

第2期末 (2017年2月20日)	
基準価額	9,820円
純資産総額	63億円
騰落率	21.3%
分配金	0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

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：2016年2月23日～2017年2月20日

第2期 (決算日 2017年2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TOPIXインデックスファンド」は、このたび第2期の決算を行いました。


当ファンドは、「ニッセイ国内株式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等に投資することにより、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。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後とも是非ご継続頂き、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。

 <http://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

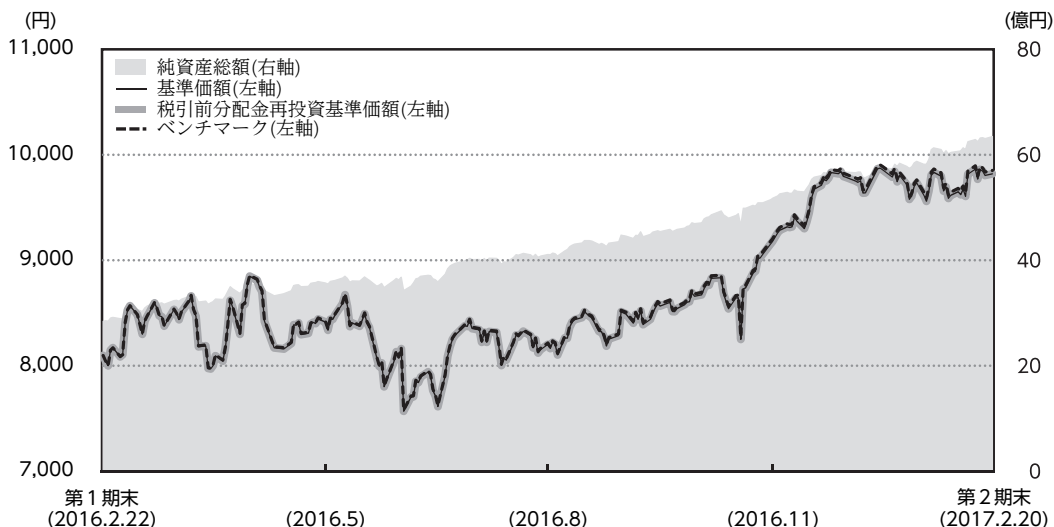
東京都千代田区丸の内1-6-6

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOP I Xインデックスファンド

運用経過

2016年2月23日～2017年2月20日

基準価額等の推移



第2期首	8,098円	既払分配金	0円
第2期末	9,820円	騰落率(分配金再投資ベース)	21.3%

- (注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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TOP I X(東証株価指数)(配当込み)としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOP I X(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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は、株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、投資家のリスク回避姿勢や為替市場の動向を背景に、株価が値動きの荒い展開となったことから一進一退の動きとなりました。6月には、Brexit(イギリスの欧州連合(EU)離脱)に関する国民投票結果を受けて円高が進行したことにより、株価が急落し基準価額は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、11月の米大統領選後には、米国の早期利上げ観測等を背景に株価が上昇したことから基準価額も上昇しました。年明け以降は、為替市場の変動等を背景に株価がもみ合う展開となったことから基準価額も同様の推移となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

1 万口当たりの費用明細

2016年2月23日～2017年2月20日

項目	第2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	24円	0.277%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は8,684円です。
(投信会社)	(11)	(0.124)	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)	(0.124)	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)	(0.029)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
その他費用	1	0.007	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ その他費用は、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
(監査費用)	(1)	(0.007)	・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
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	25	0.286	

(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。

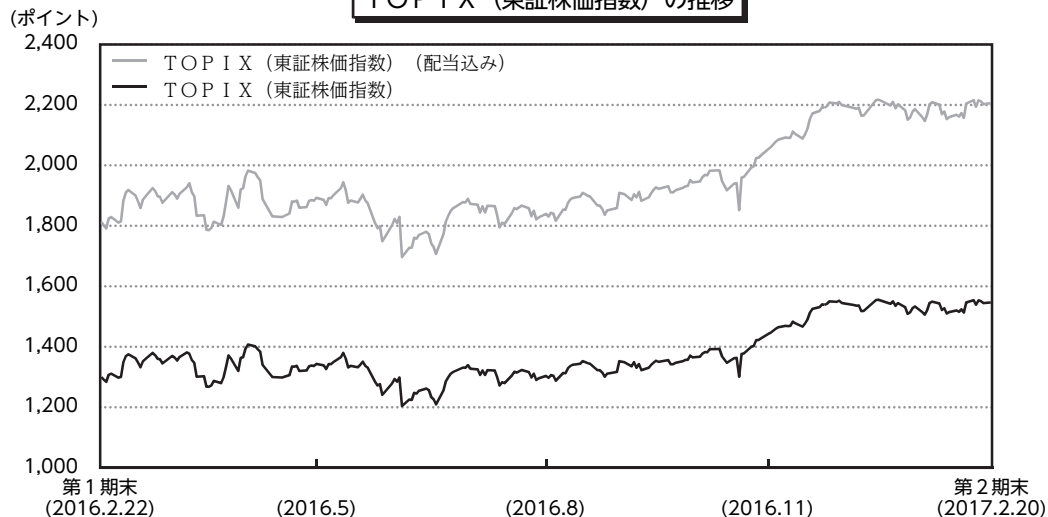
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

(注4) 当ファンドでは、信託報酬率の上限の引き下げを行いましたので、上記金額には引き下げ後の信託報酬率が加味されています。

国内株式市況

TOPIX (東証株価指数) の推移



(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、期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、投資家のリスク回避姿勢や、4月末に決定された日銀の追加緩和見送りなどを背景に株価は値動きの荒い展開となりましたが、その後は、徐々に落ち着きを取り戻しました。6月には、Brexitに関する国民投票結果を受けて円高が進行したことから株価は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、10月には、米国の年内利上げ観測を背景に円安となったことや、原油高等による影響から上昇しました。

11月には、米大統領選の結果を受けて株価は一時急落しましたが、米株式市場が上昇したことに加え、トランプ次期大統領の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げ観測を受けて米長期金利が上昇し円安が進行したことから急反発しました。その後も、米国の利上げペースが加速するとの見方から上昇が続き、年明け以降は、為替市場の変動等を背景にもみ合う展開となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOP I Xインデックスファンド

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

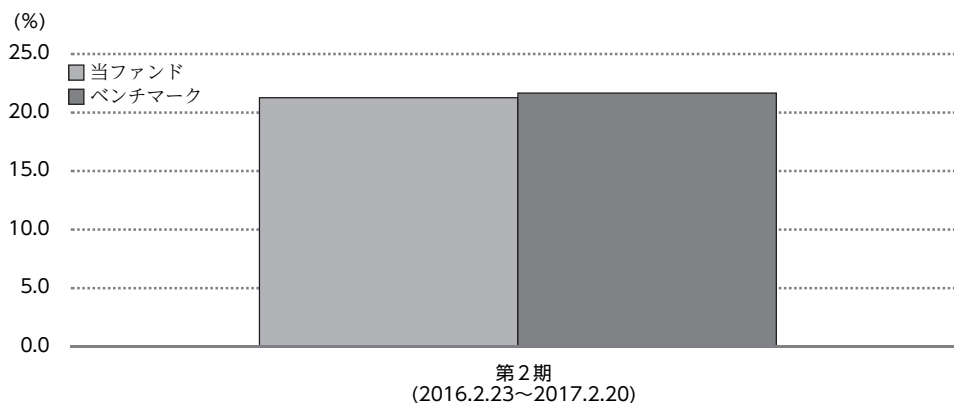
当期も東証一部上場銘柄のうち1,700銘柄程度に分散投資を行いました。

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）。

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

*ベンチマークの詳細につきましては、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+21.3%となり、ベンチマーク騰落率（+21.7%）にはほぼ連動しました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

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
	2016年2月23日 ～2017年2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	843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。

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。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			(ご参考)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額	
		税引前 分配金	期中 騰落率	基準価額+ 累計分配金	ベンチマーク 期中 騰落率				
(設定日) 2015年4月27日	円 10,000	円 -	% -	円 10,000	10,000	% -	% -	百万円 182	
1期(2016年2月22日)	8,098	0	△19.0	8,098	8,120	△18.8	98.3	1.7	2,843
2期(2017年2月20日)	9,820	0	21.3	9,820	9,879	21.7	97.7	2.3	6,347

(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TOPIX(東証株価指数)(配当込み)としており、設定時を10,000として指数化しています。なおTOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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は、株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

(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		ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2016年2月22日	円 8,098	% -	8,120	% -	% 98.3	% 1.7
2月末	8,085	△0.2	8,109	△0.1	97.8	2.1
3月末	8,469	4.6	8,501	4.7	93.8	2.5
4月末	8,424	4.0	8,459	4.2	97.7	2.3
5月末	8,673	7.1	8,707	7.2	97.2	2.8
6月末	7,841	△3.2	7,872	△3.1	97.4	3.7
7月末	8,324	2.8	8,359	2.9	98.4	1.6
8月末	8,367	3.3	8,405	3.5	98.2	1.8
9月末	8,390	3.6	8,434	3.9	97.9	2.2
10月末	8,833	9.1	8,882	9.4	97.5	2.7
11月末	9,318	15.1	9,369	15.4	97.8	1.9
12月末	9,639	19.0	9,695	19.4	99.2	0.9
2017年1月末	9,658	19.3	9,716	19.6	98.1	1.7
(期末) 2017年2月20日	9,820	21.3	9,879	21.7	97.7	2.3

(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。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2016年2月23日～2017年2月20日)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4,219,973	5,884,933	2,361,015	3,340,177

(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	7,751,597千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	35,357,629千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.21

(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

(2016年2月23日～2017年2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

(2017年2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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	2,224,600	4,083,558	6,347,482

(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国内株式インデックスマザーファンド全体の口数は26,374,834千口です。

◆投資信託財産の構成

(2017年2月20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	6,347,482	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	38,807	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	6,386,290	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	6,386,290,387円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,225,730
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	6,347,482,695
未 収 入 金	32,581,962
(B)負 債	38,910,967
未 払 解 約 金	32,478,615
未 払 信 託 報 酬	6,271,103
そ の 他 未 払 費 用	161,249
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	6,347,379,420
元 本	6,464,017,336
次 期 繰 越 損 益 金	△ 116,637,916
(D)受 益 権 総 口 数	6,464,017,336口
1万口当たり基準価額 (C/D)	9,820円

(注1) 期首元本額 3,511,316,929円
 期中追加設定元本額 6,672,478,056円
 期中一部解約元本額 3,719,777,649円

(注2) 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
 116,637,916円です。

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日～2017年2月20日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	△ 1,238円
受 取 利 息	461
支 払 利 息	△ 1,699
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	717,488,868
売 買 益	936,806,700
売 買 損	△ 219,317,832
(C)信 託 報 酬 等	△ 12,065,628
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	705,422,002
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△ 193,687,251
(分 配 準 備 積 立 金)	(6,452,958)
(繰 越 欠 損 金)	(△ 200,140,209)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	△ 628,372,667
(配 当 等 相 当 額)	(26,473,679)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 654,846,346)
(G)合 計 (D + E + F)	△ 116,637,916
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△ 116,637,916
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 628,372,667
(配 当 等 相 当 額)	(33,213,741)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 661,586,408)
分 配 準 備 積 立 金	511,734,751

(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	85,598,635円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	419,683,158円
(c)信託約款に定める収益調整金	33,213,741円
(d)信託約款に定める分配準備積立金	6,452,958円
(e)分配対象額 (a + b + c + d)	544,948,492円
(f)分配対象額 (1万口当たり)	843.05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

代表取締役社長に赤林富二が就任いたしました。 (2016年4月1日)

約款変更

信託報酬率の上限を引き下げたことに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
(2016年11月18日)

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

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	ニッセイ国内株式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等に投資することにより、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す。	
主要運用対象	＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイTOPIX インデックスファンド	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
運 用 方 法	＜購入・換金手数料なし＞ ニッセイTOPIX 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。
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17期

(計算期間：2016年2月23日～2017年2月20日)

●受益者の皆様へ

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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。

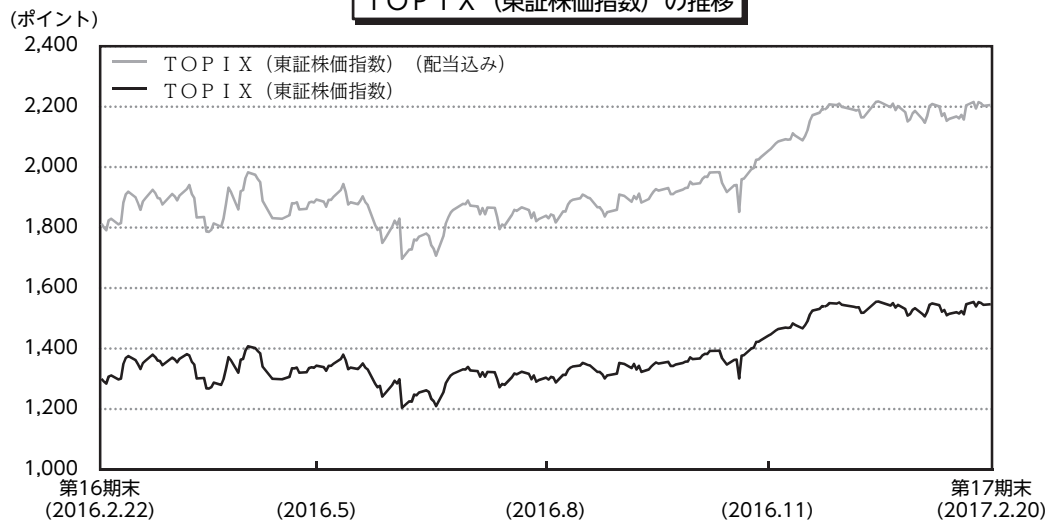


ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

国内株式市況

TOPIX（東証株価指数）の推移



（注）各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

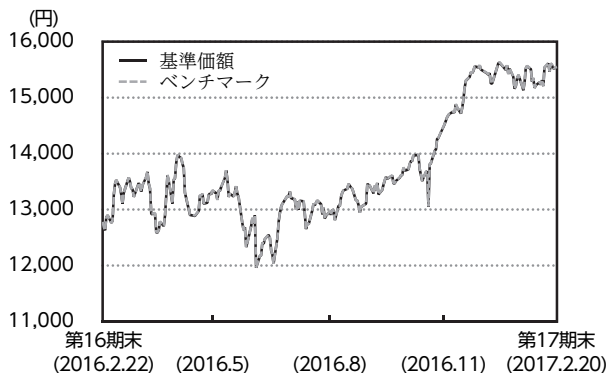
当期の国内株式市場は、期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、投資家のリスク回避姿勢や、4月末に決定された日銀の追加緩和見送りなどを背景に株価は値動きの荒い展開となりましたが、その後は、徐々に落ち着きを取り戻しました。6月には、Brexitに関する国民投票結果を受けて円高が進行したことから株価は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、10月には、米国の年内利上げ観測を背景に円安となったことや、原油高等による影響から上昇しました。

11月には、米大統領選の結果を受けて株価は一時急落しましたが、米株式市場が上昇したことに加え、トランプ次期大統領の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げ観測を受けて米長期金利が上昇し円安が進行したことから急反発しました。その後も、米国の利上げペースが加速するとの見方から上昇が続き、年明け以降は、為替市場の変動等を背景にもみ合う展開となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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、投資家のリスク回避姿勢や為替市場の動向を背景に、株価が値動きの荒い展開となったことから一進一退の動きとなりました。6月には、Brexit（イギリスの欧州連合（EU）離脱）に関する国民投票結果を受けて円高が進行したことにより、株価が急落し基準価額は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、11月の米大統領選後には、米国の早期利上げ観測等を背景に株価が上昇したことから基準価額も上昇しました。年明け以降は、為替市場の変動等を背景に株価がもみ合う展開となったことから基準価額も同様の推移となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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は、株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄のうち1,700銘柄程度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）。

また資金の流出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。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+21.6%となり、ベンチマーク騰落率（+21.7%）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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆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		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
				期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2013年2月20日)	9,039	21.7	9,115	21.8	98.4	1.1	35,007
14期(2014年2月20日)	11,293	24.9	11,401	25.1	98.6	1.4	31,810
15期(2015年2月20日)	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3	42,826
16期(2016年2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998

(注1) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(配当込み)としており、設定時を10,000として指数化しています。なおTOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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は、株式会社東京証券取引所が有しています。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	騰落率	ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
				騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2016年2月22日	12,782	-	12,904	-	98.3	1.7
2月末	12,763	△0.1	12,886	△0.1	97.8	2.1
3月末	13,373	4.6	13,508	4.7	93.8	2.5
4月末	13,304	4.1	13,442	4.2	97.7	2.3
5月末	13,701	7.2	13,836	7.2	97.2	2.8
6月末	12,390	△3.1	12,510	△3.1	97.4	3.7
7月末	13,157	2.9	13,283	2.9	98.4	1.6
8月末	13,229	3.5	13,356	3.5	98.2	1.8
9月末	13,269	3.8	13,402	3.9	97.9	2.2
10月末	13,973	9.3	14,114	9.4	97.5	2.7
11月末	14,743	15.3	14,889	15.4	97.8	1.9
12月末	15,254	19.3	15,406	19.4	99.2	0.9
2017年1月末	15,286	19.6	15,439	19.6	98.1	1.7
(期末)						
2017年2月20日	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆ 1万口当たりの費用明細

(2016年2月23日～2017年2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)	0.002% (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（13,729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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上 場	千株	千円	千株	千円
内		3,526 (△2,072)	3,801,023	3,608	3,950,574

(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		百万円	百万円	百万円	百万円
内	株 式 先 物 取 引	7,842	7,603	—	—

(注) 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

◆主要な売買銘柄

(2016年2月23日～2017年2月20日)

株 式

買		付		売		付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	18	103,889	5,526	ソフトバンクグループ	27	176,408	6,533
日本電信電話	17	83,967	4,798	トヨタ自動車	25	161,389	6,327
三菱UFJフィナンシャル・グループ	117	55,401	471	三菱UFJフィナンシャル・グループ	171	97,945	570
ソフトバンクグループ	8	50,192	6,047	日本たばこ産業	15	64,702	4,174
東日本旅客鉄道	4	45,106	9,397	日産自動車	52	55,171	1,044
日本たばこ産業	10	42,375	4,195	みずほフィナンシャルグループ	299	53,763	179
九州旅客鉄道	13	40,581	3,006	アステラス製薬	31	50,371	1,584
本田技研工業	14	40,145	2,787	日本電信電話	10	48,644	4,864
みずほフィナンシャルグループ	252	39,770	157	武田薬品工業	9	45,117	4,851
三井住友フィナンシャルグループ	12	39,747	3,129	東京エレクトロン	5	43,407	8,511

(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

(2017年2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	株 数	評価額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)				
極洋	8	0.800	2,280	
日本水産	22	25	14,499	
マルハニチロ	4	3	12,483	
カネコ種苗	—	0.800	1,148	
サカタのタネ	2	2	9,236	
ホクト	2	2	4,272	
鉱業(0.3%)				
住石ホールディングス	6	2	287	
日鉄鉱業	5	0.600	3,618	
三井松島産業	13	1	1,812	
国際石油開発帝石	103	104	117,218	
日本海洋掘削	0.600	0.700	1,689	
石油資源開発	3	3	8,656	
K&Oエナジーグループ	1	1	2,295	

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(2.9%)				
ショーボンドホールディングス	2	2	10,500	
ミライト・ホールディングス	6	6	6,528	
サンヨーホームズ	—	1	1,261	
ダイセキ環境ソリューション	—	0.800	1,272	
安藤・間	13	14	12,155	
東急建設	6	7	5,928	
コムシスホールディングス	8	7	15,795	
ミサワホーム	2	2	2,529	
高松コンストラクショングループ	1	1	3,972	
東建コーポレーション	0.800	0.800	6,416	
ヤマウラ	—	2	1,276	
大成建設	102	101	81,406	
大林組	58	59	63,580	
清水建設	60	61	63,562	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額 千円
飛鳥建設	14	19	3,360
長谷工コーポレーション	22	23	29,881
松井建設	2	2	2,336
銭高組	3	3	1,284
鹿島建設	92	87	64,467
不動テトラ	13	16	3,268
鉄建建設	12	12	4,044
西松建設	23	23	13,455
三井住友建設	75	76	9,384
大豊建設	8	7	3,682
前田建設工業	12	12	12,024
佐田建設	2	2	1,184
ナカノフドー建設	1	-	-
奥村組	19	16	11,296
東鉄工業	2	2	7,548
イチケン	3	-	-
浅沼組	6	7	2,513
戸田建設	23	23	15,364
熊谷組	29	31	9,889
青木あすなろ建設	1	1	1,230
北野建設	4	4	1,280
植木組	4	5	1,315
三井ホーム	3	3	1,728
矢作建設工業	2	2	2,837
ピーエス三菱	2	3	1,292
日本ハウスホールディングス	4	4	2,119
大東建託	7	7	115,157
新日本建設	2	2	2,229
N I P P O	5	5	10,880
東亜道路工業	4	4	1,380
前田道路	6	6	12,072
日本道路	6	6	2,886
東亜建設工業	17	1	3,126
若築建設	11	11	1,672
東洋建設	6	5	2,416
五洋建設	21	22	11,403
大林道路	2	2	1,440
世紀東急工業	3	2	1,496
福田組	3	3	3,132
住友林業	13	13	22,015
日本基礎技術	2	3	1,270
日成ビルド工業	5	6	3,306
ヤマダ・エスバイエルホーム	15	-	-
巴コーポレーション	-	3	1,217

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額 千円
パナホーム	7	7	7,399
大和ハウス工業	57	58	182,809
ライト工業	3	3	4,392
積水ハウス	65	62	112,554
日特建設	2	2	1,149
北陸電気工事	1	1	1,150
ユアテック	3	3	2,412
西部電気工業	-	0.500	1,147
四電工	-	3	1,275
中電工	2	2	5,917
関電工	8	8	7,400
きんでん	11	13	19,602
東京エネシス	2	2	1,902
トーエネック	3	3	1,677
住友電設	1	1	1,789
日本電設工業	3	3	6,371
協和エクシオ	7	7	12,417
新日本空調	1	1	2,062
ND S	3	0.400	1,168
九電工	4	3	11,497
三機工業	4	4	4,408
日揮	20	18	38,185
中外炉工業	6	6	1,440
太平電業	3	3	3,156
高砂熱学工業	5	5	9,069
朝日工業社	2	0.500	1,517
明星工業	3	3	2,206
大気社	2	2	7,516
ダイダグン	3	3	2,883
日比谷総合設備	2	2	3,786
東芝プラントシステム	3	3	5,155
OSJBホールディングス	3	6	1,531
東洋エンジニアリング	10	12	3,240
千代田化工建設	14	14	10,080
新興プランテック	4	4	3,817
食料品(4.4%)			
日本製粉	13	5	10,000
日清製粉グループ本社	21	21	36,733
昭和産業	8	8	4,872
鳥越製粉	1	1	1,294
中部飼料	1	2	2,538
フィード・ワン	11	12	2,160
東洋精糖	10	-	-
日本甜菜製糖	10	1	2,461

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	千円	
三井製糖	8	1	3,721	
塩水港精糖	4	4	1,228	
日新製糖	0.300	0.800	1,468	
森永製菓	18	3	18,369	
中村屋	5	0.500	2,565	
江崎グリコ	4	5	26,500	
名糖産業	0.900	—	—	
不二家	11	11	2,453	
山崎製パン	14	14	32,470	
モロゾフ	3	3	1,524	
亀田製菓	1	1	5,461	
寿スピリッツ	0.500	1	3,631	
カルビー	7	8	30,375	
森永乳業	18	18	13,320	
六甲バター	0.900	0.900	2,205	
ヤクルト本社	10	10	67,089	
明治ホールディングス	11	11	102,306	
雪印メグミルク	4	4	12,672	
プリマハム	12	13	5,837	
日本ハム	14	14	42,910	
伊藤ハム	9	—	—	
林兼産業	11	1	1,227	
丸大食品	10	10	4,970	
米久	0.600	—	—	
S Foods	1	1	3,564	
伊藤ハム米久ホールディングス	—	11	12,581	
サッポロホールディングス	30	6	18,531	
アサヒグループホールディングス	36	37	153,303	
キリンホールディングス	79	85	163,558	
宝ホールディングス	14	14	15,969	
オエノンホールディングス	5	5	1,325	
養命酒製造	0.600	0.600	1,122	
コカ・コーラウエスト	6	6	21,205	
コカ・コーライーストジャパン	6	7	18,148	
サントリー食品インターナショナル	13	13	63,240	
ダイドーグループホールディングス	1	0.900	5,076	
伊藤園	5	5	21,859	
キーコーヒー	1	1	3,954	
ユニカフェ	0.600	1	1,268	
日清オイリオグループ	10	11	6,380	
不二製油グループ本社	5	5	12,820	
J-オイルミルズ	8	0.900	3,690	
キッコーマン	15	14	47,530	
味の素	42	41	95,099	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
キュービー	10	10	29,714	
ハウス食品グループ本社	6	7	17,700	
カゴメ	7	7	20,433	
焼津水産化学工業	1	—	—	
アリアケジャパン	1	1	9,984	
ピエトロ	—	0.700	1,158	
エバラ食品工業	0.500	0.600	1,259	
ニチレイ	21	9	25,137	
東洋水産	9	9	39,004	
日清食品ホールディングス	8	7	47,892	
永谷園ホールディングス	2	2	2,850	
一正蒲鉾	1	1	1,300	
フジッコ	1	1	4,655	
ロック・フィールド	1	2	3,549	
日本たばこ産業	115	110	416,272	
ケンコーマヨネーズ	0.600	0.700	1,897	
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,063	
なとり	1	1	1,865	
ユーグレナ	6	6	7,936	
ミヨシ油脂	8	8	1,136	
理研ビタミン	0.600	0.600	2,604	
繊維製品(0.7%)				
片倉工業	2	2	3,475	
ゲンゼ	15	14	5,908	
東洋紡	72	74	14,578	
ユニチカ	53	51	4,590	
富士紡ホールディングス	9	0.900	3,028	
倉敷紡績	19	19	4,503	
シキボウ	11	10	1,530	
日本毛織	6	5	4,706	
ダイドーリミテッド	2	—	—	
帝国繊維	1	1	3,228	
帝人	75	15	32,816	
東レ	133	135	131,287	
住江織物	5	5	1,455	
日本フェルト	2	2	1,257	
イチカワ	—	4	1,204	
アツギ	14	15	1,905	
セーレン	4	4	7,263	
ソトー	—	1	1,282	
東海染工	3	9	1,323	
小松精練	2	2	1,911	
ワコールホールディングス	11	11	15,620	
ホギメディカル	1	1	8,124	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
レナウン	9	10	1,219
T S Iホールディングス	8	7	6,360
三陽商会	10	10	1,720
オンワードホールディングス	12	12	10,296
ゴールドウイン	0.800	0.800	4,600
デサント	4	4	5,237
キング	2	2	1,037
ヤマトインターナショナル	2	3	1,239
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	11	1	4,625
王子ホールディングス	75	73	37,960
日本製紙	9	8	16,442
三菱製紙	28	2	1,976
北越紀州製紙	11	10	7,810
中越パルプ工業	8	7	1,694
大王製紙	8	7	9,583
阿波製紙	-	1	848
レンゴー	16	17	11,652
トーモク	6	6	2,010
ザ・パックス	1	1	3,997
化学(6.7%)			
クラレ	28	31	53,742
旭化成	114	116	127,020
共和レザー	1	1	1,296
昭和電工	122	12	24,576
住友化学	135	137	87,406
日本化成	9	-	-
住友精化	4	0.800	3,780
日産化学工業	11	10	39,933
ラサ工業	10	9	1,323
クレハ	14	1	6,804
テイカ	3	3	2,175
石原産業	33	3	3,696
日本曹達	12	11	7,370
東ソー	49	54	54,216
トクヤマ	30	29	16,617
セントラル硝子	20	19	10,393
東亜合成	11	11	14,755
大阪ソーダ	8	8	3,960
関東電化工業	4	4	4,636
デンカ	38	39	23,790
信越化学工業	32	33	329,491
日本カーバイド工業	8	8	1,296
堺化学工業	7	7	2,877

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エア・ウォーター	15	15	33,078
大陽日酸	14	14	20,391
日本化学工業	7	7	1,687
日本パーカラライジング	9	9	13,376
高圧ガス工業	3	2	2,142
四国化成工業	3	3	3,555
戸田工業	4	4	1,140
ステラ ケミファ	0.900	0.900	3,087
保土谷化学工業	6	0.600	2,190
日本触媒	2	2	21,663
大日精化工業	7	8	5,792
カネカ	25	25	22,500
三菱瓦斯化学	31	17	40,222
三井化学	78	85	47,005
J S R	17	18	37,755
東京応化工業	3	3	13,247
大阪有機化学工業	-	1	1,263
三菱ケミカルホールディングス	122	125	107,670
K Hネオケム	-	2	3,082
日本合成化学工業	4	-	-
ダイセル	25	25	35,165
住友ベークライト	17	16	10,640
積水化学工業	41	42	79,125
日本ゼオン	16	16	20,768
アイカ工業	5	6	17,388
宇部興産	98	94	26,790
積水樹脂	2	2	5,457
タキロン	4	4	2,176
旭有機材	6	6	1,452
日立化成	9	10	33,217
ニチバン	2	2	1,860
リケンテクノス	3	4	2,188
大倉工業	4	4	2,256
積水化成品工業	5	2	2,158
群栄化学工業	5	0.400	1,514
タイガースポリマー	-	1	1,203
ミライアル	1	1	1,128
ダイキアグシス	-	1	1,476
ダイキョーニシカワ	2	3	4,798
日本化薬	12	12	18,972
カーリットホールディングス	2	2	1,306
日本精化	1	1	1,420
扶桑化学工業	1	1	4,082
A D E K A	9	8	12,496

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日油	14	15	18,960
新日本理化	6	7	1,147
ハリマ化成グループ	1	1	1,259
花王	49	47	270,887
第一工業製薬	4	4	1,816
三洋化成工業	6	1	5,652
大日本塗料	10	11	2,563
日本ペイントホールディングス	14	14	51,768
関西ペイント	20	19	42,900
中国塗料	5	5	4,526
日本特殊塗料	1	1	2,278
藤倉化成	2	2	1,705
太陽ホールディングス	1	1	7,162
D I C	73	7	28,835
サカタインクス	3	3	6,133
東洋インキSCホールディングス	18	18	9,990
T & K T O K A	1	1	1,406
富士フィルムホールディングス	41	36	160,884
資生堂	34	35	101,416
ライオン	21	23	43,102
高砂香料工業	1	1	4,326
マンダム	1	1	9,880
ミルボン	1	1	5,290
ファンケル	4	4	6,456
コーセー	3	3	27,570
シーズ・ホールディングス	2	2	7,476
シーボン	0.400	0.200	511
ポーラ・オルビスホールディングス	1	1	20,748
ノエビアホールディングス	1	1	5,136
アジュバンコスメジャパン	1	1	1,266
エステー	1	1	2,251
アグロ カネシヨウ	0.900	1	1,310
コニシ	1	2	3,944
長谷川香料	2	2	4,696
星光PMC	1	1	1,132
小林製薬	2	5	27,092
荒川化学工業	1	1	3,267
メック	1	1	1,733
日本高純度化学	0.500	0.500	1,240
タカラバイオ	-	4	6,176
J C U	0.500	0.600	4,500
デクセリアルズ	4	4	6,311
アース製薬	1	1	6,643
イハラケミカル工業	2	2	2,743

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北興化学工業	3	-	-
大成ラミック	0.500	0.500	1,572
クミアイ化学工業	3	3	2,557
日本農薬	4	4	2,940
アキレス	15	1	2,739
有沢製作所	2	3	2,445
日東電工	14	13	127,675
レック	0.800	0.600	2,721
きもと	5	5	1,245
藤森工業	1	1	4,228
前澤化成工業	1	1	1,450
J S P	1	0.900	2,325
エフピコ	1	1	8,240
天馬	1	1	2,574
信越ポリマー	3	3	3,006
東リ	5	4	1,817
ニフコ	3	3	18,843
日本バルカー工業	7	1	2,580
ユニ・チャーム	37	37	92,157
医薬品(4.7%)			
協和発酵キリン	21	22	36,549
武田薬品工業	72	69	365,367
アステラス製薬	204	190	287,470
大日本住友製薬	12	13	25,964
塩野義製薬	26	25	138,348
田辺三菱製薬	21	21	49,801
わかもと製薬	4	-	-
あすか製薬	2	2	3,440
日本新薬	4	4	26,273
ビオフェルミン製薬	0.300	0.400	1,234
中外製薬	18	18	71,040
科研製薬	3	3	20,615
エーザイ	22	22	140,010
ロート製薬	9	9	19,965
小野薬品工業	8	42	106,470
久光製薬	5	5	31,876
持田製薬	1	1	10,959
参天製薬	33	34	55,668
扶桑薬品工業	6	0.600	1,721
日本ケミファ	3	0.300	1,662
ツムラ	5	6	21,018
日医工	4	4	7,413
キッセイ薬品工業	3	3	9,451
生化学工業	3	3	5,871

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栄研化学	1	1	4,864
日水製薬	-	0.300	410
鳥居薬品	1	1	3,781
JCRファーマ	1	1	3,998
東和薬品	0.800	0.900	4,734
富士製薬工業	0.500	0.600	1,851
沢井製薬	3	3	19,616
ゼリア新薬工業	3	3	6,482
第一三共	61	54	140,223
キョーリン製薬ホールディングス	4	4	10,615
大幸薬品	0.900	0.900	1,617
ダイト	0.800	1	2,275
大塚ホールディングス	39	40	206,200
大正製薬ホールディングス	4	4	36,920
ペプチドリーム	2	3	17,056
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	14	15	1,560
昭和シェル石油	18	16	18,102
ニチレキ	2	2	2,104
東燃ゼネラル石油	28	30	39,510
ユシロ化学工業	1	1	1,452
ピーピー・カストロール	0.800	0.900	1,485
富士石油	4	4	1,694
MORESCO	0.300	0.700	1,226
出光興産	9	8	31,284
JXホールディングス	216	206	108,825
コスモエネルギーホールディングス	5	5	10,824
ゴム製品(1.0%)			
横浜ゴム	11	11	24,595
東洋ゴム工業	8	9	16,728
ブリヂストン	61	62	285,677
住友ゴム工業	17	17	31,511
藤倉ゴム工業	2	-	-
オカモト	6	6	6,174
フコク	0.300	0.800	751
ニッタ	2	1	5,083
住友理工	3	3	3,940
三ツ星ベルト	4	5	5,025
バンドー化学	7	3	3,610
ガラス・土石製品(1.0%)			
日東紡績	12	15	7,590
旭硝子	97	92	84,456
日本板硝子	89	8	7,267
日本山村硝子	7	8	1,632

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電気硝子	38	38	26,790
住友大阪セメント	36	35	16,135
太平洋セメント	114	112	45,808
日本ヒューム	1	1	1,278
日本コンクリート工業	4	4	1,440
三谷セキサン	0.900	0.900	2,297
アジアパイルホールディングス	2	2	1,331
東海カーボン	16	17	8,143
日本カーボン	9	9	2,691
東洋炭素	1	1	1,953
ノリタケカンパニーリミテド	10	1	2,925
TOTO	13	13	57,814
日本碍子	23	23	57,692
日本特殊陶業	15	16	41,344
MARUWA	0.700	0.700	2,600
品川リフラクトリーズ	5	5	1,510
黒崎播磨	4	4	1,856
東京窯業	6	6	1,337
ニッカトー	2	3	1,275
フジミインコーポレーテッド	1	1	4,142
エーアンドエーマテリアル	14	-	-
ニチアス	9	10	10,990
ニチハ	2	2	7,887
鉄鋼(1.4%)			
新日鐵住金	82	83	236,430
神戸製鋼所	336	32	36,675
中山製鋼所	21	2	1,640
合同製鐵	10	1	1,885
ジェイエフイーホールディングス	50	50	108,813
日新製鋼	8	8	13,370
東京製鐵	10	9	9,804
共英製鋼	1	2	4,292
大和工業	4	3	12,284
東京鐵鋼	4	4	1,896
大阪製鐵	1	1	2,632
淀川製鋼所	2	2	8,736
東洋鋼板	4	4	2,037
丸一鋼管	6	6	22,289
モリ工業	-	0.600	1,391
大同特殊鋼	31	31	17,670
日本冶金工業	13	15	3,572
山陽特殊製鋼	11	11	6,754
愛知製鋼	11	1	5,357
日立金属	20	18	31,695

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
日本金属	10	1	1	1,306
大平洋金属	13	12	12	5,004
新日本電工	10	10	10	3,538
栗本鐵工所	9	0.900	0.900	2,145
日本鑄鉄管	7	-	-	-
三菱製鋼	13	13	13	3,393
日亜鋼業	3	4	4	1,311
日本精線	2	2	2	1,222
シンニッタン	0.600	0.200	0.200	142
新家工業	7	8	8	1,432
非鉄金属(1.0%)				
大紀アルミニウム工業所	4	3	3	1,593
日本軽金属ホールディングス	41	42	42	12,040
三井金属鉱業	47	51	51	19,431
東邦亜鉛	10	10	10	6,350
三菱マテリアル	114	11	11	44,544
住友金属鉱山	50	48	48	77,688
DOWAホールディングス	24	21	21	19,824
古河機械金属	29	29	29	6,902
大阪チタニウムテクノロジーズ	1	2	2	4,128
東邦チタニウム	3	3	3	3,081
UACJ	26	24	24	7,704
古河電気工業	57	6	6	25,451
住友電気工業	73	70	70	131,788
フジクラ	25	24	24	20,898
昭和電線ホールディングス	22	22	22	2,002
東京特殊電線	1	-	-	-
タツタ電線	3	3	3	1,613
カナレ電気	0.600	0.600	0.600	1,354
平河ヒューテック	-	1	1	1,119
リョービ	11	11	11	5,621
アーレスティ	2	2	2	2,596
アサヒホールディングス	2	2	2	5,544
金属製品(0.7%)				
稲葉製作所	1	1	1	1,331
トーカロ	1	1	1	3,266
SUMCO	14	19	19	34,473
川田テクノロジーズ	0.300	0.400	0.400	3,132
東洋製罐グループホールディングス	13	13	13	27,324
ホッカンホールディングス	5	5	5	2,725
コロナ	1	1	1	1,280
横河ブリッジホールディングス	3	3	3	4,633
駒井ハルテック	4	-	-	-
高田機工	5	5	5	1,215

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
三和ホールディングス	18	18	18	20,072
文化シャッター	5	5	5	4,477
三協立山	2	2	2	4,240
アルインコ	1	1	1	1,365
LIXILグループ	25	25	25	71,743
日本フィルコン	2	2	2	1,229
ノーリツ	3	3	3	7,837
長府製作所	2	2	2	5,448
リンナイ	3	3	3	27,936
ダイニチ工業	0.900	1	1	1,244
日東精工	3	2	2	1,241
岡部	3	3	3	3,884
ジーテクト	1	1	1	4,086
東プレ	3	3	3	10,519
高周波熱錬	3	3	3	3,213
東京製鋼	12	1	1	2,364
サンコール	2	2	2	1,218
モリテックスチール	4	4	4	1,260
パイオラックス	0.900	0.900	0.900	7,011
日本発条	17	17	17	22,575
中央発條	4	-	-	-
アドバネクス	-	0.700	0.700	1,329
三益半導体工業	1	1	1	2,464
機械(5.1%)				
日本ドライケミカル	0.500	0.500	0.500	1,155
日本製鋼所	30	6	6	12,358
三浦工業	8	7	7	13,125
タクマ	7	6	6	6,132
ツガミ	5	5	5	3,460
オークマ	12	12	12	14,580
東芝機械	10	11	11	5,401
アマダホールディングス	26	25	25	31,600
アイダエンジニアリング	4	5	5	5,368
滝澤鉄工所	8	8	8	1,496
富士機械製造	6	5	5	8,738
牧野フライス製作所	9	9	9	9,594
オーエスジー	8	8	8	20,374
ダイジェット工業	8	7	7	1,281
旭ダイヤモンド工業	5	5	5	4,918
DMG森精機	10	11	11	18,887
ソディック	3	4	4	5,099
ディスコ	2	2	2	37,576
日東工器	1	1	1	2,803
豊和工業	1	2	2	1,334

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
〇KK	9	10	10	1,260
石川製作所	14	1	1	1,375
東洋機械金属	—	2	2	1,489
津田駒工業	10	8	8	1,424
島精機製作所	2	2	2	9,204
NCホールディングス	—	1	1	1,218
フリー	—	0.400	0.400	1,864
日阪製作所	2	2	2	2,302
やまびこ	3	3	3	4,930
ベガサスミシン製造	2	1	1	1,522
ナブテスコ	9	9	9	31,185
三井海洋開発	2	1	1	4,636
レオン自動車	1	1	1	1,737
SMC	5	5	5	177,520
新川	2	1	1	1,231
ホソカワミクロン	3	3	3	2,466
ユニオンツール	0.800	0.800	0.800	2,876
オイレス工業	2	2	2	4,941
日精エー・エス・ピー機械	0.700	0.600	0.600	1,442
サトーホールディングス	2	2	2	5,747
日本エアテック	1	1	1	1,242
日精樹脂工業	1	1	1	1,687
小松製作所	89	85	85	240,325
住友重機械工業	53	54	54	44,442
日立建機	8	8	8	22,102
日工	3	—	—	—
巴工業	0.700	0.800	0.800	1,501
井関農機	19	19	19	4,902
TOWA	1	1	1	3,120
丸山製作所	6	7	7	1,365
北川鉄工所	8	0.900	0.900	2,214
ローツェ	—	0.700	0.700	1,774
クボタ	87	89	89	165,205
荏原実業	0.800	0.900	0.900	1,233
三菱化工機	6	6	6	1,344
月島機械	3	3	3	4,536
帝国電機製作所	1	1	1	1,465
新東工業	4	4	4	4,355
澁谷工業	1	1	1	4,660
アイチコーポレーション	2	2	2	2,303
小森コーポレーション	4	4	4	6,849
鶴見製作所	1	1	1	2,156
住友精密工業	3	3	3	1,104
荏原製作所	40	8	8	27,593

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
石井鐵工所	7	0.200	0.200	357
西島製作所	1	1	1	2,061
北越工業	2	2	2	1,950
ダイキン工業	25	24	24	259,424
オルガノ	3	4	4	1,992
トーヨーカネツ	10	9	9	2,862
栗田工業	11	10	10	28,717
椿本チエイン	10	11	11	10,857
アネスト岩田	2	3	3	3,500
ダイフク	9	8	8	24,083
加藤製作所	4	1	1	3,065
タダノ	8	9	9	13,578
フジテック	5	5	5	6,812
CKD	4	5	5	7,928
キトー	2	2	2	2,752
平和	5	5	5	16,153
理想科学工業	1	1	1	3,819
SANKYO	4	4	4	19,428
日本金銭機械	1	1	1	2,406
マースエンジニアリング	1	1	1	2,297
福島工業	1	1	1	4,086
オーイズミ	2	—	—	—
ダイコク電機	0.800	0.700	0.700	1,306
竹内製作所	2	3	3	7,443
アマノ	5	5	5	12,529
JUKI	2	2	2	3,592
サンデンホールディングス	11	11	11	4,257
蛇の目ミシン工業	1	1	1	1,353
マックス	3	3	3	4,581
グローリー	6	5	5	21,717
新晃工業	1	1	1	1,753
大和冷機工業	2	2	2	2,975
セガサミーホールディングス	18	17	17	29,532
日本ピストンリング	0.700	0.700	0.700	1,652
リケン	8	0.800	0.800	3,428
T P R	2	2	2	7,320
ツバキ・ナカシマ	1	2	2	3,888
ホシザキ	3	3	3	33,969
大豊工業	1	1	1	2,156
日本精工	35	36	36	58,984
NTN	43	41	41	22,386
ジェイテクト	18	18	18	35,645
不二越	16	18	18	11,052
日本トムソン	6	5	5	3,192

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
THK	11	12	37,275
ユーシン精機	0.700	0.800	2,339
前澤給装工業	0.700	0.800	1,223
イーグル工業	2	1	3,057
日本ピラー工業	1	1	2,824
キッツ	8	8	6,324
日立工機	4	4	4,161
マキタ	11	11	89,784
日立造船	13	14	9,094
三菱重工業	311	298	132,639
I H I	134	136	46,104
スター精密	3	3	5,180
電気機器(12.6%)			
日清紡ホールディングス	9	9	11,444
イビデン	10	12	23,795
コニカミノルタ	43	41	45,968
ブラザー工業	22	23	47,242
ミネベアミツミ	28	32	45,434
日立製作所	445	426	266,974
東芝	368	397	73,961
三菱電機	186	189	318,549
富士電機	53	54	33,966
東洋電機製造	3	0.800	1,387
安川電機	21	20	44,187
シンフォニア テクノロジー	11	11	3,366
明電舎	16	16	6,096
オリジン電気	4	4	1,268
山洋電気	5	5	4,420
デンヨー	1	1	2,856
東芝テック	12	11	6,611
芝浦メカトロニクス	5	5	1,410
マブチモーター	5	5	31,150
日本電産	21	23	245,870
東光高岳	1	0.900	1,977
ダブル・スコープ	0.500	1	3,131
ダイヘン	10	10	7,210
田淵電機	2	3	1,107
ヤーマン	-	0.200	1,232
JVCケンウッド	12	13	3,952
ミマキエンジニアリング	1	-	-
第一精工	0.700	-	-
日新電機	4	3	4,942
大崎電気工業	3	4	4,364
オムロン	20	18	91,759

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
日東工業	2	2	4,121
I D E C	2	2	2,730
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34	34	17,034
サクサホールディングス	5	5	1,155
メルコホールディングス	1	1	3,355
テクノメディカ	0.400	-	-
日本電気	240	244	67,344
富士通	168	171	112,825
沖電気工業	76	7	12,258
岩崎通信機	14	14	1,274
電気興業	5	5	2,810
サンケン電気	10	10	5,140
ナカヨ	-	3	1,260
アイホン	1	1	1,858
ルネサスエレクトロニクス	9	9	9,374
セイコーエプソン	26	26	67,584
ワコム	13	13	5,644
アルバック	3	3	16,863
アクセル	1	-	-
E I Z O	1	1	5,877
ジャパンディスプレイ	32	33	9,362
日本信号	4	4	5,208
京三製作所	4	4	1,636
能美防災	2	2	2,984
ホーチキ	1	1	1,840
エレコム	1	1	3,039
日本無線	4	1	1,555
パナソニック	199	202	253,016
シャープ	148	-	-
アンリツ	10	12	11,223
富士通ゼネラル	5	6	12,960
日立国際電気	4	4	10,971
ソニー	123	125	439,903
T D K	10	10	78,400
帝国通信工業	-	7	1,316
ミツミ電機	6	-	-
タムラ製作所	7	7	3,185
アルプス電気	14	16	56,826
池上通信機	-	3	462
パイオニア	28	26	6,114
日本電波工業	1	1	1,438
鈴木	-	2	1,380
日本トリム	0.500	0.400	1,616
ローランド ディー. ジー.	0.900	0.900	3,195

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
フォスター電機	2	2	4,029
クラリオン	9	9	3,924
SMK	5	5	2,110
ヨコオ	—	1	1,716
東光	4	—	—
ティアック	23	26	1,170
ホシデン	5	5	5,427
ヒロセ電機	2	2	42,920
日本航空電子工業	5	6	9,234
TOA	2	2	2,118
日立マクセル	2	2	5,842
古野電気	2	2	1,771
ユニデンホールディングス	9	7	1,176
アルパイン	4	4	7,051
スミダコーポレーション	1	1	1,948
アイコム	1	1	2,379
リオン	0.700	0.800	1,259
船井電機	1	2	1,900
横河電機	17	19	33,331
新電元工業	6	7	3,360
アズビル	5	5	19,197
日本光電工業	7	7	18,374
チノー	—	1	1,340
共和電業	—	3	1,391
日本電子材料	2	2	1,268
堀場製作所	3	3	21,840
アドバンテスト	11	12	23,921
小野測器	—	1	1,227
エスベック	1	1	2,056
パナソニック デバイスSUNX	1	1	1,348
キーエンス	4	8	354,000
日置電機	0.900	0.900	2,005
シスメックス	13	13	88,182
日本マイクロニクス	2	3	2,973
メガチップス	1	1	4,664
OBARA GROUP	1	1	4,995
澤藤電機	5	6	1,500
コーセル	2	2	3,490
イリソ電子工業	—	0.600	4,284
オプテックスグループ	1	1	4,088
千代田インテグレ	0.900	0.900	2,166
レーザーテック	2	2	6,066
スタンレー電気	12	12	40,132
岩崎電気	6	6	1,044

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ウシオ電機	10	10	15,724
岡谷電機産業	2	3	1,260
ヘリオス テクノ ホールディング	2	2	1,403
日本セラミック	1	1	3,643
遠藤照明	—	1	1,309
日本デジタル研究所	1	—	—
古河電池	—	2	1,518
双信電機	3	4	1,285
山一電機	1	1	2,623
図研	1	1	1,551
日本電子	7	6	3,222
カシオ計算機	17	14	22,207
ファナック	17	18	402,210
日本シイエムケイ	3	3	2,492
エンプラス	0.900	0.800	2,820
ローム	8	8	63,984
浜松ホトニクス	13	13	46,982
三井ハイテック	2	2	2,047
新光電気工業	6	6	5,252
京セラ	28	29	181,857
太陽誘電	8	8	13,158
村田製作所	18	18	304,854
ユーシン	2	2	1,927
双葉電子工業	3	2	5,852
北陸電気工業	8	—	—
ニチコン	5	5	5,952
日本ケミコン	14	15	4,785
KOA	2	2	3,327
市光工業	5	4	2,076
小糸製作所	10	10	61,692
ミツバ	3	3	7,421
SCREENホールディングス	18	3	27,504
キャノン電子	1	1	2,857
キャノン	94	95	314,428
リコー	56	53	53,506
MUTOHホールディングス	—	5	1,340
東京エレクトロン	15	11	131,924
輸送用機器(9.3%)			
トヨタ紡織	6	6	15,202
芦森工業	7	—	—
鬼怒川ゴム工業	4	—	—
ユニプレス	3	3	7,942
豊田自動織機	15	16	89,910
モリタホールディングス	3	3	4,774

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)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三櫻工業	2	2	1,987
デンソー	43	43	222,723
東海理化電機製作所	5	4	10,490
三井造船	68	64	11,392
川崎重工業	136	138	48,990
名村造船所	5	5	4,202
サノヤホールディングス	4	4	1,341
日本車輛製造	7	6	1,824
ニチユ三菱フォークリフト	2	2	1,434
近畿車輛	3	-	-
日産自動車	245	212	237,367
いすゞ自動車	50	51	79,335
トヨタ自動車	217	215	1,388,668
日野自動車	24	25	33,421
三菱自動車工業	69	65	44,333
エフテック	-	0.900	1,205
レシップホールディングス	1	0.300	256
GMB	1	1	1,560
ファルテック	0.700	0.900	1,268
武蔵精密工業	1	2	5,913
日産車体	8	7	8,494
新明和工業	8	7	8,246
極東開発工業	3	3	6,247
日信工業	3	4	7,940
トピー工業	14	1	4,882
ティラド	7	7	2,177
曙ブレーキ工業	8	8	2,328
タチエス	2	3	6,303
NOK	8	8	21,973
フタバ産業	5	5	4,282
K Y B	20	20	12,560
シロキ工業	4	-	-
大同メタル工業	2	2	2,268
プレス工業	9	9	5,282
ミクニ	-	3	1,299
カルソニックカンセイ	13	12	15,420
太平洋工業	3	3	5,212
ケーヒン	4	4	8,081
河西工業	2	2	3,326
アイシン精機	17	16	92,258
マツダ	55	56	89,273
ダイハツ工業	20	-	-
今仙電機製作所	1	1	1,612
本田技研工業	157	159	571,125

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スズキ	36	35	155,020
富士重工業	55	55	235,938
安永	-	0.700	1,160
ヤマハ発動機	24	25	64,933
ショーワ	4	4	4,448
T B K	2	2	1,269
エクセディ	2	2	7,656
豊田合成	6	5	16,199
愛三工業	3	3	3,028
ヨロズ	1	1	2,985
エフ・シー・シー	2	2	6,536
シマノ	7	7	119,304
タカタ	3	3	1,753
テイ・エス テック	4	4	11,963
ジャムコ	0.800	1	2,624
精密機器(1.5%)			
テルモ	26	27	105,944
クリエートメディック	1	-	-
日機装	6	6	7,417
島津製作所	22	22	43,029
J M S	-	4	1,300
モリテックス	3	-	-
長野計器	1	1	1,198
ブイ・テクノロジ	0.400	0.400	6,936
東京計器	6	6	1,440
オーバル	4	3	1,033
東京精密	3	3	13,039
マニー	1	2	6,525
ニコン	32	31	52,917
トプコン	5	8	18,004
オリンパス	26	28	111,502
理研計器	1	1	2,617
タムロン	1	1	3,384
HOYA	40	36	184,690
ノーリツ鋼機	1	1	1,747
エー・アンド・デイ	2	2	1,216
シチズン時計	21	19	14,317
リズム時計工業	8	7	1,309
大研医器	1	1	1,280
メニコン	0.900	1	4,224
松風	0.900	0.900	1,232
セイコーホールディングス	11	13	6,032
ニプロ	13	12	16,961

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
その他製品(1.7%)			
スノーピーク	0.300	0.400	1,136
パラマウントベッドホールディングス	1	1	7,063
SHO-BI	2	2	1,273
ニホンフラッシュ	1	0.900	1,154
前田工織	1	1	2,386
アートネイチャー	1	1	1,421
ダンロップスポーツ	1	1	1,142
パンダイナムコホールディングス	18	19	60,956
共立印刷	3	3	1,280
SHOEI	0.800	0.800	2,044
フランスベッドホールディングス	2	2	2,068
パイロットコーポレーション	3	3	14,229
萩原工業	0.500	0.500	1,308
トッパン・フォームズ	3	3	3,424
フジシールインターナショナル	2	4	9,084
タカラトミー	5	6	8,266
廣済堂	3	3	1,173
As-meエステール	-	1	1,176
アーク	-	9	1,058
タカノ	-	1	1,398
プロネクサス	1	1	2,099
ホクシン	9	5	1,298
ウッドワン	4	-	-
大建工業	7	1	2,611
凸版印刷	49	50	56,450
大日本印刷	52	51	60,486
図書印刷	3	3	1,446
共同印刷	6	5	1,920
日本写真印刷	2	3	9,975
光村印刷	5	5	1,335
宝印刷	0.800	0.900	1,421
アシックス	16	17	34,425
ツツミ	0.900	0.700	1,481
小松ウオール工業	0.600	0.600	1,165
ヤマハ	12	12	35,184
河合楽器製作所	0.600	0.700	1,610
クリナップ	2	2	1,751
ピジョン	9	10	33,437
キングジム	1	1	1,285
リンテック	4	4	10,395
イトーキ	3	3	2,693
任天堂	10	10	251,735
三菱鉛筆	1	1	8,460

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
タカラスタンダード	7	3	7,081
コクヨ	9	9	14,324
グロープライド	0.800	0.900	1,620
岡村製作所	6	6	6,330
美津濃	9	10	6,050
アデランス	3	-	-
電気・ガス業(1.8%)			
東京電力ホールディングス	148	150	65,253
中部電力	53	58	86,784
関西電力	71	72	90,117
中国電力	24	24	30,085
北陸電力	17	17	19,435
東北電力	43	44	63,936
四国電力	15	16	17,488
九州電力	38	39	48,725
北海道電力	16	16	13,396
沖縄電力	1	2	6,796
電源開発	14	14	37,929
エフオン	-	1	1,201
イーレックス	0.300	0.700	2,569
東京瓦斯	195	190	98,078
大阪瓦斯	181	172	74,218
東邦瓦斯	44	45	35,730
北海道瓦斯	4	4	1,112
広島ガス	3	3	1,339
西部瓦斯	20	20	5,240
静岡ガス	5	5	3,965
メタウォーター	1	1	2,945
陸運業(4.1%)			
SBSホールディングス	1	1	1,499
東武鉄道	93	95	54,435
相鉄ホールディングス	30	28	15,904
東京急行電鉄	102	96	79,296
京浜急行電鉄	48	49	59,829
小田急電鉄	56	28	63,612
京王電鉄	49	50	44,150
京成電鉄	26	13	35,298
富士急行	5	5	5,055
新京成電鉄	2	1	420
東日本旅客鉄道	31	34	353,460
西日本旅客鉄道	16	17	125,685
東海旅客鉄道	15	14	275,576
西武ホールディングス	13	24	48,142
鴻池運輸	2	2	3,562

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
西日本鉄道	23	21	10,269
ハマキョウレックス	1	1	2,499
サカイ引越センター	0.700	0.600	1,860
近鉄グループホールディングス	176	179	75,180
阪急阪神ホールディングス	117	22	84,224
南海電気鉄道	39	38	20,976
京阪ホールディングス	39	40	28,680
神戸電鉄	4	4	1,524
名古屋鉄道	64	65	33,930
山陽電気鉄道	6	6	3,642
日本通運	68	69	39,261
ヤマトホールディングス	32	31	71,502
山九	23	23	16,468
丸全昭和運輸	6	6	2,694
センコー	8	8	5,760
トナミホールディングス	4	4	1,408
ニッコンホールディングス	5	6	14,460
日本石油輸送	4	-	-
福山通運	11	11	7,139
セイノーホールディングス	12	12	15,600
神奈川中央交通	2	2	1,444
日立物流	3	3	8,680
丸和運輸機関	-	0.400	1,028
C&Fロジホールディングス	1	1	2,838
九州旅客鉄道	-	13	44,682
海運業(0.2%)			
日本郵船	157	151	37,297
商船三井	86	94	34,216
川崎汽船	77	68	20,128
N Sユナイテッド海運	8	8	1,840
飯野海運	9	9	4,692
乾汽船	1	1	1,290
空運業(0.6%)			
日本航空	33	32	117,120
ANAホールディングス	324	330	108,042
パスコ	2	1	412
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.500	0.500	2,750
日新	7	7	2,548
三菱倉庫	12	12	18,984
三井倉庫ホールディングス	10	10	3,350
住友倉庫	13	13	8,242
澁澤倉庫	5	5	1,755
日本トランスシティ	4	4	1,844

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ケイヒン	7	8	1,256
中央倉庫	1	1	1,205
安田倉庫	1	1	1,251
東洋埠頭	7	2	378
宇徳	3	2	1,187
上組	21	21	22,155
キューソー流通システム	0.500	0.600	1,586
郵船ロジスティクス	1	1	1,883
近鉄エクスプレス	3	3	5,446
エアイテイ	1	1	1,314
内外トランスライン	0.700	1	1,314
情報・通信業(7.8%)			
NECネットエスアイ	2	1	4,035
システナ	1	1	2,282
デジタルアーツ	0.800	0.800	2,648
新日鉄住金ソリューションズ	2	2	6,626
コア	0.800	1	1,385
T I S	5	5	15,636
電算システム	0.700	-	-
グリー	10	10	7,211
コエーテックホールディングス	4	4	9,156
三菱総合研究所	0.700	0.700	2,229
ボルテージ	-	1	1,206
電算	0.400	0.500	1,216
A G S	1	0.900	1,724
ファインデックス	1	1	1,251
ヒト・コミュニケーションズ	0.600	0.800	1,340
K L a b	2	3	2,666
ポルトウイン・ビジュアルホールディングス	1	1	1,426
ネクソン	16	19	36,960
アイスタイル	2	2	2,643
エムアップ	2	2	1,802
エイチーム	0.700	1	2,136
テクノスジャパン	-	1	1,736
コロプラ	4	4	5,022
ブロードリーフ	1	4	2,721
ハーツユナイテッドグループ	0.500	0.900	1,353
メディアドゥ	-	0.500	858
ブイキューブ	0.800	1	1,119
サイバーリンクス	-	1	1,254
オプティム	-	0.200	1,052
ティーガイア	1	1	3,172
豆蔵ホールディングス	-	1	1,150
テクマトリックス	0.700	0.600	1,543

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カホー・オンライン・エンターテイメント	30	36	9,420
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	9,072
ザッパラス	2	2	1,279
インターネットイニシアティブ	2	2	5,267
さくらインターネット	0.800	1	1,479
SRAホールディングス	1	0.900	2,515
朝日ネット	-	2	1,312
コムチュア	-	0.400	1,408
gumi	1	1	2,257
パイプドHD	0.900	1	1,219
LINE	-	2	10,266
AOI TYO HOLDINGS	-	1	1,178
フェイス	0.800	-	-
野村総合研究所	12	13	51,024
サイバネットシステム	1	1	1,563
CEホールディングス	-	1	1,248
インテージホールディングス	0.900	1	2,172
東邦システムサイエンス	1	1	1,164
フォーカスシステムズ	-	2	1,293
クレスコ	0.600	0.500	1,246
フジ・メディア・ホールディングス	17	18	28,127
オービック	5	6	32,100
ジャストシステム	3	2	3,402
TDCソフトウェアエンジニアリング	0.900	1	1,370
ヤフー	123	125	66,191
トレンドマイクロ	8	9	45,012
インフォメーション・ディベロップメント	1	-	-
日本オラクル	2	2	18,480
アルファシステムズ	0.600	0.600	1,185
フューチャー	2	2	2,157
CAC Holdings	1	1	1,519
ソフトバンク・テクノロジー	0.800	0.400	1,650
トーセ	1	1	1,243
オービックビジネスコンサルタント	0.900	0.900	5,004
伊藤忠テクノソリューションズ	3	4	12,600
アイティフォー	2	2	1,506
東計電算	0.500	-	-
大塚商会	4	4	27,683
サイボウズ	3	2	1,196
電通国際情報サービス	1	1	2,440
デジタルガレージ	-	2	5,567
イーエムシステムズ	0.400	0.700	1,138
ウェザーニューズ	0.600	0.600	2,139
C I J	2	2	1,223

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋ビジネスエンジニアリング	0.700	0.800	1,236
日本エンタープライズ	3	4	1,208
WOWOW	0.800	0.800	2,936
スカラ	-	1	1,285
イマジカ・ロボット ホールディングス	2	1	1,429
ネットワンシステムズ	7	7	6,710
アルゴグラフィックス	0.800	0.800	1,970
マーベラス	2	3	2,892
エイベックス・グループ・ホールディングス	3	3	5,152
日本ユニシス	4	4	7,296
兼松エレクトロニクス	1	1	2,834
東京放送ホールディングス	10	11	23,710
日本テレビホールディングス	15	16	32,320
朝日放送	1	1	1,326
テレビ朝日ホールディングス	4	4	11,102
スカパーJ SATホールディングス	13	11	5,700
テレビ東京ホールディングス	1	1	3,603
U-NEXT	-	1	1,864
ワイヤレスゲート	-	0.700	1,078
コネクシオ	1	1	2,353
日本通信	9	14	2,646
日本電信電話	133	140	671,279
KDDI	175	173	509,015
光通信	2	2	23,037
NTTドコモ	132	131	352,521
エムティーアイ	2	2	1,852
GMOインターネット	6	6	9,740
カドカワ	5	5	8,262
学研ホールディングス	6	6	1,848
ゼンリン	2	2	5,046
昭文社	1	1	1,278
インプレスホールディングス	7	8	1,205
アイネット	1	1	1,350
松竹	11	12	15,828
東宝	12	11	37,490
東映	6	7	7,028
AOI Pro.	1	-	-
エヌ・ティ・ティ・データ	10	10	57,888
DTTS	1	1	4,656
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7	6	22,813
シーイーシー	1	1	1,839
カプコン	4	4	9,803
ジャステック	1	1	1,138
SCSK	4	4	19,992

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	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円	千株	千株	千円
日本システムウエア	—	0.800	1,291	—	—	—
アイネス	2	2	2,516	—	—	—
T K C	1	1	5,472	—	—	—
富士ソフト	2	2	7,342	—	—	—
N S D	3	3	6,478	—	—	—
コナミホールディングス	7	7	36,379	—	—	—
福井コンピュータホールディングス	1	0.500	1,415	—	—	—
J B C Cホールディングス	1	1	1,289	—	—	—
ミロク情報サービス	1	1	2,325	—	—	—
ソフトバンクグループ	97	78	693,452	—	—	—
卸売業(4.6%)						
高千穂交易	1	1	1,264	—	—	—
伊藤忠食品	0.500	0.400	1,806	—	—	—
エレマテック	0.800	0.700	1,373	—	—	—
J A L U X	0.600	0.600	1,330	—	—	—
あらた	0.800	0.800	2,271	—	—	—
トーマンデバイス	0.600	0.600	1,296	—	—	—
東京エレクトロン デバイス	0.600	0.800	1,279	—	—	—
フィールズ	1	1	1,625	—	—	—
双日	108	103	30,222	—	—	—
アルフレッサ ホールディングス	21	20	41,379	—	—	—
横浜冷凍	4	4	4,536	—	—	—
山下医科器械	0.600	—	—	—	—	—
ラサ商事	1	2	1,392	—	—	—
アルコニックス	1	1	1,779	—	—	—
神戸物産	1	0.900	3,379	—	—	—
あい ホールディングス	3	3	6,971	—	—	—
ダイワボウホールディングス	16	15	4,425	—	—	—
マクニカ・富士エレホールディングス	3	3	5,392	—	—	—
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	3	3	3,346	—	—	—
八洲電機	—	1	1,223	—	—	—
U K Cホールディングス	1	1	2,461	—	—	—
O C H Iホールディングス	1	0.900	1,222	—	—	—
T O K A Iホールディングス	7	7	6,452	—	—	—
三洋貿易	0.900	1	1,817	—	—	—
ウイン・パートナーズ	—	1	1,284	—	—	—
シップヘルスケアホールディングス	3	3	10,125	—	—	—
コメダホールディングス	—	2	4,620	—	—	—
富士興産	—	2	1,287	—	—	—
協栄産業	8	8	1,376	—	—	—
小野建	1	1	2,131	—	—	—
佐鳥電機	1	1	1,276	—	—	—
エコートレーディング	1	1	1,267	—	—	—
伯東	1	1	1,292	—	—	—

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評価額	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円	千株	千株	千円
コンドーテック	1	1	1,223	—	—	—
ナガイレーベン	2	2	6,177	—	—	—
三菱食品	1	1	6,593	—	—	—
松田産業	1	1	2,074	—	—	—
第一興商	3	2	13,731	—	—	—
メディパルホールディングス	17	17	32,165	—	—	—
萩原電気	—	0.600	1,306	—	—	—
アズワン	1	1	7,014	—	—	—
尾家産業	1	1	1,280	—	—	—
シモジマ	1	1	1,318	—	—	—
ドウシシャ	2	2	4,473	—	—	—
小津産業	0.500	—	—	—	—	—
高速	1	1	1,226	—	—	—
黒田電気	3	2	5,484	—	—	—
丸文	1	1	1,323	—	—	—
ハピネット	1	1	2,187	—	—	—
橋本総業ホールディングス	0.600	0.800	1,201	—	—	—
日本ライフライン	—	1	3,060	—	—	—
エクセル	0.800	0.800	1,199	—	—	—
マルカキカイ	0.700	—	—	—	—	—
I D O M	4	4	3,525	—	—	—
日本エム・ディ・エム	—	1	1,071	—	—	—
進和	1	1	1,783	—	—	—
エスケイジャパン	2	4	1,228	—	—	—
シークス	1	1	5,512	—	—	—
田中商事	1	1	1,230	—	—	—
オーハシテクニカ	1	1	1,439	—	—	—
白銅	1	0.800	1,428	—	—	—
伊藤忠商事	135	128	209,163	—	—	—
丸紅	169	172	125,994	—	—	—
長瀬産業	10	10	17,314	—	—	—
蝶理	1	1	2,197	—	—	—
豊田通商	19	19	65,032	—	—	—
三共生興	2	2	1,200	—	—	—
兼松	37	37	7,215	—	—	—
ツカモトコーポレーション	9	—	—	—	—	—
三井物産	155	158	269,925	—	—	—
日本紙パルプ商事	9	9	3,348	—	—	—
日立ハイテクノロジーズ	6	6	29,371	—	—	—
カメイ	2	2	3,116	—	—	—
東都水産	6	0.300	589	—	—	—
スターゼン	0.600	0.700	3,419	—	—	—
山善	6	6	7,128	—	—	—
椿本興業	3	—	—	—	—	—

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
住友商事	108	110	164,992
内田洋行	4	0.900	2,300
三菱商事	129	131	343,149
第一実業	4	4	3,132
キャノンマーケティングジャパン	4	5	11,400
西華産業	6	6	2,184
佐藤商事	1	1	1,408
菱洋エレクトロ	2	1	2,696
東京産業	2	2	1,232
ユアサ商事	1	1	5,576
神鋼商事	5	0.500	1,233
小林産業	5	4	1,301
阪和興業	17	18	14,022
カナデン	1	1	1,781
菱電商事	3	3	2,205
フルサト工業	0.900	1	1,737
岩谷産業	20	19	12,635
すてきナイスグループ	7	8	1,216
昭光通商	13	12	1,212
イワキ	5	-	-
三菱石油	4	4	4,201
稲畑産業	4	4	6,346
明和産業	-	3	1,317
ワキタ	3	3	3,966
東邦ホールディングス	5	5	13,882
サンゲツ	6	6	11,574
ミツウロコグループホールディングス	2	2	2,083
シナネンホールディングス	4	0.800	1,838
伊藤忠エネクス	4	3	3,681
サンリオ	5	5	11,826
サンワ テクノス	1	1	1,405
リョーサン	2	2	9,555
新光商事	2	1	2,565
トーホー	0.800	0.800	2,028
三信電気	2	1	2,565
東陽テクニカ	2	2	2,343
モスフードサービス	2	2	7,659
加賀電子	1	1	3,267
ソーダニッカ	2	2	1,248
立花エレテック	1	1	1,586
PAL TAC	2	2	8,778
三谷産業	3	3	1,250
ヤマタネ	8	0.900	1,465
日鉄住金物産	11	1	7,335

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
トラスコ中山	2	4	10,272
オートバックスセブン	6	6	11,713
加藤産業	2	2	7,916
イノテック	2	2	1,461
イエローハット	1	1	4,741
J Kホールディングス	2	2	1,344
日伝	0.700	0.700	2,450
北沢産業	6	6	1,335
杉本商事	1	1	1,558
因幡電機産業	2	2	10,000
パイテックホールディングス	1	1	1,375
ミスミグループ本社	19	19	40,877
タキヒヨー	3	3	1,449
スズケン	7	8	30,680
ジェコス	1	1	1,356
ルネサスイーストン	2	2	1,353
小売業(4.6%)			
ローソン	6	6	48,861
サンエー	1	1	6,721
カワチ薬品	1	1	4,195
エービーシー・マート	2	3	21,472
ハードオフコーポレーション	0.800	-	-
アスクル	2	2	6,961
ゲオホールディングス	3	2	3,958
アダストリア	1	2	7,981
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	12	-	-
くらコーポレーション	1	1	5,104
キャンドゥ	0.900	0.900	1,632
パルグループホールディングス	1	0.900	2,501
エディオン	7	6	7,004
サーラコーポレーション	-	2	1,375
ワッツ	1	1	1,426
ハローズ	0.500	0.600	1,415
あみやき亭	0.300	0.400	1,628
ひらまつ	2	2	1,584
ゲンキー	0.400	0.400	2,576
大黒天物産	0.400	0.400	2,012
ハニーズ	1	1	1,669
ファーマライズホールディングス	2	2	1,236
アルペン	1	1	3,142
クオール	1	2	3,068
ジェイアイエヌ	1	1	7,164
ビックカメラ	8	10	10,847
DCMホールディングス	8	10	10,525

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
MonotaRO	6	6	20,057
ダイヤモンドダイニング	-	0.900	1,509
きちり	0.100	1	1,254
アークランドサービスホールディングス	0.500	0.500	1,602
J. フロント リテイリング	21	22	38,184
ドトール・日レスホールディングス	3	3	6,940
マツモトキヨシホールディングス	3	3	17,424
ブロンコビリー	0.700	0.900	2,523
スタートトゥデイ	5	16	39,792
物語コーポレーション	0.500	0.500	2,230
ココカラファイン	1	1	8,424
三越伊勢丹ホールディングス	34	34	48,266
ウエルシアホールディングス	1	1	10,693
クリエイティブSDホールディングス	2	2	6,687
チムニー	0.400	0.500	1,429
ジョイフル本田	2	2	9,702
鳥貴族	-	0.500	1,213
キリン堂ホールディングス	1	1	1,194
ホットランド	-	1	1,135
すかいらーく	5	7	12,030
綿半ホールディングス	-	0.800	1,296
ヨシックス	-	0.900	1,188
3dイット・スーパーマーケット・ホールディングス	5	5	5,858
ブックオフコーポレーション	1	1	1,285
あさひ	1	1	1,704
日本調剤	0.400	0.600	2,238
コスモス薬品	0.900	0.900	19,089
一六堂	2	-	-
セブン&アイ・ホールディングス	72	73	323,033
薬王堂	0.400	0.900	2,185
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	1	4	4,845
ツルハホールディングス	4	4	41,920
サンマルクホールディングス	1	1	3,839
トリドールホールディングス	2	2	5,205
クスリのアオキ	1	-	-
パロックジャパンリミテッド	-	1	1,405
クスリのアオキホールディングス	-	1	7,640
メディカルシステムネットワーク	2	2	1,271
総合メディカル	0.800	0.800	3,196
はるやまホールディングス	1	1	1,374
ノジマ	-	2	2,812
カッパ・クリエイティブ	2	2	3,197
ライトオン	1	1	1,277
ジーンズメイト	-	4	1,087

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
良品計画	2	2	51,589
三城ホールディングス	2	2	1,237
アドヴァン	1	1	2,086
アルビス	-	0.500	1,627
コナカ	2	2	1,320
ハウス オブ ローゼ	0.700	0.800	1,240
イオン北海道	1	2	1,234
コジマ	4	-	-
ヒマラヤ	1	1	1,199
コーナン商事	2	2	5,455
エコス	0.800	1	1,210
ワタミ	2	2	2,402
マルシェ	1	1	1,260
ドンキホーテホールディングス	11	11	44,465
西松屋チェーン	3	3	4,030
ゼンショーホールディングス	8	9	17,235
幸楽苑ホールディングス	1	1	1,844
サイゼリヤ	2	2	7,656
VTホールディングス	5	5	3,091
魚力	-	0.900	1,170
ユナイテッドアローズ	2	2	8,038
ハイデイ日高	1	1	4,624
京都きもの友禅	1	1	1,194
コロワイド	5	5	10,822
ピーシーデポコーポレーション	1	2	1,285
壱番屋	0.800	1	6,040
トップカルチャー	2	2	1,205
P L A N T	0.800	1	1,198
スギホールディングス	3	3	20,330
スクロール	2	3	1,267
ヨンドシーホールディングス	1	1	3,324
エニ・ファミリーマートホールディングス	5	7	54,285
木曽路	2	2	4,974
サトレストランシステムズ	2	2	1,816
千趣会	3	3	2,540
ケーヨー	2	3	1,755
上新電機	4	4	4,356
日本瓦斯	2	3	10,704
ベスト電器	8	-	-
ロイヤルホールディングス	2	2	5,834
東天紅	7	7	1,183
いなげや	1	1	2,977
島忠	4	4	12,798
チヨダ	2	2	5,768

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	1	1	4,309
リンガーハット	1	2	4,586
MR MAX	3	-	-
テナライド	2	3	1,260
AOKIホールディングス	3	3	4,973
オークワ	3	2	2,236
コメリ	2	2	7,398
青山商事	3	3	15,355
しまむら	2	2	29,040
はせがわ	-	2	1,206
高島屋	25	29	29,000
松屋	3	3	3,826
エイチ・ツー・オー リテイリング	8	9	16,830
近鉄百貨店	7	7	2,499
ニッセンホールディングス	6	-	-
パルコ	1	1	1,934
丸井グループ	21	18	28,722
アクシアル リテイリング	1	1	6,300
イオン	70	72	122,786
ユニグループ・ホールディングス	16	-	-
イズミ	3	3	17,167
平和堂	3	3	9,648
フジ	1	1	4,561
ヤオコー	2	2	9,120
ゼビオホールディングス	2	2	4,308
ケーズホールディングス	3	8	16,912
Olympicグループ	1	1	1,210
アインホールディングス	2	2	17,913
元気寿司	0.500	0.600	1,361
ヤマダ電機	52	58	33,812
アークランドサカモト	2	3	4,269
ニトリホールディングス	7	7	93,100
グルメ杵屋	1	1	1,041
愛眼	4	6	1,221
ケーユーホールディングス	-	1	1,371
吉野家ホールディングス	6	6	10,162
松屋フーズ	0.800	0.800	3,336
サガミチェーン	2	2	3,027
関西スーパーマーケット	1	1	2,147
王将フードサービス	1	1	5,518
プレナス	1	2	4,990
ミニストップ	1	1	2,815
アークス	3	3	8,530
パローホールディングス	3	3	10,541

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
藤久	0.600	0.700	1,221
ベルク	0.800	0.800	3,624
大庄	0.800	0.900	1,435
ファーストリテイリング	3	2	101,471
サンドラッグ	3	3	24,552
サックスパー ホールディングス	1	1	2,008
やまや	0.100	0.700	1,204
ペルーナ	4	4	3,735
銀行業(8.7%)			
島根銀行	0.800	0.900	1,269
じもとホールディングス	12	12	2,469
めぶきフィナンシャルグループ	12	84	41,236
東京TYフィナンシャルグループ	2	2	10,000
九州フィナンシャルグループ	26	28	22,787
ゆうちょ銀行	33	49	70,680
富山第一銀行	-	4	2,479
コンコディア・フィナンシャルグループ	-	114	70,475
西日本フィナンシャルホールディングス	-	11	14,982
新生銀行	149	167	34,903
あおぞら銀行	109	111	46,287
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,382	1,328	1,019,945
りそなホールディングス	201	205	129,089
三井住友トラスト・ホールディングス	360	36	154,635
三井住友フィナンシャルグループ	138	140	638,679
第四銀行	22	21	11,277
北越銀行	19	1	5,213
西日本シティ銀行	56	-	-
千葉銀行	66	68	53,584
横浜銀行	116	-	-
常陽銀行	62	-	-
群馬銀行	38	39	26,130
武蔵野銀行	2	2	10,388
千葉興業銀行	4	4	3,024
筑波銀行	7	7	2,576
七十七銀行	27	27	14,526
青森銀行	13	14	5,516
秋田銀行	11	11	4,048
山形銀行	10	10	4,950
岩手銀行	1	1	5,263
東邦銀行	15	16	7,056
東北銀行	9	9	1,440
みちのく銀行	9	9	1,719
ふくおかフィナンシャルグループ	75	71	35,855
静岡銀行	51	48	48,864

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
十六銀行	22	24	9,912
スルガ銀行	16	17	45,859
八十二銀行	31	33	24,437
山梨中央銀行	11	11	6,127
大垣共立銀行	23	23	10,419
福井銀行	15	15	4,260
北國銀行	19	19	9,101
清水銀行	0.600	0.600	2,268
富山銀行	0.300	0.300	1,254
滋賀銀行	16	16	10,144
南都銀行	17	1	8,041
百五銀行	15	16	8,320
京都銀行	33	31	29,884
紀陽銀行	6	6	12,691
三重銀行	8	0.800	2,024
ほくほくフィナンシャルグループ	117	11	24,020
広島銀行	51	52	28,600
山陰合同銀行	10	10	10,804
中国銀行	12	12	22,481
鳥取銀行	6	0.600	1,161
伊予銀行	18	18	15,745
百十四銀行	19	19	7,619
四国銀行	13	14	4,410
阿波銀行	14	15	11,400
大分銀行	10	10	4,500
宮崎銀行	11	12	4,536
佐賀銀行	10	11	3,443
十八銀行	11	11	4,004
沖繩銀行	1	1	7,191
琉球銀行	3	3	5,986
セブン銀行	64	65	21,746
みずほフィナンシャルグループ	2,427	2,380	500,773
山口フィナンシャルグループ	16	17	22,457
長野銀行	6	0.700	1,415
名古屋銀行	14	1	6,547
北洋銀行	26	28	13,699
愛知銀行	0.600	0.600	4,272
第三銀行	10	1	1,757
中京銀行	7	0.700	1,613
東日本銀行	8	-	-
大光銀行	6	6	1,512
愛媛銀行	10	2	2,979
トマト銀行	7	-	-
みなと銀行	16	1	3,900

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
京葉銀行	14	14	7,672
関西アーバン銀行	2	2	3,789
栃木銀行	9	9	5,752
北日本銀行	0.500	0.500	1,585
東和銀行	24	33	4,191
福島銀行	21	19	1,843
大東銀行	10	9	1,548
トモニホールディングス	13	14	9,417
フィデアホールディングス	10	17	3,689
池田泉州ホールディングス	18	18	9,690
証券、商品先物取引業(1.3%)			
F P G	5	6	7,011
S B Iホールディングス	20	19	30,630
ジャフコ	2	2	11,426
大和証券グループ本社	161	164	116,604
野村ホールディングス	331	358	268,800
岡三証券グループ	15	15	11,370
丸三証券	5	5	5,387
東洋証券	7	6	1,632
野村フィナンシャル・ホールディングス	19	20	13,004
光世証券	4	7	1,337
水戸証券	5	5	1,684
いちよし証券	3	3	3,510
松井証券	8	10	9,330
だいこう証券ビジネス	-	2	1,278
マネックスグループ	20	18	5,527
カブドットコム証券	15	13	5,122
極東証券	2	2	4,034
岩井コスモホールディングス	1	1	1,881
藍澤証券	2	3	2,135
マネースクウェアHD	1	-	-
マネーパートナーズグループ	3	1	902
保険業(2.8%)			
かんぽ生命保険	5	6	18,348
SOMPOホールディングス	38	36	156,684
アニコムホールディングス	1	1	2,712
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	51	52	201,478
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	16	33,885
第一生命ホールディングス	110	105	233,227
東京海上ホールディングス	69	71	361,319
T&Dホールディングス	62	63	115,531
アドバンスクリエイト	-	0.500	1,041
その他金融業(1.3%)			
全国保証	4	4	17,738

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クレディセゾン	13	13	28,927
アクリーティブ	—	2	995
芙蓉総合リース	2	2	10,600
興銀リース	3	3	8,256
東京センチュリー	4	3	13,650
日本証券金融	7	7	4,866
アイフル	28	29	10,437
ポケットカード	2	1	728
リコーリース	1	1	5,110
イオンフィナンシャルサービス	11	11	23,788
アコム	34	35	17,388
ジャックス	10	10	5,080
オリエントコーポレーション	74	37	8,148
日立キャピタル	4	4	12,074
アプラスフィナンシャル	11	10	1,249
オリックス	122	124	218,664
三菱UFJリース	43	44	27,590
日本取引所グループ	50	54	87,309
イー・ギャランティ	0.600	0.500	1,306
NECキャピタルソリューション	0.700	0.700	1,276
不動産業(2.5%)			
いちご	14	16	6,112
日本駐車場開発	18	21	3,228
ビューリック	35	36	39,820
野村不動産ホールディングス	11	11	22,330
三重交通グループホールディングス	3	3	1,209
サムティ	—	1	1,673
日本商業開発	0.600	1	1,942
プレサンスコーポレーション	0.600	2	3,939
ユニゾホールディングス	1	1	4,333
THEグローバル社	—	2	1,225
日本管理センター	1	1	1,803
サンセイランディック	1	1	1,288
フージャースホールディングス	2	2	1,409
オープンハウス	2	2	6,790
東急不動産ホールディングス	41	42	27,772
飯田グループホールディングス	16	14	26,557
シーアールイー	—	0.800	1,346
パーク24	8	8	27,545
パラカ	0.800	0.600	1,194
三井不動産	91	93	243,892
三菱地所	128	130	293,605
平和不動産	3	3	5,319
東京建物	18	20	32,256

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイビル	4	4	4,801
京阪神ビルディング	2	2	1,899
住友不動産	41	42	136,332
大京	33	33	7,656
テーオーシー	6	6	6,555
東京楽天地	3	3	1,584
レオパレス21	20	22	13,392
スターツコーポレーション	2	1	4,379
フジ住宅	2	2	1,641
空港施設	2	2	1,245
明和地所	1	1	1,210
住友不動産販売	1	1	4,555
ゴールドクレスト	1	1	3,419
日本エスリード	0.900	0.900	1,372
日神不動産	2	2	1,267
タカラレーベン	7	7	4,567
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,213
イオンモール	11	11	19,571
ファースト住建	0.800	0.800	1,146
トーセイ	2	2	1,862
穴吹興産	4	0.500	1,334
エヌ・ティ・ティ都市開発	10	10	11,477
サンフロンティア不動産	2	1	1,949
エフ・ジェー・ネクスト	2	—	—
ランドビジネス	3	4	1,271
グランディハウス	2	2	1,212
日本空港ビルデング	5	5	22,148
サービス業(3.6%)			
日本工営	6	1	3,280
ネクスト	5	4	3,394
ジェイエイシールートメント	—	1	1,701
日本M&Aセンター	2	5	18,549
ノバレーゼ	1	—	—
アコーディア・ゴルフ	7	—	—
タケエイ	1	1	1,640
トラスト・テック	0.400	0.800	1,376
コシダカホールディングス	—	0.600	1,489
パソナグループ	1	1	1,299
リンクアンドモチベーション	8	4	1,918
GCA	1	1	1,528
エス・エム・エス	2	2	6,671
テンプホールディングス	12	14	27,699
リニカル	1	1	1,587
クックパッド	4	4	3,997

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額 千円
アイ・ケイ・ケイ	1	1	1,292
学情	1	1	1,204
スタジオアリス	0.800	0.800	1,799
シミックホールディングス	0.800	0.900	1,338
N J S	0.800	0.900	1,258
総合警備保障	6	6	29,444
カカクコム	13	13	21,291
ルネサンス	0.900	0.900	1,533
ディップ	2	2	5,570
オプトホールディング	1	1	1,582
新日本科学	2	2	1,180
ツクイ	2	4	3,005
キャリアデザインセンター	1	0.900	1,046
エムスリー	15	16	45,804
ツカダ・グローバルホールディング	1	1	1,121
アウトソーシング	0.800	1	4,108
ウェルネット	0.700	1	1,810
ディー・エヌ・エー	8	8	20,442
博報堂DYホールディングス	25	25	34,360
ぐるなび	2	2	5,985
エスアールジータカミヤ	3	2	1,170
ジャパンベストレスキューシステム	4	5	1,265
ファンコミュニケーションズ	4	4	3,642
WDBホールディングス	1	1	1,368
ティア	1	1	1,322
バリューコマース	2	-	-
インフォマート	2	7	4,684
J Pホールディングス	4	5	1,367
E P Sホールディングス	2	2	3,507
プレステージ・インターナショナル	1	2	2,314
アミューズ	0.500	1	2,023
ドリームインキュベータ	0.600	0.600	1,272
T A C	5	5	1,236
ケネディクス	24	24	10,980
電通	20	20	123,579
テイクアンドギヴ・ニーズ	2	1	1,531
ぴあ	0.500	0.600	1,753
イオンファンタジー	0.600	0.500	1,560
シーティーエス	-	0.900	1,399
みらかホールディングス	4	4	23,829
アルプス技研	0.700	0.700	2,138
ダイオーズ	1	1	1,181
日本空調サービス	0.900	2	1,332
オリエンタルランド	19	20	126,971

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額 千円
ダスキン	5	4	11,716
明光ネットワークジャパン	2	2	2,780
ファルコホールディングス	0.800	0.900	1,345
秀英予備校	1	2	1,346
ラウンドワン	5	5	5,104
リゾートトラスト	7	7	15,847
ビー・エム・エル	1	2	5,944
ワタベウェディング	-	2	1,661
りらいあコミュニケーションズ	3	3	3,379
リソー教育	3	3	2,003
ユー・エス・エス	22	22	43,492
サイバーエージェント	4	9	29,498
楽天	85	94	97,454
セントラルスポーツ	0.600	0.600	2,148
フルキャストホールディングス	1	1	2,040
テクノプロ・ホールディングス	3	3	11,565
K e e P e r 技研	-	0.700	1,508
リブセンス	0.700	2	1,190
ジャパンマテリアル	0.800	1	2,132
ベクトル	0.600	1	1,872
ウチヤマホールディングス	-	2	1,229
キャリアリンク	-	1	1,176
I B J	-	1	1,140
アサンテ	0.700	0.700	1,215
N・フィールド	-	0.900	1,323
アビスト	0.500	0.300	1,188
ウィルグループ	1	1	1,205
日本ビューホテル	-	0.900	1,215
リクルートホールディングス	36	40	215,865
日本郵政	40	48	71,341
ベルシステム24ホールディングス	2	2	2,800
リログループ	0.700	0.700	11,060
東祥	0.500	0.400	2,060
エイチ・アイ・エス	3	3	8,781
ラックランド	-	0.600	1,198
共立メンテナンス	1	1	10,395
イチネンホールディングス	1	1	2,272
建設技術研究所	1	1	1,312
スペース	1	1	1,285
東京テアトル	8	8	1,216
ナガワ	0.300	0.300	1,365
よみうりランド	4	4	1,848
東京都競馬	12	13	3,354
常磐興産	7	0.800	1,291

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	千円	
カナモト	2	2	7,501	
東京ドーム	15	7	8,095	
西尾レントオール	1	1	4,950	
トランス・コスモス	2	2	5,757	
乃村工藝社	3	4	7,648	
藤田観光	7	6	2,220	
KNT-CTホールディングス	9	10	1,380	
日本管財	1	1	2,862	
トーカイ	0.800	0.800	3,280	
白洋舎	-	0.500	1,350	
セコム	19	19	158,144	
セントラル警備保障	0.800	0.800	1,518	
丹青社	3	3	2,774	
メイテック	2	2	9,570	
アサツー ディ・ケイ	3	3	8,673	
応用地質	1	1	2,638	
船井総研ホールディングス	2	2	4,699	
進学会	1	2	1,256	
学究社	-	0.800	1,301	
ベネッセホールディングス	6	6	20,708	
イオンディライト	1	2	7,287	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円	
ナック	1	1	1,189	
ニチイ学館	3	3	2,822	
ダイセキ	3	3	7,414	
ステップ	-	0.900	1,261	
合 計	株数・金額	28,896	26,741	40,065,445
	銘柄数<比率>	1,672	1,711	<97.7%>

(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 内	百万円	百万円
T O P I X	928	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 40,065,445	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,048,159	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	41,113,604	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

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	41,104,725,800円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	938,060,227
株 式 (評価額)	40,065,445,160
未 収 入 金	10,077,600
未 収 配 当 金	66,042,813
差 入 委 託 証 拠 金	25,100,000
(B)負 債	106,718,372
未 払 解 約 金	106,717,303
そ の 他 未 払 費 用	1,069
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	40,998,007,428
元 本	26,374,834,259
次 期 繰 越 損 益 金	14,623,173,169
(D)受 益 権 総 口 数	26,374,834,259口
1万口当たり基準価額 (C/D)	15,544円

(注1) 期首元本額	26,708,202,183円
期中追加設定元本額	10,006,231,236円
期中一部解約元本額	10,339,599,160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	7,816,865,155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)	6,332,736,059円
ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定)	14,519,282円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	6,437,271円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	555,106,395円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,800,563,440円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	2,128,386,619円
ニッセイ/パナゴラ・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)	46,174,999円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (標準型) SA (適格機関投資家限定)	225,366,268円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	217,749,600円
ニッセイ厚生年金型バランス運用 (現物型) DB (適格機関投資家限定)	1,897,634,169円
DCニッセイ国内株式インデックス	33,239,884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	4,083,558,090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)	216,164,160円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	332,868円

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日～2017年2月20日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	779,010,841円
受 取 配 当 金	778,889,457
受 取 利 息	11,057
そ の 他 収 益 金	525,339
支 払 利 息	△ 415,012
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	6,645,935,503
売 買 益	7,431,372,298
売 買 損	△ 785,436,795
(C)先 物 取 引 等 損 益	118,811,960
取 引 益	206,500,660
取 引 損	△ 87,688,700
(D)信 託 報 酬 等	△ 29,665
(E)当期損益金 (A+B+C+D)	7,543,728,639
(F)前 期 繰 越 損 益 金	7,429,245,557
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	3,681,764,874
(H)解 約 差 損 益 金	△ 4,031,565,901
(I)合 計 (E+F+G+H)	14,623,173,169
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	14,623,173,169

(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。