーアールイー	6	4	2,365	
地主	4	2	4,814	
プレサンスコーポレーション	10	5	10,274	
日本管理センター	3	2	2,963	
サンセイランディック	5	0.200	161	
エストラスト	5	4	2,592	
フージャースホールディングス	10	5	3,731	
オープンハウスグループ	19	13	67,500	
東急不動産ホールディングス	171	125	83,066	
飯田グループホールディングス	52	35	77,667	
イーグランド	5	1	2,604	
ムゲンエステート	9	6	2,928	
ファーストブラザーズ	-	3	2,696	
AndDoホールディングス	3	3	2,912	
ケイアイスター不動産	2	1	9,500	
グッドコムアセット	3	2	3,067	
ジェイ・エス・ビー	-	0.700	2,247	
パーク24	33	22	40,310	
三井不動産	286	193	501,908	
三菱地所	413	279	505,966	
平和不動産	10	7	29,090	
東京建物	62	41	76,090	
ダイビル	16	10	23,716	
京阪神ビルディング	10	6	9,939	
住友不動産	141	89	324,234	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
テーオーシー	12	7	5,282	
東京楽天地	1	0.700	2,772	
レオパレス21	52	44	9,460	
スターツコーポレーション	7	5	14,819	
フジ住宅	7	4	3,229	
空港施設	8	5	3,024	
ゴールドクレスト	5	3	6,128	
エスリード	1	1	3,193	
日神グループホールディングス	10	6	3,505	
日本エスコン	11	7	5,988	
タカラレーベン	26	17	5,696	
AVANTIA	4	3	2,845	
イオンモール	31	21	35,358	
毎日コムネット	6	-	-	
ファースト住建	3	2	2,992	
カチタス	15	10	34,230	
トーセイ	8	5	6,354	
穴吹興産	2	1	2,940	
サンフロンティア不動産	7	5	6,372	
FJネクストホールディングス	6	4	4,187	
グランディハウス	10	6	3,489	
日本空港ビルデング	20	16	89,910	
サービス業(5.6%)				
日本工営	3	2	7,190	
LIFULL	21	12	3,011	
ミクシィ	11	9	21,056	
ジェイエイシーリクルートメント	4	3	5,897	
日本M&Aセンターホールディングス	49	67	113,805	
メンバーズ	1	1	3,452	
UTグループ	8	5	20,148	
アイティメディア	2	1	2,984	
タケエイ	6	-	-	
夢真ビーネックスグループ	7	10	16,895	
コシダカホールディングス	14	11	6,985	
アルトナー	4	3	3,062	
パソナグループ	6	4	11,056	
CDS	3	1	2,896	
リンクアンドモチベーション	11	9	3,940	
GCA	8	-	-	
エス・エム・エス	20	14	42,910	
サニーサイドアップグループ	6	4	2,924	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
パーソルホールディングス	60	41	102,873	
リニカル	5	-	-	
クックパッド	19	12	3,276	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6	4	2,891	
学情	3	2	2,900	
スタジオアリス	3	1	3,951	
シミックホールディングス	3	2	3,470	
NJS	2	1	3,013	
総合警備保障	24	16	69,454	
カカクコム	45	30	77,100	
アイロムグループ	2	1	3,438	
セントケア・ホールディング	4	3	3,190	
ルネサンス	4	2	3,152	
ディップ	9	7	24,912	
デジタルホールディングス	4	2	4,500	
新日本科学	7	5	7,690	
ツクイホールディングス	14	-	-	
ベネフィット・ワン	22	15	36,825	
エムスリー	107	72	290,472	
ツカダ・グローバルホールディング	15	10	3,302	
アウトソーシング	34	23	30,916	
ウェルネット	8	6	2,905	
ワールドホールディングス	2	1	3,323	
ディー・エヌ・エー	25	15	27,223	
博報堂DYホールディングス	84	57	86,981	
ぐるなび	10	6	2,870	
タカミヤ	7	-	-	
ジャパンベストレスキューシステム	5	-	-	
ファンコミュニケーションズ	16	10	4,243	
ライク	2	-	-	
ビジネス・ブレイクスルー	9	7	3,024	
エスプール	15	11	11,426	
WDBホールディングス	2	1	5,069	
手間いらず	-	0.600	2,982	
アドウェイズ	7	6	3,916	
バリユーコマース	4	3	10,640	
インフォマート	61	45	27,871	
JPホールディングス	17	12	2,757	
EPSホールディングス	8	-	-	
CLホールディングス	2	2	2,167	
プレステージ・インターナショナル	22	15	10,780	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アミューズ	3	2	4,615
ドリームインキュベータ	3	1	4,810
クイック	3	2	4,418
TAC	16	13	3,028
ケネディクス	17	-	-
電通グループ	68	42	203,732
ぴあ	1	1	4,550
イオンファンタジー	2	1	3,332
シーティーエス	6	4	3,716
ネクシィーズグループ	4	4	2,459
H. U. グループホールディングス	17	10	32,528
アルプス技研	5	3	7,038
日本空調サービス	6	4	3,388
オリエンタルランド	64	48	1,028,133
ダスキン	14	9	26,353
明光ネットワークジャパン	7	5	3,015
ファルコホールディングス	2	2	4,012
秀英予備校	9	7	3,081
ラウンドワン	20	11	15,076
リゾートトラスト	27	18	37,251
ビー・エム・エル	7	5	17,304
りらいあコミュニケーションズ	9	6	6,386
リソー教育	30	18	7,332
早稲田アカデミー	4	2	2,802
ユー・エス・エス	68	46	90,309
東京個別指導学院	6	4	2,932
サイバーエージェント	37	101	151,187
楽天グループ	283	211	204,115
クリーク・アンド・リバー社	3	2	3,678
モーニングスター	-	7	4,161
テー・オー・ダブリュー	15	9	2,791
山田コンサルティンググループ	4	2	3,000
セントラルスポーツ	2	1	3,613
フルキャストホールディングス	5	3	7,955
エン・ジャパン	10	6	19,232
テクノプロ・ホールディングス	12	24	81,303
インターワークス	11	7	2,790
アイ・アールジャパンホールディングス	2	1	6,992
Keeper 技研	3	2	5,673
三機サービス	4	2	2,929
Gunosy	5	2	2,317
イー・ガーディアン	2	1	4,309
リブセンス	17	17	2,992
ジャパンマテリアル	18	12	21,772
ベクトル	7	5	6,368

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウチヤマホールディングス	12	9	3,078
チャーム・ケア・コーポレーション	4	3	3,298
キャリアリンク	2	2	3,261
IBJ	5	3	2,696
アサンテ	2	1	2,809
N・フィールド	5	-	-
バリューHR	2	1	3,939
M&Aキャピタルパートナーズ	5	3	16,847
ライドオンエクスプレスホールディングス	2	1	2,608
ERIホールディングス	6	-	-
アビスト	1	1	2,911
シグマクシス・ホールディングス	3	2	5,072
ウィルグループ	4	3	3,618
メドピア	2	3	9,072
リクルートホールディングス	436	317	1,473,223
エラン	8	5	5,352
日本郵政	460	537	520,718
バルシステム24ホールディングス	10	5	8,077
鎌倉新書	6	4	2,410
SMN	5	4	2,732
一蔵	12	-	-
LITALICO	2	-	-
エアトリ	3	2	8,653
アトラエ	1	2	5,727
ストライク	2	1	6,952
ソラスト	14	10	10,392
セラク	2	-	-
インソース	5	4	7,656
バイカレント・コンサルティング	4	2	123,830
OrchestraHoldings	-	0.800	2,168
MS-Japan	3	3	2,608
グレイステクノロジー	3	-	-
シャバエレベーターサービスホールディングス	17	13	19,318
グリーンズ	9	-	-
GAMEWITH	-	6	2,963
ウェルビー	-	2	3,213
ミダックホールディングス	1	1	4,181
日総工産	5	3	2,883
キュービネットホールディングス	3	1	3,233
RPAホールディングス	7	8	2,879
スプリックス	5	-	-
マネジメントソリューションズ	3	2	6,150
プロレド・パートナーズ	1	2	2,192
andfactory	5	7	3,017
カープスホールディングス	16	11	7,898

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フォーラムエンジニアリング	－	3	3,159
ダイレクトマーケティングミックス	2	4	7,012
ポピンズホールディングス	－	1	2,247
L I T A L I C O	－	3	9,471
リログループ	33	22	38,520
東祥	3	3	5,294
T R Eホールディングス	－	5	8,562
人・夢・技術グループ	－	1	3,022
エイチ・アイ・エス	8	9	18,509
ラックランド	1	1	3,384
共立メンテナンス	10	7	32,083
イチネンホールディングス	6	4	5,464
建設技術研究所	3	2	5,800
スペース	5	3	3,024
燦ホールディングス	3	－	－
東京テアトル	3	2	2,968
タナベ経営	3	4	2,824
ナガワ	1	1	12,584
東京都競馬	4	3	12,555
カナモト	10	7	16,617
東京ドーム	24	－	－
西尾レントオール	5	3	10,681
トランス・コスモス	5	5	16,406
乃村工藝社	26	17	16,649
藤田観光	－	1	4,318
KNT-CTホールディングス	－	2	3,913
日本管財	6	4	12,320
トーカイ	5	3	6,732

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セコム	60	40	354,132
セントラル警備保障	2	2	4,720
丹青社	11	8	6,106
メイテック	7	5	34,750
応用地質	7	4	9,503
船井総研ホールディングス	12	8	18,328
進学会ホールディングス	8	10	3,905
学究社	3	1	3,123
ベネッセホールディングス	22	13	32,304
イオンディライト	7	5	15,504
ナック	4	3	3,053
ダイセキ	10	7	33,150
ステップ	2	1	2,953
合計	株数・金額	66,696	47,173 112,497,641
	銘柄数<比率>	1,853	1,840 <96.1%>

(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	百万円	百万円
内 TOPIX	4,378	－

(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2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	112,497,641	95.9
コール・ローン等、その他	4,842,548	4.1
投資信託財産総額	117,340,189	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

(2022年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	117,322,043,462円
コール・ローン等	4,404,203,781
株式(評価額)	112,497,641,670
未収配当金	174,543,011
差入委託証拠金	245,655,000
(B)負債	261,046,172
未払金	84,335,950
未払解約金	176,705,800
その他未払費用	4,422
(C)純資産総額(A-B)	117,060,997,290
元本	54,493,461,224
次期繰越損益金	62,567,536,066
(D)受益権総口数	54,493,461,224口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,482円

(注1) 期首元本額 79,813,755,893円
 期中追加設定元本額 23,632,095,039円
 期中一部解約元本額 48,952,389,708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	5,837,157,491円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,537,763,643円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,656,374円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,113,704,346円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,082,250,932円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,253,789,188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)	4,978,524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)	16,544,754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)	16,615,142円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,071,087,533円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	21,344,932,487円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,132,535,408円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	201,061,345円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	208,072,492円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	241,020,671円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	473,144,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	49,277,264円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	98,857,796円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,457,971円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,013,941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)	4,293,106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)	6,605,585円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	26,854,982円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	136,468,048円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	100,987,893円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	224,574,567円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	205,595,072円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	4,063,776,492円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/スケット)	19,506,730円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型)	80,115円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型)	166,146円
FWニッセイ国内株インデックス	485,273円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	145,285円

損益の状況

当期(2021年2月23日~2022年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	3,131,277,457円
受取配当金	3,132,392,288
受取利息	71,510
その他収益	929,647
支払利息	△ 2,115,988
(B)有価証券売買損益	189,595,162
売買益	14,642,750,879
売買損	△ 14,453,155,717
(C)先物取引等損益	7,511,400
取引益	595,388,800
取引損	△ 587,877,400
(D)信託報酬等	△ 95,813
(E)当期損益金(A+B+C+D)	3,328,288,206
(F)前期繰越損益金	90,480,120,612
(G)追加信託差損益金	28,088,108,591
(H)解約差損益金	△ 59,328,981,343
(I)合計(E+F+G+H)	62,567,536,066
次期繰越損益金(I)	62,567,536,066

(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。

ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド

運用報告書

第 31 期

(計算期間：2022年5月13日～2022年11月14日)

運用方針	<p>①国内の金融商品取引所に上場しているJリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。</p> <p>②Jリートへの投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証REIT指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜追加・見直しを行います。</p>	運用方法	<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">・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。・外貨建資産への投資は行いません。
主要運用対象	国内の金融商品取引所に上場しているJリート		



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13日～2022年11月14日

Jリート市況

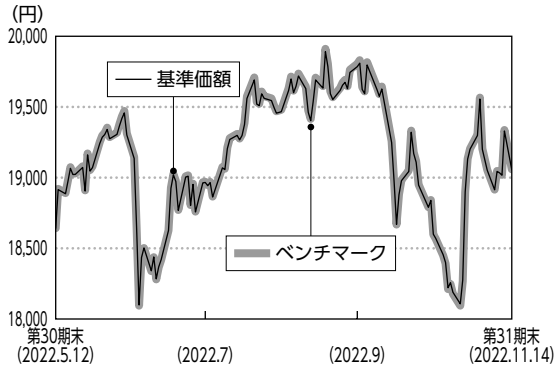


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

Jリート市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初は米長期金利の上昇が一服する中、相対的に利回りが高く業績の安定性が高いJリートへの資金流入が生じたことを受けて上昇しましたが、6月中旬以降は米連邦準備制度理事会（FRB）による積極的な利上げ観測が高まったことを背景に国内外で長期金利が上昇したため下落しました。その後、米国の過度な金融引き締め見通しが後退したことを受けて世界的に金利が低下したことからJリート市場は上昇基調となりました。9月以降は世界的に金融引き締めが意識されて長期金利が上昇したことや連続したJリートの公募増資を受けて需給環境の悪化が懸念されたことで下落しましたが、10月下旬以降は米国におけるインフレ見通しが鈍化したことを背景とした金利の低下を受けて上昇し、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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「Ｊリート市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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した。

ポートフォリオの構築・運用は、東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+2.2%となり、ベンチマーク騰落率(+2.2%)に連動しました。

今後の運用方針

東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄について完全法にて投資を行い、ベンチマークの動きに連動する成果を目標に運用を行います。

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	投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
27期 (2020年11月12日)	15,624	6.6	15,237	6.7	98.4	25,271
28期 (2021年 5月12日)	19,030	21.8	18,608	22.1	98.6	31,319
29期 (2021年11月12日)	19,395	1.9	18,966	1.9	98.4	32,023
30期 (2022年 5月12日)	18,642	△ 3.9	18,222	△ 3.9	98.1	31,255
31期 (2022年11月14日)	19,056	2.2	18,630	2.2	98.8	32,174

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

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	投資信託証券 組入比率
		%		%	
(期首) 2022年 5月12日	18,642	－	18,222	－	98.1
5月末	19,286	3.5	18,864	3.5	98.6
6月末	18,972	1.8	18,550	1.8	98.8
7月末	19,560	4.9	19,134	5.0	98.3
8月末	19,786	6.1	19,361	6.2	98.2
9月末	18,978	1.8	18,556	1.8	98.2
10月末	19,298	3.5	18,869	3.6	98.6
(期末) 2022年11月14日	19,056	2.2	18,630	2.2	98.8

(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13日～2022年11月14日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	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
(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	0	0.000	

(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（19,142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13日～2022年11月14日

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.040	4,797	0.021	2,655
サンケイリアルエステート投資法人	0.064	6,182	0.032	3,059
S O S I L A 物流リート投資法人	0.085	12,682	0.048	6,788
東海道リート投資法人	0.144	17,843	0.008	926
日本アコモデーションファンド投資法人	0.060	39,109	0.038	24,447
森ヒルズリート投資法人	0.206	31,484	0.129	18,780
産業ファンド投資法人	0.456	80,860	0.145	24,682
アドバンス・レジデンス投資法人	0.176	61,473	0.110	37,020
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.127	26,974	0.075	15,224
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.093	38,912	0.073	29,198
G L P 投資法人	0.965	149,493	0.785	130,942
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.080	25,919	0.050	16,005
日本プロロジスリート投資法人	0.286	94,521	0.172	54,505
星野リゾート・リート投資法人	0.052	34,121	0.020	13,227
Oneリート投資法人	0.032	8,492	0.018	4,646
イオンリート投資法人	0.199	30,406	0.324	48,657
ヒューリックリート投資法人	0.164	26,637	0.095	14,721
日本リート投資法人	0.099	36,324	0.031	11,094
積水ハウス・リート投資法人	0.533	42,544	0.324	24,675
トーセイ・リート投資法人	0.072	9,807	0.021	2,695
ケネディクス商業リート投資法人	0.171	46,436	0.042	11,007
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.044	7,519	0.024	3,678
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.135	17,067	0.023	2,980
野村不動産マスターファンド投資法人	0.567	93,175	0.355	56,900
いちごホテルリート投資法人	0.030	2,886	0.019	1,729
ラサールロジポート投資法人	0.215	35,974	0.135	22,347
スターアジア不動産投資法人	0.802	46,321	0.107	6,250
マリモ地方創生リート投資法人	0.042	5,631	0.012	1,605
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.069	35,452	0.040	20,114
大江戸温泉リート投資法人	0.028	1,903	0.017	1,136
投資法人みらい	0.214	10,555	0.124	5,969

国内

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.040	5,189	0.025	3,087
三菱地所物流リート投資法人	0.203	89,126	0.029	12,493
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.069	13,744	0.043	8,212
ザイマックス・リート投資法人	0.030	3,731	0.017	2,074
タカラレーベン不動産投資法人	0.196	21,208	0.043	4,783
アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.202	28,865	0.042	6,196
日本ビルファンド投資法人	0.204	136,407	0.126	84,471
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.174	107,872	0.109	65,878
日本都市ファンド投資法人	0.884	93,439	0.553	56,368
オリックス不動産投資法人	0.350	65,287	0.219	38,848
日本プライムリアルティ投資法人	0.119	47,267	0.073	28,355
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	0.169	24,939	0.098	14,041
東急リアル・エステート投資法人	0.116	22,465	0.072	13,368
グローバル・ワン不動産投資法人	0.113	12,311	0.094	9,867
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.395	57,894	0.248	33,966
森トラスト総合リート投資法人	0.126	17,743	0.079	10,772
インヴィンシブル投資法人	0.772	33,374	0.483	18,959
フロンティア不動産投資法人	0.118	62,470	0.036	18,153
平和不動産リート投資法人	0.217	32,212	0.070	9,761
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.117	36,718	0.073	22,429
福岡リート投資法人	0.090	14,909	0.056	9,042
ケネディクス・オフィス投資法人	0.053	35,946	0.078	53,278
	(0.857)			
いちごオフィスリート投資法人	0.142	12,040	0.089	7,243
大和証券オフィス投資法人	0.036	24,880	0.029	19,007
阪急阪神リート投資法人	0.081	12,152	0.051	7,327
スターツプロシード投資法人	0.027	6,544	0.017	3,944
大和ハウスリート投資法人	0.269	82,651	0.154	44,663
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.986	67,180	0.314	19,626
大和証券リビング投資法人	0.333	37,883	0.144	16,106
ジャパンエクセレント投資法人	0.151	19,387	0.121	14,991

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は分割、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) 口数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、口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14日現在

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	□数	□数	評価額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.574	0.593	67,720
サンケイリアルエステート投資法人	0.903	0.935	86,674
S O S I L A 物流リート投資法人	1	1	188,504
東海道リート投資法人	0.218	0.354	42,763
日本アコモデーションファンド投資法人	0.985	1	628,368
森ヒルズリート投資法人	3	3	542,283
産業ファンド投資法人	4	4	691,773
アドバンス・レジデンス投資法人	2	2	994,697
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2	2	445,386
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	653,730
G L P 投資法人	9	9	1,465,129
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	1	426,776
日本プロロジスリート投資法人	4	4	1,594,130
星野リゾート・リート投資法人	0.478	0.510	348,840
O n e リート投資法人	0.495	0.509	124,755
イオンリート投資法人	3	3	509,213
ヒューリックリート投資法人	2	2	463,384
日本リート投資法人	0.880	0.948	344,124
積水ハウス・リート投資法人	8	8	702,994
トーセイ・リート投資法人	0.596	0.647	86,374
ケネディクス商業リート投資法人	1	1	338,302
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.699	0.719	135,962
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.646	0.758	89,065
野村不動産マスターファンド投資法人	9	9	1,579,251
いちごホテルリート投資法人	0.472	0.483	49,072
ラサールロジポート投資法人	3	3	589,215
スターアジア不動産投資法人	2	3	201,402
マリモ地方創生リート投資法人	0.334	0.364	49,285
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1	1	579,456
大江戸温泉リート投資法人	0.460	0.471	31,651
投資法人みらい	3	3	166,390
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.669	0.684	95,281
三菱地所物流リート投資法人	0.828	1	459,918
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1	1	228,938
ザイマックス・リート投資法人	0.460	0.473	56,523
タカラレーベン不動産投資法人	1	1	127,288

ニッセイ J-REIT インデックス マザー ファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1	1	184,312
日本ビルファンド投資法人	3	3	2,201,741
ジャパンリアルエステイト投資法人	2	2	1,758,951
日本都市ファンド投資法人	14	14	1,558,742
オリックス不動産投資法人	5	5	1,085,287
日本プライムリアルティ投資法人	1	1	771,067
NTT都市開発リート投資法人	2	2	403,215
東急リアル・エステート投資法人	1	1	404,305
グローバル・ワン不動産投資法人	1	1	221,889
ユナイテッド・アーバン投資法人	6	6	1,006,064
森トラスト総合リート投資法人	2	2	302,325
インヴィンシブル投資法人	12	12	580,368
フロンティア不動産投資法人	1	1	556,148
平和不動産リート投資法人	1	1	307,474
日本ロジスティクスファンド投資法人	1	1	646,159
福岡リート投資法人	1	1	253,210
ケネディクス・オフィス投資法人	0.882	1	573,333
いちごオフィスリート投資法人	2	2	205,779
大和証券オフィス投資法人	0.603	0.610	408,090
阪急阪神リート投資法人	1	1	200,599
スタートアップロシード投資法人	0.444	0.454	105,191
大和ハウスリート投資法人	4	4	1,338,886
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8	9	680,198
大和証券リビング投資法人	3	4	474,935
ジャパンエクセレント投資法人	2	2	359,922
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	166 61	173 61 31,772,825 <98.8%>

(注1) 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2) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口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。

投資信託財産の構成

2022年11月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託証券	千円 31,772,825	% 98.5
コール・ローン等、その他	471,641	1.5
投資信託財産総額	32,244,466	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14日現在)

項目	当期末
(A) 資産	32,244,466,376円
コール・ローン等	212,410,739
投資信託証券(評価額)	31,772,825,200
未収配当金	259,230,437
(B) 負債	69,869,585
未払解約金	69,868,791
その他未払費用	794
(C) 純資産総額(A-B)	32,174,596,791
元本	16,884,289,324
次期繰越損益金	15,290,307,467
(D) 受益権総口数	16,884,289,324口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,056円

(注1) 期首元本額 16,766,642,057円
 期中追加設定元本額 2,655,357,207円
 期中一部解約元本額 2,537,709,940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 J-R E I T インデックス ファンド (適格機関投資家限定)
 738,013,482円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド 1,181,517,632円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ Jリート インデックス ファンド
 8,572,962,853円
 ニッセイ J-R E I T インデックス ファンド 2013-02 (適格機関投資家限定)
 1,691,958,242円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド A
 2,850,275,380円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド B
 1,647,333,354円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス バランス ファンド (6資産均等型)
 138,519,965円
 ニッセイ・インデックス パッケージ (内外・株式/リート)
 13,759,909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)
 5,919,174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)
 9,834,853円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス バランス ファンド (8資産均等型)
 32,772,700円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (安定型)
 87,410円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (積極型)
 185,204円
 FWニッセイ 国内リート インデックス 1,149,166円

損益の状況

当期 (2022年5月13日~2022年11月14日)

項目	当期
(A) 配当等収益	585,910,431円
受取配当金	585,999,872
受取利息	3,075
その他収益金	3
支払利息	△ 92,519
(B) 有価証券売買損益	67,142,460
売買益	767,071,845
売買損	△ 699,929,385
(C) 信託報酬等	△ 5,276
(D) 当期損益金(A+B+C)	653,047,615
(E) 前期繰越損益金	14,488,896,245
(F) 追加信託差損益金	2,408,953,364
(G) 解約差損益金	△ 2,260,589,757
(H) 合計(D+E+F+G)	15,290,307,467
次期繰越損益金(H)	15,290,307,467

(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) (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。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 6 期

(計算期間：2021年3月11日～2022年3月10日)

運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA – B P I 総合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。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りませ



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

2021年3月11日～2022年3月10日

国内債券市況

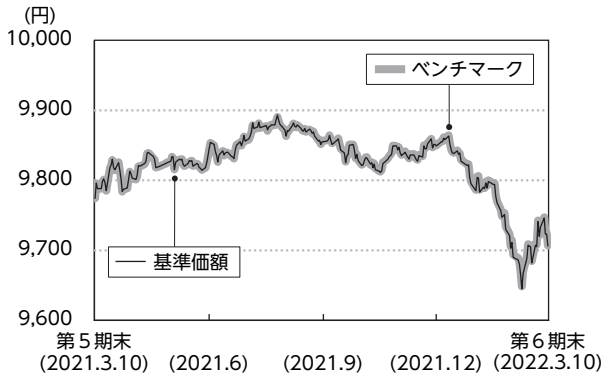


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初以降、新型コロナウイルスの感染拡大を受けたまん延防止等重点措置の発令や緊急事態宣言の延長に加えて、5月には軟調な米経済指標を受けて米国の早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）観測が後退したことなどから金利は低下基調が続きました。しかし、8月下旬に米連邦準備制度理事会（FRB）副議長がテーパリングに言及したことから、米金利の上昇とともに国内金利も上昇し、その後も原油価格をはじめとした商品価格の上昇や世界的なインフレ懸念から海外金利が上昇したことで国内金利も上昇しました。11月にオミクロン型の出現により投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は再度低下基調に転じる場面もありましたが、12月下旬以降は米国においてオミクロン型への懸念が後退したことやFRBの高官から金融引き締めに積極的な発言が相次いだことで早期利上げ観測が高まったこと、商品価格の上昇を受けて日銀の物価見通しが上方修正され金融政策正常化が早まるとの観測が高まったことなどから金利は大きく上昇しました。しかし、2月中旬以降はロシア・ウクライナ情勢の緊迫化から金利の上昇基調は途絶えました。

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

<上昇要因>

- ・ 期初から2021年8月下旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大懸念などから金利が低下（債券価格は上昇）したこと

<下落要因>

- ・ 2021年8月下旬から10月下旬にかけて、米国の金融政策引き締め観測や世界的なインフレ懸念から海外金利が上昇し、国内金利も上昇したこと
- ・ 2021年12月下旬から2022年2月中旬にかけて、米国において新型コロナウイルスの新たな変異型（オミクロン型）への懸念が後退したことや、日米の金融政策が早期引き締め方向になるとの観測が高まったことなどから国内金利が上昇したこと

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、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した。

当期も上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しておおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

(注) デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-0.7%となり、ベンチマーク騰落率（-0.7%）に連動しました。

今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、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	債券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
2期(2018年3月12日)	9,687	1.1	9,688	1.1	99.1	126,324
3期(2019年3月11日)	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2	91,526
4期(2020年3月10日)	9,979	1.5	9,970	1.5	99.3	82,399
5期(2021年3月10日)	9,774	△2.1	9,767	△2.0	99.2	80,558
6期(2022年3月10日)	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2	78,005

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

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	債券組入比率
	円	%		%	%
(期首)2021年3月10日	9,774	—	9,767	—	99.2
3月末	9,801	0.3	9,793	0.3	98.0
4月末	9,819	0.5	9,812	0.5	99.2
5月末	9,824	0.5	9,816	0.5	99.1
6月末	9,831	0.6	9,823	0.6	99.4
7月末	9,879	1.1	9,872	1.1	99.2
8月末	9,871	1.0	9,863	1.0	99.1
9月末	9,837	0.6	9,829	0.6	99.2
10月末	9,825	0.5	9,819	0.5	99.2
11月末	9,849	0.8	9,842	0.8	99.1
12月末	9,827	0.5	9,822	0.6	99.2
2022年1月末	9,757	△0.2	9,751	△0.2	99.2
2月末	9,707	△0.7	9,702	△0.7	99.1
(期末)2022年3月10日	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年3月11日～2022年3月10日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	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
(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	0	0.000	

(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（9,822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

2021年3月11日～2022年3月10日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	22,020,128	20,987,458
	地方債証券	527,625	1,769,452
	特殊債券	1,875,857	3,232,591
	社債券	2,053,600	(179,196)
			1,521,364

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

主要な売買銘柄

2021年3月11日～2022年3月10日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第70回 利付国債(20年)	995,861	第133回 住宅金融支援機構債券	1,011,410
第35回 利付国債(30年)	912,442	第70回 利付国債(20年)	846,571
第363回 利付国債(10年)	659,294	第35回 利付国債(30年)	835,452
第430回 利付国債(2年)	634,493	第328回 利付国債(10年)	785,879
第431回 利付国債(2年)	633,219	第110回 利付国債(20年)	708,229
第427回 利付国債(2年)	617,325	第327回 利付国債(10年)	598,009
第426回 利付国債(2年)	614,377	第190回 政保道路機構債券	505,465
第364回 利付国債(10年)	609,682	第127回 利付国債(20年)	452,839
第429回 利付国債(2年)	601,346	第358回 利付国債(10年)	418,718
第428回 利付国債(2年)	600,417	第48回 地方公共団体金融機構債券	404,540

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2022年3月10日現在

国内(邦貨建)公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	58,011,000 (18,035,000)	61,599,040 (17,728,955)	79.0 (22.7)	-	57.9 (14.3)	13.9 (2.1)	7.1 (6.3)
地方債証券	4,481,000 (4,481,000)	4,688,555 (4,688,555)	6.0 (6.0)	-	2.7 (2.7)	1.8 (1.8)	1.6 (1.6)
特殊債券 (除く金融債券)	5,271,466 (5,271,466)	5,542,760 (5,542,760)	7.1 (7.1)	-	4.6 (4.6)	1.8 (1.8)	0.7 (0.7)
金融債券	500,000 (500,000)	499,981 (499,981)	0.6 (0.6)	-	-	0.4 (0.4)	0.3 (0.3)
社債券	5,000,000 (5,000,000)	5,078,869 (5,078,869)	6.5 (6.5)	-	1.1 (1.1)	4.0 (4.0)	1.4 (1.4)
合計	73,263,466 (33,287,466)	77,409,206 (33,539,122)	99.2 (43.0)	-	66.3 (22.7)	21.9 (10.1)	11.0 (10.2)

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額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。以下同じです。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第423回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/4/1	510,000	510,428
	第424回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/5/1	150,000	150,136
	第425回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/6/1	272,000	272,247
	第426回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/7/1	513,000	513,466
	第427回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/8/1	516,000	516,500
	第428回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/9/1	599,000	599,616
	第429回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/10/1	600,000	600,654
	第430回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/11/1	633,000	633,670
	第431回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/12/1	632,000	632,650
	第432回 利付国債 (2年)	0.0050	2024/1/1	300,000	300,270
	第433回 利付国債 (2年)	0.0050	2024/2/1	200,000	200,170
	第137回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/9/20	37,000	37,090
	第138回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/12/20	81,000	81,208
	第139回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/3/20	70,000	70,198
	第140回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/6/20	259,000	259,766
	第141回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/9/20	463,000	464,463
	第144回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/6/20	512,000	513,930
	第145回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/9/20	80,000	80,310
	第146回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/12/20	80,000	80,332
	第150回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/12/20	200,000	199,904
	第1回 利付国債 (40年)	2.4000	2048/3/20	90,000	123,817
	第2回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	113,000	150,323
	第3回 利付国債 (40年)	2.2000	2050/3/20	490,000	655,286
	第4回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	157,000	211,262
	第5回 利付国債 (40年)	2.0000	2052/3/20	159,000	206,692
	第6回 利付国債 (40年)	1.9000	2053/3/20	164,000	210,144
	第7回 利付国債 (40年)	1.7000	2054/3/20	177,000	218,166
	第8回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	167,000	192,420
	第9回 利付国債 (40年)	0.4000	2056/3/20	333,000	287,012
	第10回 利付国債 (40年)	0.9000	2057/3/20	291,000	293,342
	第11回 利付国債 (40年)	0.8000	2058/3/20	249,000	243,218
	第12回 利付国債 (40年)	0.5000	2059/3/20	106,000	93,446
	第13回 利付国債 (40年)	0.5000	2060/3/20	170,000	149,254
第14回 利付国債 (40年)	0.7000	2061/3/20	136,000	127,774	
第329回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/6/20	184,000	186,044	
第330回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/9/20	3,000	3,039	
第332回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/12/20	138,000	139,570	
第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/3/20	92,000	93,183	

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 6 /20	496,000	503,117
	第335回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/ 9 /20	243,000	246,227
	第337回 利付国債 (10年)	0.3000	2024/12/20	310,000	312,755
	第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 3 /20	357,000	361,480
	第339回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 6 /20	536,000	543,289
	第340回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 9 /20	566,000	574,190
	第341回 利付国債 (10年)	0.3000	2025/12/20	552,000	558,463
	第342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	510,000	512,152
	第343回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 6 /20	461,000	463,069
	第344回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 9 /20	533,000	535,291
	第345回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/12/20	532,000	534,154
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	523,000	525,227
	第347回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 6 /20	433,000	434,822
	第348回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 9 /20	499,000	501,065
	第349回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/12/20	570,000	572,297
	第350回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 3 /20	744,000	746,901
	第351回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 6 /20	570,000	572,319
	第352回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 9 /20	556,000	558,168
	第353回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/12/20	543,000	545,014
	第354回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 3 /20	518,000	519,813
	第355回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 6 /20	422,000	423,375
	第356回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 9 /20	418,000	419,095
	第357回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/12/20	429,000	429,827
	第358回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 3 /20	525,000	525,624
	第359回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 6 /20	337,000	337,138
	第360回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 9 /20	297,000	296,747
	第361回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/12/20	637,000	635,611
	第362回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 3 /20	534,000	532,093
	第363回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 6 /20	643,000	639,765
	第364回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 9 /20	608,000	604,005
	第365回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/12/20	336,000	333,254
	第 1 回 利付国債 (30年)	2.8000	2029/ 9 /20	10,000	12,049
	第 2 回 利付国債 (30年)	2.4000	2030/ 2 /20	82,000	97,062
第 3 回 利付国債 (30年)	2.3000	2030/ 5 /20	123,000	145,163	
第 4 回 利付国債 (30年)	2.9000	2030/11/20	79,000	97,984	
第 5 回 利付国債 (30年)	2.2000	2031/ 5 /20	104,000	123,441	
第 6 回 利付国債 (30年)	2.4000	2031/11/20	78,000	94,636	
第 7 回 利付国債 (30年)	2.3000	2032/ 5 /20	39,000	47,203	
第 8 回 利付国債 (30年)	1.8000	2032/11/22	21,000	24,456	

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 9 回 利付国債 (30年)	1.4000	2032/12/20	12,000	13,469
	第 10 回 利付国債 (30年)	1.1000	2033/ 3 /20	21,000	22,914
	第 11 回 利付国債 (30年)	1.7000	2033/ 6 /20	30,000	34,751
	第 12 回 利付国債 (30年)	2.1000	2033/ 9 /20	58,000	69,945
	第 13 回 利付国債 (30年)	2.0000	2033/12/20	62,000	74,200
	第 14 回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/ 3 /20	59,000	73,507
	第 15 回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 6 /20	76,000	95,854
	第 16 回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 9 /20	53,000	67,038
	第 17 回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/12/20	75,000	94,150
	第 18 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	89,000	110,894
	第 19 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 6 /20	67,000	83,681
	第 20 回 利付国債 (30年)	2.5000	2035/ 9 /20	76,000	97,169
	第 21 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/12/20	76,000	95,354
	第 22 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 3 /20	79,000	101,502
	第 23 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 6 /20	85,000	109,402
	第 24 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 9 /20	70,000	90,307
	第 25 回 利付国債 (30年)	2.3000	2036/12/20	78,000	98,609
	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	154,000	197,372
	第 27 回 利付国債 (30年)	2.5000	2037/ 9 /20	148,000	192,595
	第 28 回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/ 3 /20	196,000	256,054
	第 29 回 利付国債 (30年)	2.4000	2038/ 9 /20	208,000	269,362
	第 30 回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	221,000	283,410
	第 31 回 利付国債 (30年)	2.2000	2039/ 9 /20	215,000	272,804
	第 32 回 利付国債 (30年)	2.3000	2040/ 3 /20	268,000	345,476
	第 33 回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	299,000	371,277
	第 34 回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	276,000	353,213
	第 35 回 利付国債 (30年)	2.0000	2041/ 9 /20	304,000	379,388
	第 36 回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/ 3 /20	287,000	359,148
	第 37 回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	311,000	384,190
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	207,000	252,196
	第 39 回 利付国債 (30年)	1.9000	2043/ 6 /20	192,000	237,970
	第 40 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 9 /20	165,000	201,405
	第 41 回 利付国債 (30年)	1.7000	2043/12/20	162,000	194,634
	第 42 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 3 /20	151,000	181,545
	第 43 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 6 /20	143,000	172,049
	第 44 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 9 /20	147,000	176,983
	第 45 回 利付国債 (30年)	1.5000	2044/12/20	163,000	189,547
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/ 3 /20	229,000	266,381
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/ 6 /20	209,000	247,639

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 48 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/ 9 /20	219,000	250,220
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	216,000	246,821
	第 50 回 利付国債 (30年)	0.8000	2046/ 3 /20	219,000	221,452
	第 51 回 利付国債 (30年)	0.3000	2046/ 6 /20	220,000	197,839
	第 52 回 利付国債 (30年)	0.5000	2046/ 9 /20	228,000	214,853
	第 53 回 利付国債 (30年)	0.6000	2046/12/20	204,000	196,374
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	216,000	217,358
	第 55 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 6 /20	204,000	205,077
	第 56 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 9 /20	209,000	209,666
	第 57 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/12/20	213,000	213,455
	第 58 回 利付国債 (30年)	0.8000	2048/ 3 /20	261,000	261,000
	第 59 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/ 6 /20	203,000	197,947
	第 60 回 利付国債 (30年)	0.9000	2048/ 9 /20	184,000	187,819
	第 61 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/12/20	186,000	180,503
	第 62 回 利付国債 (30年)	0.5000	2049/ 3 /20	179,000	164,687
	第 63 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 6 /20	193,000	172,431
	第 64 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 9 /20	196,000	174,763
	第 65 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/12/20	171,000	152,167
	第 66 回 利付国債 (30年)	0.4000	2050/ 3 /20	175,000	155,590
	第 67 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 6 /20	222,000	208,160
	第 68 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 9 /20	226,000	211,809
	第 69 回 利付国債 (30年)	0.7000	2050/12/20	223,000	214,521
	第 70 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 3 /20	215,000	206,529
	第 71 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 6 /20	218,000	209,351
	第 72 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 9 /20	207,000	198,732
	第 62 回 利付国債 (20年)	0.8000	2023/ 6 /20	175,000	176,933
	第 70 回 利付国債 (20年)	2.4000	2024/ 6 /20	259,000	273,307
	第 71 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/ 6 /20	76,000	79,851
	第 72 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/ 9 /20	190,000	200,189
	第 73 回 利付国債 (20年)	2.0000	2024/12/20	122,000	128,832
	第 74 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/12/20	77,000	81,526
	第 75 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 3 /20	88,000	93,617
	第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 3 /20	115,000	121,644
	第 77 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 3 /20	86,000	91,229
	第 78 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 6 /20	269,000	285,839
	第 79 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 6 /20	78,000	83,138
	第 80 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 6 /20	92,000	98,362
	第 81 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 9 /20	101,000	108,146
	第 82 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 9 /20	132,000	141,806

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 83 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/12/20	111,000	119,828
	第 84 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/12/20	202,000	217,303
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	136,000	147,523
	第 86 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 3 /20	145,000	158,453
	第 87 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 3 /20	122,000	132,828
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	292,000	320,788
	第 89 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 6 /20	189,000	206,826
	第 90 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 9 /20	260,000	285,838
	第 91 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 9 /20	185,000	204,223
	第 92 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/12/20	336,000	369,536
	第 93 回 利付国債 (20年)	2.0000	2027/ 3 /20	219,000	240,825
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	267,000	294,949
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/ 6 /20	229,000	256,521
	第 96 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 6 /20	134,000	148,690
	第 97 回 利付国債 (20年)	2.2000	2027/ 9 /20	196,000	219,535
	第 98 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 9 /20	166,000	185,016
	第 99 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/12/20	303,000	339,175
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	202,000	228,290
	第101回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 3 /20	125,000	142,772
	第102回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 6 /20	182,000	208,956
	第103回 利付国債 (20年)	2.3000	2028/ 6 /20	131,000	149,582
	第104回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 6 /20	104,000	117,449
	第105回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 9 /20	88,000	99,836
	第106回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 9 /20	64,000	73,025
	第107回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/12/20	85,000	96,803
	第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	99,000	111,409
	第109回 利付国債 (20年)	1.9000	2029/ 3 /20	79,000	89,230
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	191,000	218,408
	第111回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/ 6 /20	137,000	158,298
	第112回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 6 /20	197,000	226,197
	第113回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 9 /20	333,000	383,912
	第114回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/12/20	200,000	231,408
	第115回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/12/20	138,000	160,738
	第116回 利付国債 (20年)	2.2000	2030/ 3 /20	160,000	187,044
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	238,000	276,332
	第118回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/ 6 /20	155,000	179,321
	第119回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 6 /20	140,000	159,667
	第120回 利付国債 (20年)	1.6000	2030/ 6 /20	145,000	162,987
	第121回 利付国債 (20年)	1.9000	2030/ 9 /20	221,000	254,532

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第122回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 9 /20	160,000	182,923
	第123回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/12/20	257,000	301,332
	第124回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/12/20	170,000	197,847
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	193,000	228,635
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	179,000	208,857
	第127回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 3 /20	189,000	218,839
	第128回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 6 /20	253,000	293,641
	第129回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 6 /20	169,000	194,601
	第130回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 9 /20	250,000	288,480
	第131回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/ 9 /20	164,000	187,702
	第132回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/12/20	131,000	150,204
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	156,000	180,370
	第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/ 3 /20	164,000	189,974
	第135回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 3 /20	114,000	130,933
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 3 /20	118,000	134,366
	第137回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 6 /20	35,000	40,266
	第138回 利付国債 (20年)	1.5000	2032/ 6 /20	39,000	44,082
	第139回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 6 /20	42,000	47,896
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 9 /20	104,000	119,838
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	163,000	188,199
	第142回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/12/20	95,000	110,686
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	216,000	247,417
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	98,000	111,202
	第145回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 6 /20	255,000	295,389
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	243,000	282,008
	第147回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/12/20	266,000	306,033
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 3 /20	235,000	267,883
	第149回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 6 /20	254,000	289,918
	第150回 利付国債 (20年)	1.4000	2034/ 9 /20	274,000	309,644
	第151回 利付国債 (20年)	1.2000	2034/12/20	267,000	295,299
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	299,000	330,864
	第153回 利付国債 (20年)	1.3000	2035/ 6 /20	307,000	343,781
	第154回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 9 /20	290,000	321,009
	第155回 利付国債 (20年)	1.0000	2035/12/20	291,000	314,413
	第156回 利付国債 (20年)	0.4000	2036/ 3 /20	241,000	240,679
	第157回 利付国債 (20年)	0.2000	2036/ 6 /20	247,000	239,357
	第158回 利付国債 (20年)	0.5000	2036/ 9 /20	268,000	270,379
	第159回 利付国債 (20年)	0.6000	2036/12/20	245,000	250,265
	第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	208,000	215,317

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第161回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 6 /20	222,000	226,273
	第162回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 9 /20	212,000	215,676
	第163回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/12/20	275,000	279,430
	第164回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 3 /20	334,000	333,749
	第165回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 6 /20	274,000	273,175
	第166回 利付国債 (20年)	0.7000	2038/ 9 /20	265,000	272,051
	第167回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/12/20	281,000	279,055
	第168回 利付国債 (20年)	0.4000	2039/ 3 /20	245,000	238,720
	第169回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 6 /20	273,000	260,791
	第170回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 9 /20	245,000	233,340
	第171回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/12/20	257,000	244,219
	第172回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 3 /20	243,000	234,521
	第173回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 6 /20	309,000	297,594
	第174回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 9 /20	308,000	296,243
	第175回 利付国債 (20年)	0.5000	2040/12/20	287,000	280,499
	第176回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 3 /20	292,000	284,822
	第177回 利付国債 (20年)	0.4000	2041/ 6 /20	276,000	263,952
	第178回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 9 /20	273,000	265,672
	第179回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/12/20	97,000	94,284
	小計	-	-	-	61,599,040
地方債証券	第730回 東京都公募公債	0.6640	2024/ 3 /19	300,000	303,388
	第 34 回 東京都公募公債 (20年)	0.6680	2037/ 6 /19	100,000	102,067
	平成27年度第1回 北海道公募公債	0.4300	2025/ 4 /30	300,000	302,965
	第 30 回 神奈川県公募公債 (20年)	1.1610	2035/ 9 /20	100,000	109,249
	第378回 大阪府公募公債 (10年)	0.7000	2023/11/28	144,000	145,503
	第448回 大阪府公募公債 (10年)	0.0010	2029/ 9 /27	38,000	37,386
	第455回 大阪府公募公債 (10年)	0.1160	2030/ 4 /26	180,000	178,291
	第 12 回 大阪府公募公債 (20年)	1.4530	2034/ 9 /26	100,000	112,443
	平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	0.6300	2037/ 8 /14	100,000	101,297
	第 21 回 兵庫県公募公債 (20年)	1.5400	2034/ 5 / 9	100,000	113,237
	平成26年度第11回 愛知県公募公債	0.9610	2029/10/16	100,000	105,753
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	0.9210	2023/ 7 /24	100,000	101,179
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	0.6700	2024/ 2 /26	119,000	120,322
	平成20年度第1回 福岡県公募公債	2.2600	2028/ 8 /18	100,000	113,404
	平成24年度第2回 福岡県公募公債	1.6350	2032/ 8 /16	100,000	113,869
	第 10 回 群馬県公募公債	0.6700	2023/11/24	300,000	302,985
	第123回 共同発行市場公募地方債	0.8700	2023/ 6 /23	300,000	303,160
	第133回 共同発行市場公募地方債	0.6890	2024/ 4 /25	300,000	303,747
	第 22 回 大阪市公募公債 (20年)	0.3470	2036/ 5 /30	100,000	98,020

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第 1 回 名古屋市公募公債	2.5300	2035/ 3 /20	100,000	126,295
	第 1 回 京都市公募公債	2.1400	2024/12/20	300,000	316,892
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	0.6890	2024/ 2 /19	100,000	101,142
	第 25 回 横浜市公募公債 (20年)	1.7200	2032/ 7 /16	100,000	114,688
	第 26 回 横浜市公募公債 (20年)	1.7760	2033/ 1 /28	100,000	115,597
	第 9 回 川崎市公募公債 (20年)	2.1500	2030/ 5 /24	100,000	115,695
	第 4 回 川崎市公募公債 (30年)	2.1000	2041/ 9 /20	100,000	125,740
	平成25年度第3回 北九州市公募公債	0.7280	2023/12/26	150,000	151,710
	平成26年度第2回 北九州市公募公債	0.4510	2024/12/24	150,000	151,407
	平成30年度第5回 広島市公募公債	0.1950	2028/12/25	200,000	200,218
	平成29年度第1回 仙台市公募公債 (20年)	0.6160	2037/10/19	100,000	100,890
		小計	-	-	-
特殊債券 (除く金融債券)	第 9 回 新関西国際空港	1.2310	2028/12/20	300,000	319,473
	第 22 回 政保日本政策投資銀行債券	2.2000	2023/ 6 /19	300,000	308,516
	第 16 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7000	2036/ 9 /19	100,000	130,257
	第115回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.7380	2023/ 9 /20	100,000	101,024
	第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6410	2032/ 9 /30	100,000	114,203
	第205回 政保道路機構債券	1.5320	2033/11/30	100,000	113,749
	第212回 政保道路機構債券	1.5000	2034/ 2 /28	100,000	113,425
	第218回 政保道路機構債券	0.6600	2024/ 5 /31	500,000	507,214
	第233回 政府道路機構債券	1.3150	2034/11/30	100,000	111,446
	第249回 政保道路機構債券	0.4840	2025/ 6 /30	179,000	181,675
	第278回 政保道路機構債券	0.2370	2036/ 5 /30	100,000	96,803
	第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.3970	2036/10/31	100,000	98,742
	第316回 政保道路機構債券	0.5690	2037/ 6 /30	100,000	100,771
	第 17 回 地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.8700	2031/ 9 /26	200,000	230,411
	第 1 回 地方公共団体金融機構債券 (30年)	1.8640	2044/ 6 /28	100,000	121,829
	第 72 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5090	2025/ 5 /23	200,000	202,974
	第 83 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0200	2026/ 4 /17	103,000	102,827
	第120回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0010	2029/ 7 /13	100,000	98,961
	第136回 地方公共団体金融機構債券	0.1450	2030/ 9 /27	200,000	198,581
	第 16 回 公営企業債券	2.1000	2025/12/19	200,000	214,909
	第 97 回 都市再生債券	1.0170	2029/ 9 /20	100,000	105,834
	第 46 回 福祉医療機構債券	0.0800	2026/ 6 /19	200,000	199,617
	第 59 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	2030/10/22	200,000	229,069
	第143回 住宅金融支援機構債券	1.1920	2028/10/20	100,000	106,445
	第 37 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7100	2045/ 6 /10	22,035	23,174
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4300	2045/11/10	55,408	58,111
	第 46 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8500	2046/ 3 /10	64,764	68,326

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
特殊債券 (除く金融債券)	第 54 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4700	2046/11/10	55,340	57,935
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4100	2046/12/10	61,322	64,173
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	2047/ 5 /10	69,558	72,910
	第 61 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2600	2047/ 6 /10	34,155	35,654
	第 62 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	2047/ 7 /10	295,760	308,122
	第 63 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1100	2047/ 8 /10	184,670	191,447
	第 73 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3000	2048/ 6 /10	122,091	127,621
	第 78 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0800	2048/11/10	106,800	110,420
	第 109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	2051/ 6 /10	217,563	216,148
	第 116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.0400	2023/ 9 /20	100,000	99,946
		小計	-	-	-
金融債券	い第845号 利付商工債券	0.1200	2025/10/27	200,000	199,891
	い第822号 利付農林債券	0.0900	2023/11/27	100,000	100,056
	第344回 利付しんぎん中金債券	0.1000	2023/ 7 /27	100,000	100,071
	第353回 利付しんぎん中金債券	0.0600	2024/ 4 /26	100,000	99,961
		小計	-	-	-
社債券	第 26 回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円債社債(2018)	0.4430	2023/10/12	300,000	300,490
	第 13 回 クレディ・アグリコル	0.3430	2024/ 6 / 7	100,000	99,817
	第 5 回 スウェンスカ・ハンデルスバンク	0.6790	2024/ 9 / 4	200,000	201,522
	第 25 回 首都高速道路債券	0.0300	2024/ 9 /20	400,000	399,141
	第 56 回 中日本高速道路債券	0.7590	2023/12/20	200,000	202,360
	第 60 回 中日本高速道路債券	0.5430	2024/12/20	100,000	101,147
	第 20 回 西日本高速道路債券	0.7590	2023/ 9 /20	100,000	101,044
	第 25 回 西日本高速道路債券	0.5240	2024/12/20	200,000	202,194
	第 26 回 西日本高速道路債券	0.6040	2025/ 5 /21	200,000	203,018
	第 14 回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	0.8200	2025/ 5 /26	100,000	101,447
	第 5 回 電通グループ	0.3200	2027/ 7 / 8	400,000	400,778
	第 24 回 豊田自動織機	0.7970	2023/ 6 /20	100,000	100,913
	第 1 回 オリックス銀行	0.1600	2026/ 3 /11	200,000	199,916
	第 1 回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	0.8570	2024/ 9 / 5	100,000	100,909
	第 29 回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.1600	2026/ 1 /20	100,000	106,504
	第 1 回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	0.8490	2024/ 9 /12	100,000	100,997
	第 8 回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	1.9200	2025/10/28	100,000	105,141
	第 18 回 NTTファイナンス	0.3800	2030/ 9 /20	100,000	100,381
	第 96 回 トヨタファイナンス	0.0600	2026/ 4 /15	100,000	99,600
	第 6 回 三井住友海上火災保険	0.1300	2024/ 7 /31	100,000	99,910
	第 66 回 三井不動産	0.2800	2026/ 3 /13	100,000	100,328
	第 7 回 野村不動産オフィスファンド投資法人	2.9000	2028/ 3 /17	200,000	228,210

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
社債券	第 77 回 東京急行電鉄	0.9870	2023/ 6 /12	100,000	101,162
	第 27 回 KDD I	0.2300	2026/ 4 /24	200,000	200,639
	第510回 関西電力	0.4900	2027/ 7 /23	100,000	100,836
	第381回 中国電力	0.9530	2024/ 4 /25	200,000	203,679
	第304回 北陸電力	0.9890	2023/10/25	100,000	101,489
	第306回 北陸電力	0.8750	2024/ 5 /24	100,000	101,749
	第253回 四国電力	1.0000	2023/ 6 /23	200,000	202,425
	第429回 九州電力	0.9090	2024/ 9 /25	200,000	204,184
	第331回 北海道電力	0.3700	2026/ 4 /24	100,000	100,641
	第 13 回 電源開発	2.0400	2025/ 6 /20	100,000	106,282
		小計	-	-	-
	合計	-	-	-	77,409,206

投資信託財産の構成

2022年3月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	77,409,206	99.0
コール・ローン等、その他	774,140	1.0
投資信託財産総額	78,183,347	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月10日現在)

項目	当期末
(A)資産	78,183,347,603円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	542,946,414
公 社 債 (評価額)	77,409,206,900
未 収 利 息	222,734,860
前 払 費 用	8,459,429
(B)負債	177,441,151
未 払 解 約 金	177,439,987
そ の 他 未 払 費 用	1,164
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	78,005,906,452
元 本	80,372,485,061
次 期 繰 越 損 益 金	△ 2,366,578,609
(D)受 益 権 総 口 数	80,372,485,061口
1万口当たり基準価額 (C / D)	9,706円

(注1) 期首元本額 82,422,375,045円
 期中追加設定元本額 13,091,413,259円
 期中一部解約元本額 15,141,303,243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。

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定)	65,329,145,586円
DCニッセイ日本債券インデックス	3,451,719,435円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	107,909,695円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	5,636,145,522円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	216,124,782円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	1,147,396,165円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	2,062,605,972円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (6資産均等型)	218,681,287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)	24,004,631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)	69,765,956円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (8資産均等型)	58,442,636円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	51,955,149円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	71,837,078円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	266,777,033円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	1,658,861,597円
FWニッセイ国内債インデックス	1,064,570円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	47,967円

(注3) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は2,366,578,609円です。

損益の状況

当期 (2021年3月11日~2022年3月10日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	703,363,183円
受 取 利 息	703,752,030
支 払 利 息	△ 388,847
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,271,822,728
売 買 益	37,311,618
売 買 損	△ 1,309,134,346
(C)信 託 報 酬 等	△ 16,779
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 568,476,324
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△1,863,790,872
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△ 223,558,184
(G)解 約 差 損 益 金	289,246,771
(H)合 計 (D + E + F + G)	△2,366,578,609
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△2,366,578,609

(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) (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。

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

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

・ 東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。J P X は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。J P X は、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、J P X は当ファンドの設定、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責任を有しません。

・ N O M U R A - B P I 総合

N O M U R A - B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。