

第4期末(2018年11月20日)

基準価額	11,702円
純資産総額	12億円
騰落率	△6.6%
分配金	0円

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

追加型投信／国内／株式／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2017年11月21日～2018年11月20日

第4期(決算日 2018年11月20日)

受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ J P X 日経400インデックスファンド」は、このたび第4期の決算を行いました。

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

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

 <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

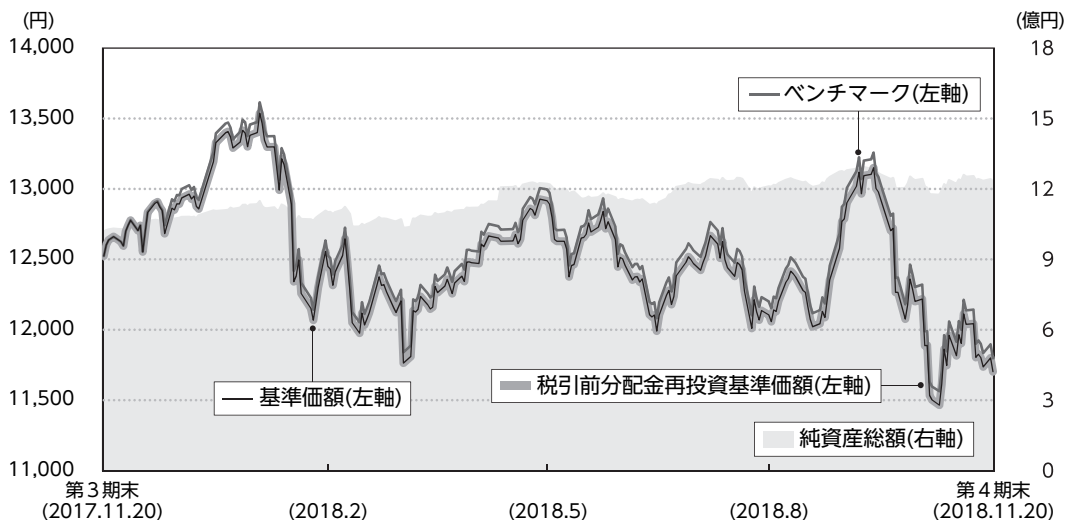
NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年11月21日～2018年11月20日

基準価額等の推移



第4期首	12,524円	既払分配金	0円
第4期末	11,702円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△6.6%

- (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、ファンドの購入金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JPX日経インデックス400(配当込み)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。「JPX日経インデックス400」は、日本取引所グループおよび東京証券取引所(以下総称して「JPXグループ」といいます)ならびに日本経済新聞社(以下「日経」といいます)の知的財産であり、その商標権その他の知的財産権は、すべて「JPXグループ」および「日経」に帰属しています。「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。「JPXグループ」および「日経」は、当商品の運用および取引に関して、一切の責任を負いません。以下同じです。

■基準価額の主な変動要因

期初以降、日米の堅調な経済指標や米税制改革法案成立への期待などを背景に株価が上昇したことから基準価額は上昇しました。2月になると、米長期金利の上昇を受けた投資家のリスク回避姿勢の強まりなどから、株価が下落に転じたことにより基準価額は下落しました。その後、米国の保護主義政策や米中貿易摩擦への懸念を背景に基準価額は上下して推移しました。9月に入ると米中貿易摩擦への警戒感は一服し、株価が上昇したことから基準価額は上昇しましたが、10月には米株急落を受けた世界同時株安などにより株価は下落し、基準価額は期初を下回る水準で当期末を迎えました。

1万口当たりの費用明細

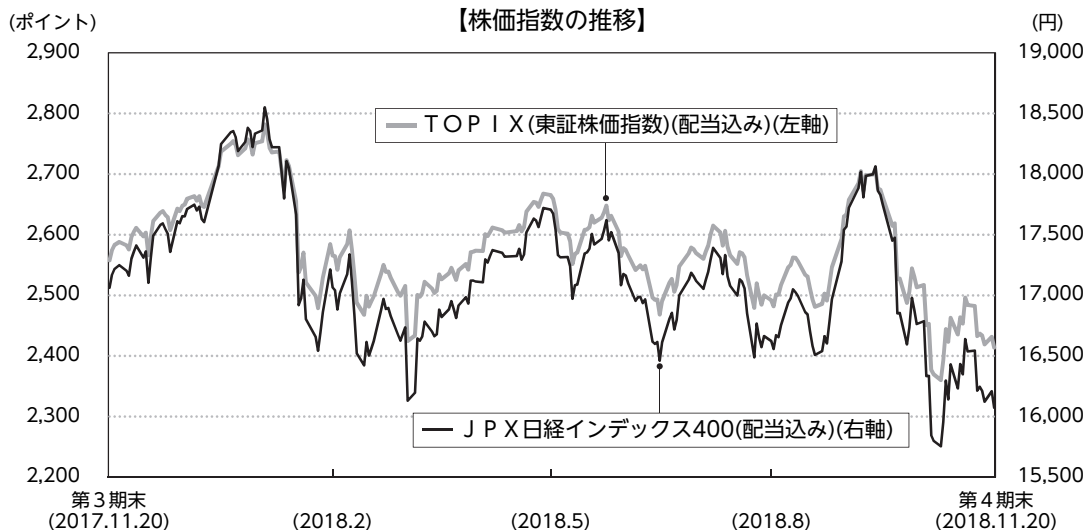
項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	26円	0.211%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は12,493円です。
(投信会社)	(12)	(0.097)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(11)	(0.086)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	3	0.027	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(3)	(0.027)	
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)	(0.010)	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)	(0.001)	・ 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	31	0.248	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、企業の好決算、海外株式市場の堅調な推移、日米の堅調な経済指標や米税制改革法案成立への期待などを背景に株価は上昇しました。2月になると、米長期金利の上昇を受けた投資家のリスク回避姿勢の強まりなどから株価は下落に転じ、その後も米国の政権運営や保護主義政策に対する先行き不透明感の強まりなどから下落が続きました。

4月には米中貿易摩擦への警戒感が和らぎ、シリアや北朝鮮の地政学リスクに対する懸念の後退もあり国内株式市場は上昇しましたが、5月になると米国の保護主義的な政策やイタリアの政局混迷などを背景に下落しました。その後、米中貿易摩擦懸念や新興国への不安などの高まりと落ち着きに応じて、国内株式市場は上下して推移しました。

9月に入ると米中貿易摩擦への警戒感が一服し、円安の進行も追い風となり国内株式市場は上昇しましたが、10月には米株急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念など、景気の先行き不透明感などから下落して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

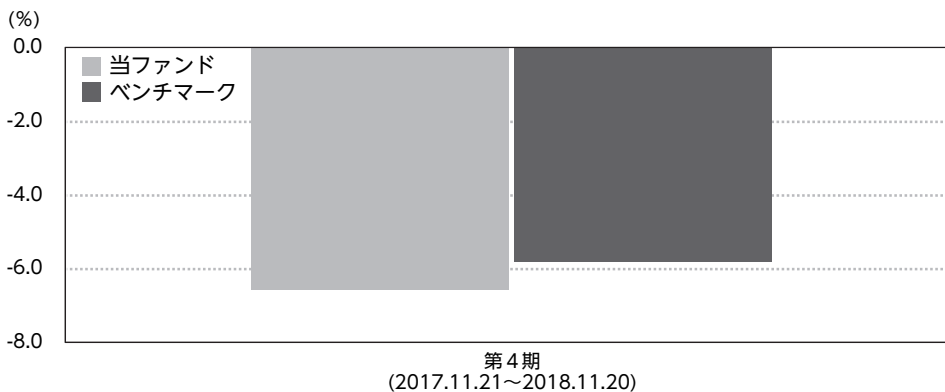
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

※ベンチマークの詳細については、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

ベンチマークとの差異



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-6.6%となり、ベンチマーク騰落率(-5.8%)を下回りました。

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
	2017年11月21日～2018年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,591円

(注1) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り捨てで算出しているため、合計が当期分配金と一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■ 組入ファンド

	第4期末 2018年11月20日
ニッセイ J P X 日経400 インデックスマザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

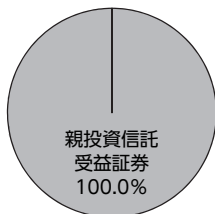
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■ 純資産等

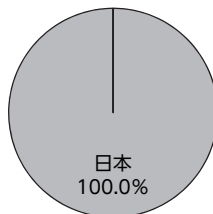
項目	第4期末 2018年11月20日
純資産総額	1,231,640,742円
受益権総口数	1,052,485,260口
1万口当たり基準価額	11,702円

(注) 当期間中における追加設定元本額は762,726,832円、同解約元本額は521,485,314円です。

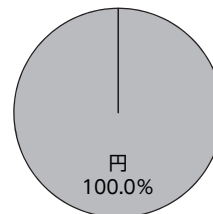
■ 資産別配分



■ 国別配分



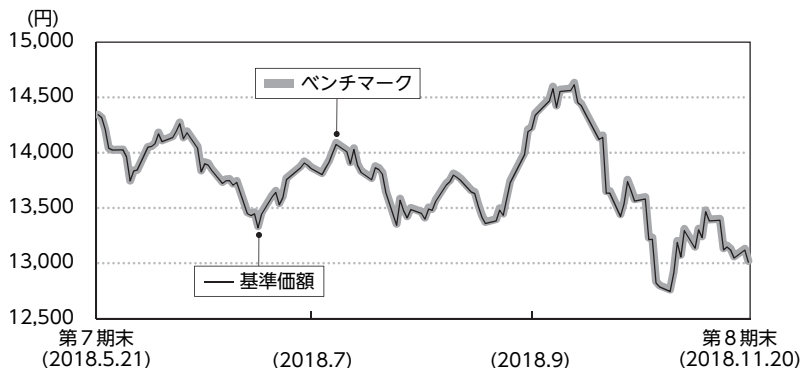
■ 通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2018年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイJPX日経400インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークはJPX日経インデックス400 (配当込み) で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。「JPX日経インデックス400」は、日本取引所グループおよび東京証券取引所 (以下総称して「JPXグループ」といいます) ならびに日本経済新聞社 (以下「日経」といいます) の知的財産であり、その商標権その他の知的財産権は、すべて「JPXグループ」および「日経」に帰属しています。「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。「JPXグループ」および「日経」は、当商品の運用および取引に関して、一切の責任を負いません。

■ 上位銘柄

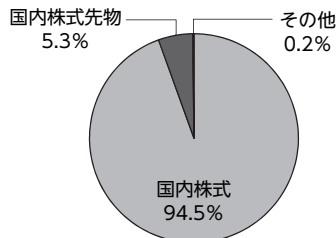
銘柄名	通貨	比率
ソフトバンクグループ	円	1.5%
ソニー	円	1.5
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.5
キーエンス	円	1.5
本田技研工業	円	1.4
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.4
みずほフィナンシャルグループ	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
トヨタ自動車	円	1.3
KDDI	円	1.2
組入銘柄数		400

■ 1万口当たりの費用明細

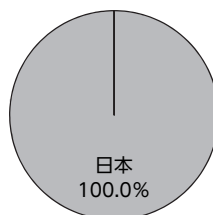
2018.5.22~2018.11.20

項目	金額
売買委託手数料	0円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
その他費用	0
(その他)	(0)
合計	1

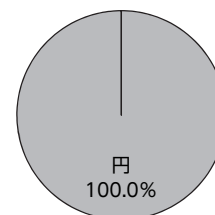
■ 資産別配分



■ 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 (2018年11月20日現在) のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書 (全体版) の組入有価証券明細表をご参照ください。

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	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金					
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	百万円
2015年1月29日	10,000	—	—	10,000	10,000	—	—	—	74
1期(2015年11月20日)	11,211	0	12.1	11,211	11,346	13.5	97.3	2.9	899
2期(2016年11月21日)	10,212	0	△ 8.9	10,212	10,387	△ 8.5	96.7	3.4	1,059
3期(2017年11月20日)	12,524	0	22.6	12,524	12,788	23.1	96.1	3.9	1,016
4期(2018年11月20日)	11,702	0	△ 6.6	11,702	12,046	△ 5.8	94.5	5.3	1,231

(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「J P X 日経インデックス400(配当込み)」で、設定時を10,000として指数化しています。「J P X 日経インデックス400」は、日本取引所グループおよび東京証券取引所(以下総称して「J P X グループ」といいます)ならびに日本経済新聞社(以下「日経」といいます)の知的財産であり、その商標権その他の知的財産権は、すべて「J P X グループ」および「日経」に帰属しています。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X 日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。「J P X グループ」および「日経」は、当商品の運用および取引に関して、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(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
		%		%		
	円	%		%	%	%
(期首) 2017年11月20日	12,524	—	12,788	—	96.1	3.9
11月末	12,742	1.7	13,010	1.7	96.1	3.9
12月末	12,858	2.7	13,194	3.2	97.3	2.6
2018年1月末	12,992	3.7	13,340	4.3	97.1	4.6
2月末	12,477	△0.4	12,820	0.3	97.4	2.9
3月末	12,236	△2.3	12,578	△1.6	96.3	3.7
4月末	12,666	1.1	13,020	1.8	96.2	1.8
5月末	12,456	△0.5	12,802	0.1	95.7	4.3
6月末	12,361	△1.3	12,715	△0.6	96.9	3.0
7月末	12,509	△0.1	12,872	0.7	96.1	3.9
8月末	12,375	△1.2	12,737	△0.4	96.1	3.9
9月末	13,094	4.6	13,480	5.4	95.4	4.6
10月末	11,863	△5.3	12,214	△4.5	95.5	4.9
(期末) 2018年11月20日	11,702	△6.6	12,046	△5.8	94.5	5.3

(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

2017年11月21日～2018年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ J P X 日経400インデックス マザーファンド	686,827	953,929	471,453	660,711

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	ニッセイ J P X 日経400インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	92,249,084千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	27,375,374千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	3.36

(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

2017年11月21日～2018年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2018年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ J P X 日経400インデックス マザーファンド	731,320	946,693	1,231,648

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド全体の口数は17,130,092千口です。

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド	1,231,648	99.8
コール・ローン等、その他	2,191	0.2
投資信託財産総額	1,233,839	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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	1,233,839,589円
コール・ローン等	1,296,989
ニッセイJPX日経400インデックス マザーファンド(評価額)	1,231,648,170
未収入金	894,430
(B) 負債	2,198,847
未払解約金	857,120
未払信託報酬	1,281,855
その他未払費用	59,872
(C) 純資産総額(A-B)	1,231,640,742
元本	1,052,485,260
次期繰越損益金	179,155,482
(D) 受益権総口数	1,052,485,260口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,702円

(注) 期首元本額 811,243,742円
 期中追加設定元本額 762,726,832円
 期中一部解約元本額 521,485,314円

損益の状況

当期(2017年11月21日～2018年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 286円
受取利息	37
支払利息	△ 323
(B) 有価証券売買損益	△ 80,626,340
売買益	17,315,759
売買損	△ 97,942,099
(C) 信託報酬等	△ 2,551,721
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 83,178,347
(E) 前期繰越損益金	76,178,946
(分配準備積立金)	(76,178,946)
(F) 追加信託差損益金*	186,154,883
(配当等相当額)	(169,721,701)
(売買損益相当額)	(16,433,182)
(G) 合計(D+E+F)	179,155,482
次期繰越損益金(G)	179,155,482
追加信託差損益金	186,154,883
(配当等相当額)	(171,248,301)
(売買損益相当額)	(14,906,582)
分配準備積立金	101,471,840
繰越欠損金	△ 108,471,241

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	25,292,894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	171,248,301円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	76,178,946円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	272,720,141円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	2,591.20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

代表取締役社長に西啓介が就任いたしました。

(2018年3月25日)

■関連会社の実質保有比率

2018年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に9.1%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、J P X 日経インデックス400（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ J P X 日経400 インデックスファンド	ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ J P X 日経400 インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ J P X 日経400 インデックスファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ J P X 日経400 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

ニッセイ J P X 日経400インデックス マザーファンド

運用報告書

第 8 期

(計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式

運用方法

- 以下の様な投資制限のもと運用を行います。
- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
 - ・ 外貨建資産への投資は行いません。



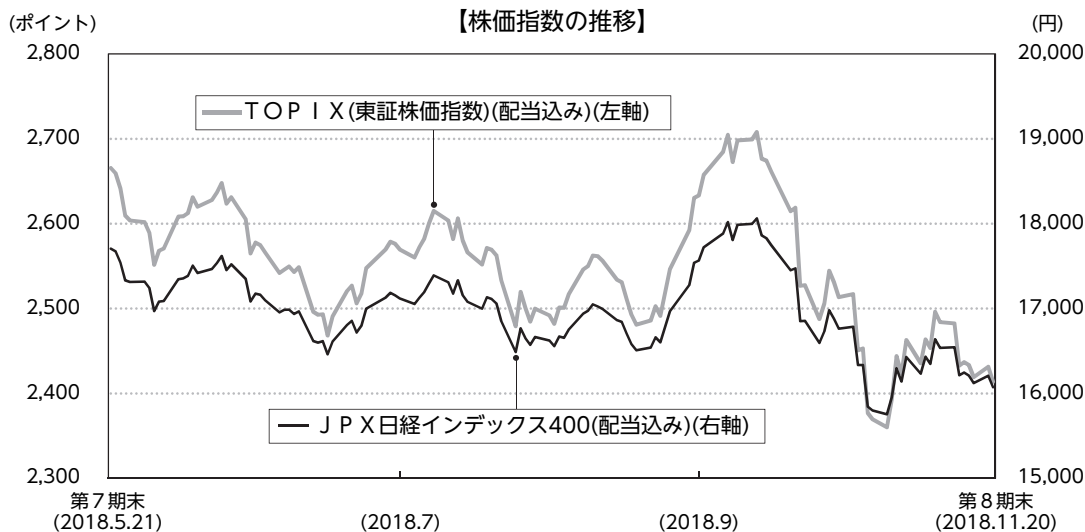
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

国内株式市況



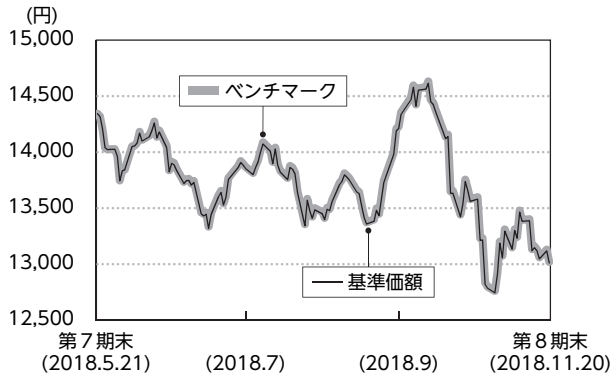
(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、米国の保護主義的な政策やイタリアの政局混迷による欧州財政への懸念などを背景に国内株式市場は下落しました。その後、米中貿易摩擦に対する懸念や新興国への不安などの高まりと落ち着きに依りて、国内株式市場は上下して推移しました。

9月に入ると米中貿易摩擦への警戒感が一服し、円安の進行も追い風となり国内株式市場は上昇しましたが、10月には米株急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念など、景気の先行き不透明感等から国内株式市場は下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、米国の保護主義的な政策やイタリアの政局混迷による欧州財政への懸念などによる株価の下落を受けて下落しました。その後、米中貿易摩擦に対する懸念や新興国への不安などを背景に、基準価額は上下して推移しました。9月に入ると米中貿易摩擦への警戒感が一服し、円安の進行も追い風となり、株価上昇から基準価額も上昇しましたが、10月には米株急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念など景気の先行き不透明感等から基準価額は下落に転じ、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークは J P X 日経インデックス400 (配当込み) で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。「J P X 日経インデックス400」は、日本取引所グループおよび東京証券取引所 (以下総称して「J P X グループ」といいます) ならびに日本経済新聞社 (以下「日経」といいます) の知的財産であり、その商標権その他の知的財産権は、すべて「J P X グループ」および「日経」に帰属しています。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X 日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。「J P X グループ」および「日経」は、当商品の運用および取引に関して、一切の責任を負いません。以下同じです。

ポートフォリオ

主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-9.3%となり、ベンチマーク騰落率 (-9.2%) にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式		純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率	組入比率	先物比率	
	円	%		%	%	%	百万円
4期(2016年11月21日)	11,303	7.8	11,586	7.8	96.7	3.4	50,607
5期(2017年5月22日)	12,373	9.5	12,671	9.4	97.4	2.6	48,317
6期(2017年11月20日)	13,893	12.3	14,265	12.6	96.1	3.9	44,365
7期(2018年5月21日)	14,344	3.2	14,803	3.8	96.4	3.6	30,672
8期(2018年11月20日)	13,010	△ 9.3	13,437	△ 9.2	94.5	5.3	22,285

(注1) ベンチマークは J P X 日経インデックス400 (配当込み) で、設定時を10,000として指数化しています。「J P X 日経インデックス400」は、日本取引所グループおよび東京証券取引所 (以下総称して「J P X グループ」といいます) ならびに日本経済新聞社 (以下「日経」といいます) の知的財産であり、その商標権その他の知的財産権は、すべて「J P X グループ」および「日経」に帰属しています。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。「J P X グループ」および「日経」は、「J P X 日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X 日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。「J P X グループ」および「日経」は、当商品の運用および取引に関して、一切の責任を負いません。以下同じです。

(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		ベンチマーク		株式	
		騰落率		騰落率	組入比率	先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2018年5月21日	14,344	-	14,803	-	96.4	3.6
5月末	13,834	△3.6	14,281	△3.5	95.7	4.3
6月末	13,731	△4.3	14,184	△4.2	96.9	3.0
7月末	13,898	△3.1	14,359	△3.0	96.1	3.9
8月末	13,751	△4.1	14,207	△4.0	96.1	3.9
9月末	14,553	1.5	15,036	1.6	95.4	4.6
10月末	13,187	△8.1	13,624	△8.0	95.5	4.9
(期末)2018年11月20日	13,010	△9.3	13,437	△9.2	94.5	5.3

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.003% (0.000) (0.003)	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	1	0.004	

(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（13,724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

2018年5月22日～2018年11月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		1,957	4,375,585	4,554	10,567,728
		(△ 439)			

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	8,814	8,630	4,899	4,900

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2018年5月22日～2018年11月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
リクルートホールディングス	97	330,129	3,382	ソニー	38	227,679	5,898
任天堂	8	328,059	40,007	トヨタ自動車	31	224,642	7,064
JXTGホールディングス	225	180,255	799	キーエンス	2	190,686	65,754
三菱UFJフィナンシャル・グループ	199	134,276	673	本田技研工業	47	161,872	3,436
ソフトバンクグループ	11	107,193	9,570	ソフトバンクグループ	16	154,953	9,223
日本電信電話	20	100,502	5,000	三井住友フィナンシャルグループ	31	143,988	4,571
電通	15	80,498	5,193	日本電信電話	24	123,601	5,107
三井住友フィナンシャルグループ	16	73,447	4,371	みずほフィナンシャルグループ	600	118,535	197
出光興産	11	64,141	5,726	三菱商事	35	116,160	3,281
ソニー	8	48,328	5,753	三菱UFJフィナンシャル・グループ	164	115,745	705

(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

2018年11月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
日本水産	19	16	11,376
マルハニチロ	-	2	9,809
鉱業(0.4%)			
国際石油開発帝石	84	64	80,701
建設業(2.9%)			
安藤・間	13	10	7,252
東急建設	6	4	5,249
コムシスホールディングス	6	5	14,710
大成建設	17	13	63,600
大林組	51	39	43,687
清水建設	52	40	37,398
長谷工コーポレーション	20	16	21,829
鹿島建設	76	30	46,319
西松建設	-	2	7,072

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井住友建設	12	9	6,764
前田建設工業	12	9	10,302
戸田建設	20	15	11,260
熊谷組	2	1	6,336
大東建託	6	4	67,304
NIPPON	4	3	6,335
前田道路	5	4	8,831
五洋建設	20	15	10,424
住友林業	11	9	14,768
大和ハウス工業	51	36	126,436
積水ハウス	56	40	67,986
協和エクシオ	6	4	13,631
九電工	3	2	11,310
食料品(4.3%)			
森永製菓	-	3	14,640

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
江崎グリコ	4	3	18,795	
カルビー	7	5	20,088	
ヤクルト本社	9	8	71,079	
明治ホールディングス	10	8	73,584	
日本ハム	6	5	21,420	
アサヒグループホールディングス	32	24	121,178	
麒麟ホールディングス	74	53	137,291	
サントリー食品インターナショナル	11	7	36,261	
キッコーマン	12	7	46,410	
味の素	35	27	51,124	
キューピー	8	6	18,097	
ニチレイ	7	6	19,215	
東洋水産	8	6	23,210	
日清食品ホールディングス	6	5	34,550	
日本たばこ産業	95	68	192,654	
繊維製品(0.5%)				
帝人	13	9	18,095	
東レ	117	89	81,834	
パルプ・紙(0.2%)				
王子ホールディングス	68	51	34,498	
大王製紙	6	-	-	
化学(7.4%)				
クラレ	27	19	34,667	
旭化成	100	81	99,017	
昭和電工	-	7	33,495	
住友化学	119	90	53,422	
日産化学	9	7	41,819	
東ソー	23	17	28,658	
デンカ	5	4	15,367	
信越化学工業	26	20	196,605	
エア・ウォーター	13	9	16,995	
太陽日酸	12	9	17,632	
日本パーカライジング	8	6	9,235	
三菱瓦斯化学	13	11	21,641	
三井化学	14	10	30,649	
J S R	16	11	19,986	
三菱ケミカルホールディングス	108	77	70,385	
ダイセル	21	17	23,073	
積水化学工業	33	25	46,998	
日本ゼオン	13	10	11,440	
アイカ工業	4	3	12,110	
宇部興産	8	5	14,935	

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
日立化成	8	5	9,328	
ダイキョーニシカワ	3	2	2,373	
日本化薬	10	-	-	
日油	6	4	16,500	
花王	37	28	227,658	
日本ペイントホールディングス	12	9	34,865	
関西ペイント	17	12	24,135	
D I C	6	5	18,304	
資生堂	28	23	170,094	
ライオン	21	16	33,538	
コーセー	2	2	36,400	
シーズ・ホールディングス	1	1	8,204	
ポーラ・オルビスホールディングス	-	5	15,825	
小林製薬	4	3	24,189	
日東電工	11	8	52,447	
ニフコ	5	4	13,479	
ユニ・チャーム	32	24	82,742	
医薬品(5.9%)				
協和発酵キリン	19	14	32,986	
武田薬品工業	56	46	207,686	
アステラス製薬	158	108	180,052	
大日本住友製薬	11	8	25,073	
塩野義製薬	21	15	116,762	
田辺三菱製薬	18	12	20,479	
中外製薬	16	12	87,699	
科研製薬	2	2	11,529	
エーザイ	18	14	138,828	
小野薬品工業	36	27	73,781	
久光製薬	4	3	24,605	
参天製薬	29	22	40,184	
ツムラ	5	3	12,582	
沢井製薬	3	2	13,608	
第一三共	44	33	135,844	
大塚ホールディングス	32	22	113,433	
石油・石炭製品(0.9%)				
出光興産	-	9	37,037	
J X T Gホールディングス	-	200	134,294	
コスモエネルギーホールディングス	-	3	9,523	
ゴム製品(0.9%)				
横浜ゴム	8	6	16,034	
東洋ゴム工業	9	-	-	
ブリヂストン	51	36	157,432	

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友ゴム工業	15	10	16,451
ガラス・土石製品(0.8%)			
A G C	15	11	45,636
住友大阪セメント	30	-	-
太平洋セメント	9	7	28,268
T O T O	11	9	39,195
日本碍子	18	14	23,860
日本特殊陶業	13	9	23,760
ニチアス	-	3	7,129
鉄鋼(0.9%)			
新日鐵住金	68	52	110,890
ジェイエフイーホールディングス	41	31	65,374
東京製鐵	8	6	6,150
日立金属	16	12	16,212
非鉄金属(0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	44	31	7,671
三菱マテリアル	10	7	23,523
住友金属鉱山	19	15	50,434
DOWAホールディングス	3	2	9,720
古河電気工業	-	3	10,897
住友電気工業	57	43	68,425
金属製品(0.3%)			
S U M C O	-	12	19,571
三和ホールディングス	14	12	16,080
リンナイ	2	2	17,724
東プレ	-	2	5,009
日本発条	15	11	11,449
機械(4.9%)			
アマダホールディングス	23	17	20,227
オーエスジー	7	5	12,243
DMG森精機	8	7	10,619
ディスコ	2	1	26,112
ニューフレアテクノロジー	0.300	-	-
ナブテスコ	8	6	17,996
三井海洋開発	-	1	3,358
S M C	4	3	127,670
小松製作所	74	53	153,987
住友重機械工業	8	6	24,187
日立建機	7	4	14,170
ハーモニック・ドライブ・システムズ	2	2	7,119
クボタ	82	63	119,227
荏原製作所	6	5	14,877

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイキン工業	21	16	185,311
椿本チエイン	9	1	6,255
ダイフク	7	6	35,425
タダノ	7	5	7,478
平和	4	3	7,903
竹内製作所	2	2	4,322
T P R	1	1	4,324
ホシザキ	4	3	27,880
日本精工	31	24	25,434
ジェイテクト	16	11	15,492
T H K	9	7	17,921
イーグル工業	1	-	-
マキタ	20	14	62,634
三菱重工業	25	19	85,104
電気機器(14.0%)			
コニカミノルタ	36	25	26,676
ブラザー工業	18	15	28,809
ミネベアミツミ	28	21	35,599
日立製作所	371	52	170,338
三菱電機	154	117	171,519
富士電機	46	7	25,080
安川電機	17	13	43,928
日本電産	18	14	195,355
オムロン	16	12	57,875
日本電気	20	15	51,148
富士通	159	11	78,083
ルネサスエレクトロニクス	8	12	6,649
セイコーエプソン	23	14	27,039
アルバック	3	2	10,867
エレコム	1	1	3,151
パナソニック	176	134	148,938
富士通ゼネラル	4	3	5,601
ソニー	90	59	341,969
T D K	8	6	53,816
アルプス電気	13	10	26,955
クラリオン	8	1	2,471
ヒロセ電機	2	1	19,856
日本航空電子工業	4	-	-
横河電機	15	11	24,638
日本光電工業	6	5	16,926
堀場製作所	3	2	11,327
アドバンテスト	8	8	17,216

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キーエンス	7	5	329,400
シスメックス	12	9	57,122
OBARAGROUP	0.900	0.700	3,139
スタンレー電気	11	8	27,141
カシオ計算機	12	10	16,369
ファナック	14	11	208,264
浜松ホトニクス	11	8	30,660
京セラ	25	17	103,462
村田製作所	16	12	193,171
小糸製作所	9	7	42,000
ミツバ	2	-	-
SCREENホールディングス	2	2	10,580
キヤノン	83	63	202,749
リコー	46	-	-
東京エレクトロン	10	7	114,231
輸送用機器(6.9%)			
トヨタ紡織	4	4	7,474
豊田自動織機	12	9	54,435
デンソー	34	26	133,997
川崎重工業	12	9	23,860
日産自動車	182	138	131,862
いすゞ自動車	44	37	59,427
トヨタ自動車	69	43	290,846
日野自動車	22	14	15,684
日信工業	3	-	-
NOK	8	6	10,306
アイシン精機	12	9	43,213
マツダ	48	36	43,486
本田技研工業	133	97	309,318
スズキ	30	21	114,595
SUBARU	47	36	93,111
ヤマハ発動機	21	16	37,217
豊田合成	5	3	8,242
シマノ	6	4	73,884
テイ・エステック	3	2	8,869
精密機器(1.9%)			
テルモ	23	16	103,816
島津製作所	18	15	37,523
オリンパス	23	17	63,437
HOYA	31	23	159,903
朝日インテック	7	5	29,412

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セイコーホールディングス	2	-	-
その他製品(1.8%)			
バンダイナムコホールディングス	16	12	59,780
パイロットコーポレーション	2	2	12,012
アシックス	15	11	17,784
ヤマハ	10	7	33,285
ピジョン	9	7	34,541
任天堂	-	7	224,784
電気・ガス業(1.9%)			
中部電力	47	36	62,190
関西電力	63	48	87,048
東北電力	36	27	41,745
九州電力	-	24	33,129
電源開発	12	9	27,748
東京瓦斯	32	23	66,400
大阪瓦斯	29	22	48,267
東邦瓦斯	7	5	26,129
陸運業(5.2%)			
東武鉄道	16	12	39,928
相鉄ホールディングス	6	5	18,414
東京急行電鉄	41	31	60,578
小田急電鉄	23	18	46,116
京王電鉄	8	6	41,382
京成電鉄	10	8	31,680
東日本旅客鉄道	27	20	216,106
西日本旅客鉄道	13	10	84,588
東海旅客鉄道	13	10	236,932
西武ホールディングス	19	15	32,400
西日本鉄道	5	-	-
近鉄グループホールディングス	14	11	51,171
阪急阪神ホールディングス	19	14	56,843
南海電気鉄道	9	-	-
京阪ホールディングス	8	6	30,921
名古屋鉄道	15	11	33,617
日本通運	5	4	31,900
ヤマトホールディングス	25	19	56,306
山九	3	3	17,081
日立物流	3	2	7,512
空運業(0.8%)			
日本航空	27	20	85,924
ANAホールディングス	28	20	82,395

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
情報・通信業(7.4%)				
新日鉄住金ソリューションズ	2	1	5,380	
T I S	-	3	19,190	
ネクソン	34	29	32,281	
コロプラ	4	3	2,633	
ティーガイア	1	1	2,768	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41	27	6,616	
野村総合研究所	9	7	35,806	
オービック	4	4	37,720	
ヤフー	109	75	23,011	
トレンドマイクロ	7	6	37,698	
日本オラクル	2	1	13,642	
伊藤忠テクノソリューションズ	6	5	10,637	
大塚商会	9	6	23,188	
日本ユニシス	-	3	9,784	
日本テレビホールディングス	13	10	18,910	
日本電信電話	68	64	298,851	
K D D I	125	101	260,352	
光通信	1	1	25,004	
NTTドコモ	108	82	214,420	
GMOインターネット	5	4	5,901	
東宝	10	7	28,044	
エヌ・ティ・ティ・データ	47	30	39,848	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7	5	18,333	
カプコン	-	4	10,584	
S C S K	3	3	12,855	
コナミホールディングス	6	4	22,701	
ソフトバンクグループ	44	39	345,077	
卸売業(5.2%)				
双日	89	64	25,664	
アルフレッサホールディングス	16	12	39,474	
神戸物産	1	1	5,525	
シップヘルスケアホールディングス	3	2	10,296	
第一興商	3	2	11,960	
メディカルホールディングス	15	12	32,012	
伊藤忠商事	111	85	174,590	
丸紅	124	114	99,262	
豊田通商	17	12	51,729	
兼松	6	4	6,785	
三井物産	129	95	170,670	
日立ハイテクノロジーズ	5	3	13,912	
住友商事	95	68	119,875	

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
三菱商事	106	81	248,534	
阪和興業	2	2	6,230	
岩谷産業	3	2	10,153	
東邦ホールディングス	4	3	10,608	
サンリオ	4	-	-	
P A L T A C	-	2	12,453	
日鉄住金物産	1	0.800	4,096	
ミスミグループ本社	17	14	33,770	
小売業(5.0%)				
ローソン	3	2	21,112	
エービーシー・マート	2	1	10,764	
アダストリア	2	1	3,227	
セリア	3	3	13,365	
ビックカメラ	8	6	9,244	
Monotaro	5	7	19,038	
J. フロントリテイリング	18	14	23,783	
マツモトキヨシホールディングス	6	4	19,704	
Z O Z O	14	12	27,875	
ウエルシアホールディングス	4	3	17,918	
クリエイトSDホールディングス	2	1	5,096	
すかいらーくホールディングス	-	10	19,180	
コスモス薬品	0.800	0.600	12,966	
セブン&アイ・ホールディングス	63	48	241,190	
ツルハホールディングス	3	2	28,200	
クスリのアオキホールディングス	1	0.900	7,389	
ノジマ	2	2	5,476	
良品計画	2	1	46,288	
ドンキホーテホールディングス	9	7	52,500	
ゼンショーホールディングス	-	5	15,119	
ユナイテッドアローズ	1	1	5,089	
スギホールディングス	3	2	13,100	
エー・ファミリーマートホールディングス	4	3	49,856	
日本瓦斯	2	2	7,969	
しまむら	1	1	12,129	
高島屋	24	-	-	
丸井グループ	-	9	23,853	
イオン	58	44	120,821	
イズミ	2	2	15,792	
ヤオコー	1	1	8,229	
ケーズホールディングス	13	12	14,532	
アインホールディングス	2	1	13,936	
ニトリホールディングス	6	5	71,425	

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パローホールディングス	3	-	-
ファーストリテイリング	2	1	87,405
サンドラッグ	6	4	17,050
銀行業(6.3%)			
めぶきフィナンシャルグループ	79	60	20,562
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2	-	-
九州フィナンシャルグループ	33	25	12,877
コンソルディア・フィナンシャルグループ	90	73	37,615
新生銀行	13	8	13,557
あおぞら銀行	9	6	24,440
三菱UFJフィナンシャル・グループ	499	534	341,257
りそなホールディングス	167	127	73,579
三井住友トラスト・ホールディングス	29	22	103,147
三井住友フィナンシャルグループ	88	73	307,346
千葉銀行	53	41	29,509
群馬銀行	30	-	-
静岡銀行	40	29	29,229
スルガ銀行	15	-	-
ほくほくフィナンシャルグループ	10	-	-
広島銀行	22	17	11,918
中国銀行	14	-	-
セブン銀行	57	39	14,504
みずほフィナンシャルグループ	1,986	1,575	299,263
山口フィナンシャルグループ	19	-	-
証券、商品先物取引業(1.1%)			
F P G	4	3	4,625
S B Iホールディングス	17	13	36,335
ジャフコ	2	-	-
大和証券グループ本社	130	93	58,401
野村ホールディングス	261	212	109,102
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16	13	7,686
松井証券	7	5	6,925
カブドットコム証券	9	-	-
保険業(3.1%)			
S O M P Oホールディングス	29	22	100,038
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	39	30	104,777
ソニーフィナンシャルホールディングス	12	9	22,952
第一生命ホールディングス	86	65	132,052
東京海上ホールディングス	57	42	232,428
T & Dホールディングス	47	35	59,988
その他金融業(1.3%)			
全国保証	4	3	12,589

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	1	1	8,008
興銀リース	2	-	-
東京センチュリー	3	2	12,190
イオンフィナンシャルサービス	10	7	16,576
オリエントコーポレーション	32	31	5,589
日立キャピタル	4	2	7,500
オリックス	101	77	138,700
三菱UFJリース	38	26	15,641
日本取引所グループ	43	31	63,914
不動産業 (2.8%)			
いちご	21	14	5,747
ヒューリック	31	24	25,869
野村不動産ホールディングス	10	7	16,755
プレサンスコーポレーション	2	1	2,386
オープンハウス	2	1	6,992
東急不動産ホールディングス	36	31	19,125
飯田グループホールディングス	12	9	18,750
パーク24	8	6	20,128
三井不動産	76	61	169,094
三菱地所	113	81	142,396
東京建物	16	12	15,011
住友不動産	36	26	108,262
レオパレス21	18	14	6,482
スターツコーポレーション	2	1	4,254
イオンモール	9	5	12,209
エヌ・ティ・ティ都市開発	9	7	12,088
サービス業 (4.2%)			
ミクシィ	3	3	7,598
日本M&Aセンター	10	8	21,033
パーソルホールディングス	13	11	21,492
総合警備保障	5	4	23,625
カカクコム	11	8	16,821
ディップ	2	1	4,093
エムスリー	15	23	40,361
ディー・エヌ・エー	7	6	12,828
博報堂DYホールディングス	20	15	26,098
電通	-	13	68,637
オリエンタルランド	17	13	145,768
リゾートトラスト	6	4	8,644
ユー・エス・エス	18	13	25,153
サイバーエージェント	9	6	32,361
楽天	75	52	47,998

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エン・ジャパン	-	1	6,424
テクノプロ・ホールディングス	-	2	10,836
リクルートホールディングス	-	80	232,162
リログループ	8	6	16,903
カナモト	2	1	5,424
セコム	15	11	106,814
メイテック	1	1	6,678
イオンディライト	1	1	5,523
合計	株数・金額	12,829	9,793 21,056,950
	銘柄数<比率>	399	400 <94.5%>

(注1) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(注4) 業種は東証33業種分類によるものです。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	1,184	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	21,056,950	94.2
コール・ローン等、その他	1,284,935	5.8
投資信託財産総額	22,341,885	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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	25,754,405,366円
コール・ローン等 株式(評価額)	1,026,663,066 21,056,950,120
未収配当金	215,852,380
差入委託証拠金	3,454,939,800
(B)負債	3,468,415,596
未払金	53,399,420
未払解約金	1,373,386
差入委託証拠金代用有価証券	3,413,624,800
その他未払費用	17,990
(C)純資産総額(A-B)	22,285,989,770
元本	17,130,092,481
次期繰越損益金	5,155,897,289
(D)受益権総口数	17,130,092,481口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,010円

- (注1) 担保に供している資産
先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れています。
- 株式 3,883,971,630円
- (注2) 期首元本額 21,383,616,067円
期中追加設定元本額 2,389,281,843円
期中一部解約元本額 6,642,805,429円
- (注3) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
J P X 日経400インデックスファンド(適格機関投資家限定) 16,183,399,037円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ J P X 日経400インデックスファンド 946,693,444円

損益の状況

当期(2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	266,117,269円
受取配当金	266,152,253
受取利息	7,266
その他収益金	351,434
支払利息	△ 393,684
(B)有価証券売買損益	△2,314,672,483
売買益	555,830,049
売買損	△2,870,502,532
(C)先物取引等損益	△ 108,106,680
取引益	86,364,260
取引損	△ 194,470,940
(D)信託報酬等	△ 91,921
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△2,156,753,815
(F)前期繰越損益金	9,289,029,115
(G)追加信託差損益金	861,499,809
(H)解約差損益金	△2,837,877,820
(I)合計(E+F+G+H)	5,155,897,289
次期繰越損益金(I)	5,155,897,289

- (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。