

第1期末 (2016年2月22日)	
基準価額	8,098円
純資産総額	28億円
騰落率	△19.0%
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：2015年4月27日～2016年2月22日

第1期 (決算日 2016年2月22日)

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。



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

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1期の決算を行いました。

当ファンドは、主に「ニッセイ国内株式インデックススマザーファンド」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を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する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。

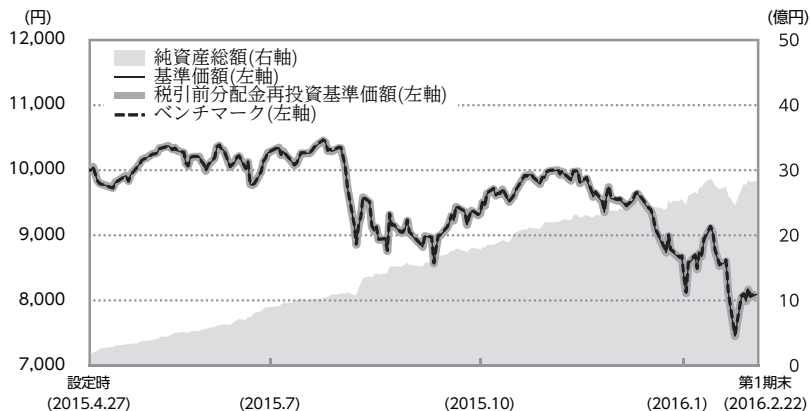
今後とも是非ご継続頂き、いっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<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

(2015年4月27日から2016年2月22日まで)

基準価額等の推移



設定時	10,000円
第1期末	8,098円
既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	△19.0%

- (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、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。
- (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、設定時を10,000として指数化しています。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

当期は、国内株式市場が下落したことから、基準価額も同様の動きとなりました。設定当初は堅調に推移しましたが、8月中旬に中国景気の減速懸念を背景として世界的に株式市場が急落したため、基準価額も下落しました。10月に入ると、欧州中央銀行(ECB)のドラギ総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどをを受けて上昇基調に転じましたが、12月以降は、原油安や世界経済への懸念などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価が下落したことから、基準価額も下落基調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

項目	第1期		項目の概要
	2015年4月27日~2016年2月22日		
	金額	比率	
信託報酬	25円	0.259%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は9,589円です。
(投信会社)	(11)	(0.116)	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)	(0.116)	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
(受託銀行)	(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	0	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
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
その他費用	1	0.007	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.007)	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
合計	26	0.269	

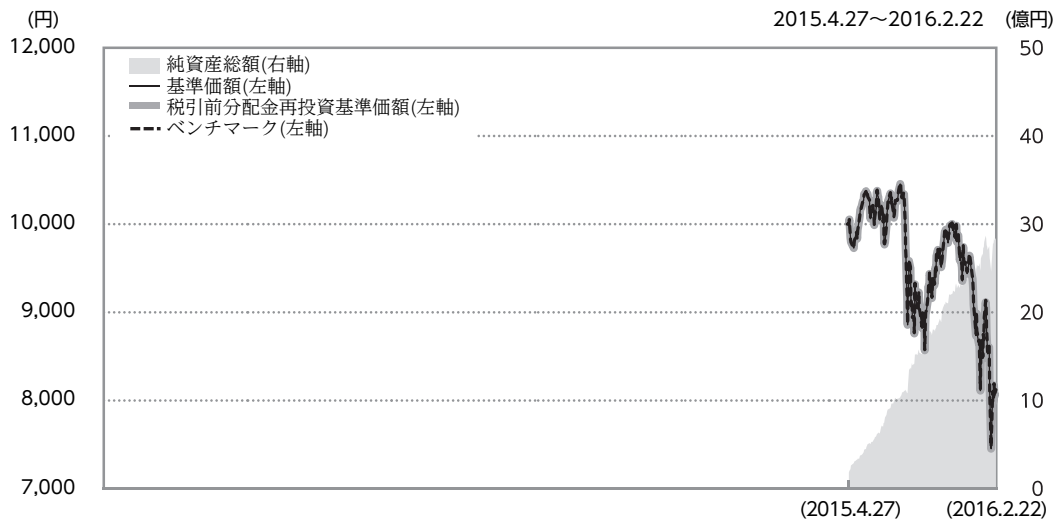
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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

最近5年間の基準価額等の推移



(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。

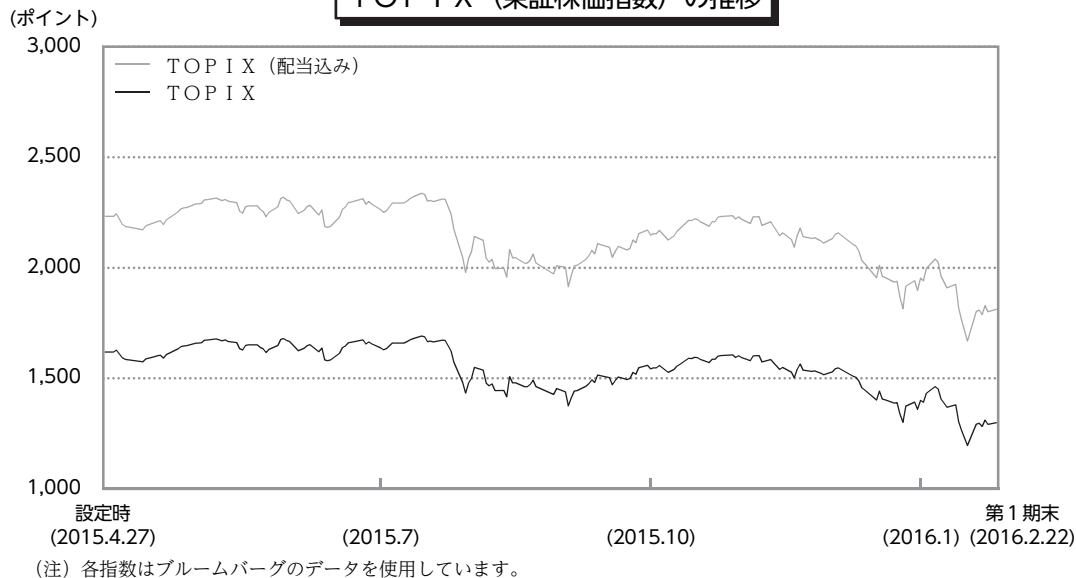
決算日		2015年4月27日	2016年2月22日
基準価額 (分配前)	(円)	10,000	8,098
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	0
税引前分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	△19.0
ベンチマーク騰落率	(%)	—	△18.8
純資産総額	(百万円)	182	2,843

(注1) 当ファンドの設定日は2015年4月27日です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

国内株式市況

TOPIX (東証株価指数) の推移



設定時は、国内企業の好調な決算や米利上げ観測による円安進行などを背景として堅調に推移しました。

しかし、8月中旬に中国人民銀行（中央銀行）が人民元の基準値切り下げを発表したことで、中国景気の減速懸念が高まり世界景気に対する後退懸念へとつながったため、世界的に株式市場が急落し、その後も米利上げ時期に対する不透明感などを背景に乱高下する展開が続きました。

10月に入ると、ECB総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどをを受けて、投資家のリスク回避姿勢が後退したため上昇基調に転じ、その後も米国の利上げ観測による円安の進行を背景として堅調に推移しました。

しかし、12月には、原油安等を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に株価は軟調な推移となり、年明け以降も、中国経済への懸念が一段と強まったため下落しました。その後、日銀によるマイナス金利の導入を好感して上昇する場面もありましたが、原油安や円高進行などをを受けて、下落基調のまま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）。

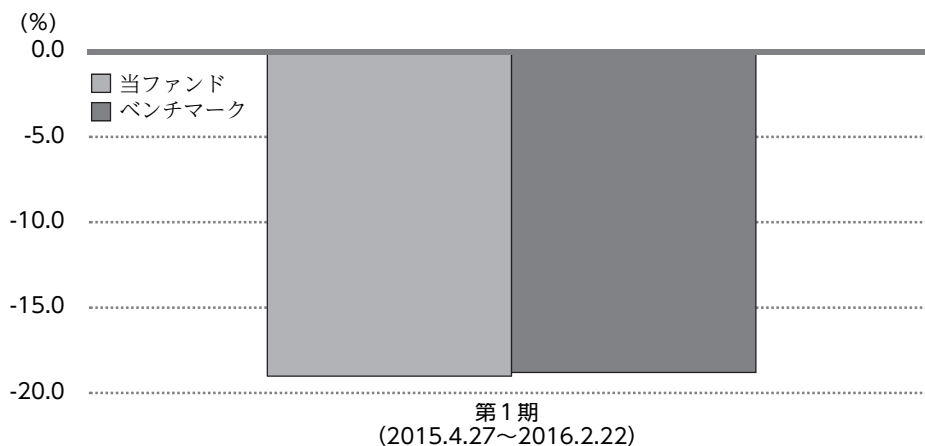
■マザーファンド

当期も東証一部上場銘柄のうち1,650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（市場でのウェイトが大きな銘柄については、ベンチマークであるTOP I X（配当込み）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先物も一部利用しました。

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-19.0%となり、ベンチマーク騰落率（-18.8%）にはほぼ連動しました。

<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

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
	2015年4月27日 ～2016年2月22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	50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を行い、TOP I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざします。

■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を行い、TOP I X（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。

<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

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1期末
	2016年2月22日
ニッセイ国内株式インデックス 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。

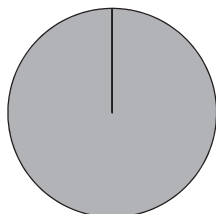
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

項目	第1期末
	2016年2月22日
純資産総額	2,843,409,790円
受益権総口数	3,511,316,929口
1万口当たり基準価額	8,098円

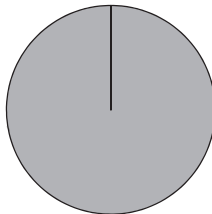
(注) 当期間中における追加設定元本額は5,032,385,821円、同解約元本額は1,703,917,701円です。

■資産別配分



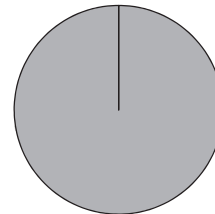
親投資信託受益証券
100.0%

■国別配分



日本
100.0%

■通貨別配分



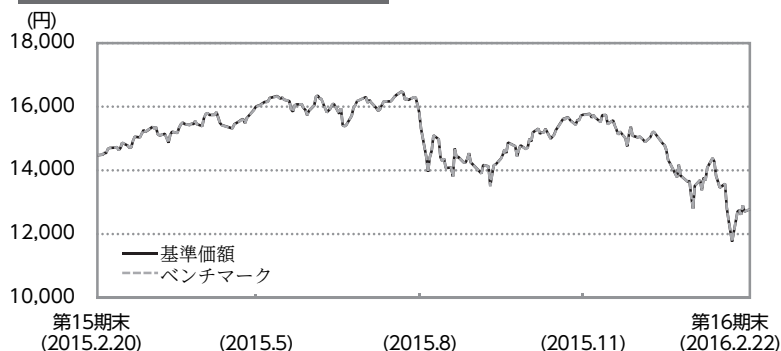
円
100.0%

(注) 資産別・国別・通貨別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド

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。

■上位銘柄

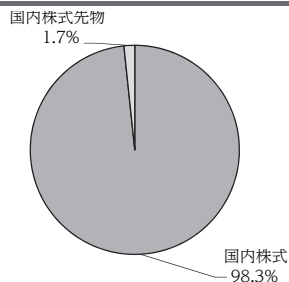
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.8%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.9
日本電信電話	円	1.9
KDDI	円	1.5
日本たばこ産業	円	1.5
ソフトバンクグループ	円	1.5
本田技研工業	円	1.3
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.2
みずほフィナンシャルグループ	円	1.2
武田薬品工業	円	1.2
組入銘柄数		1,672

■1万口当たりの費用明細

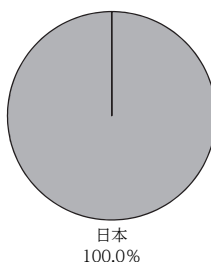
(2015.2.21~2016.2.22)

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

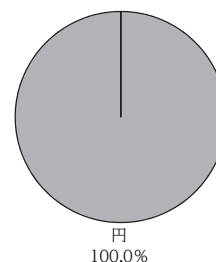
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものです。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

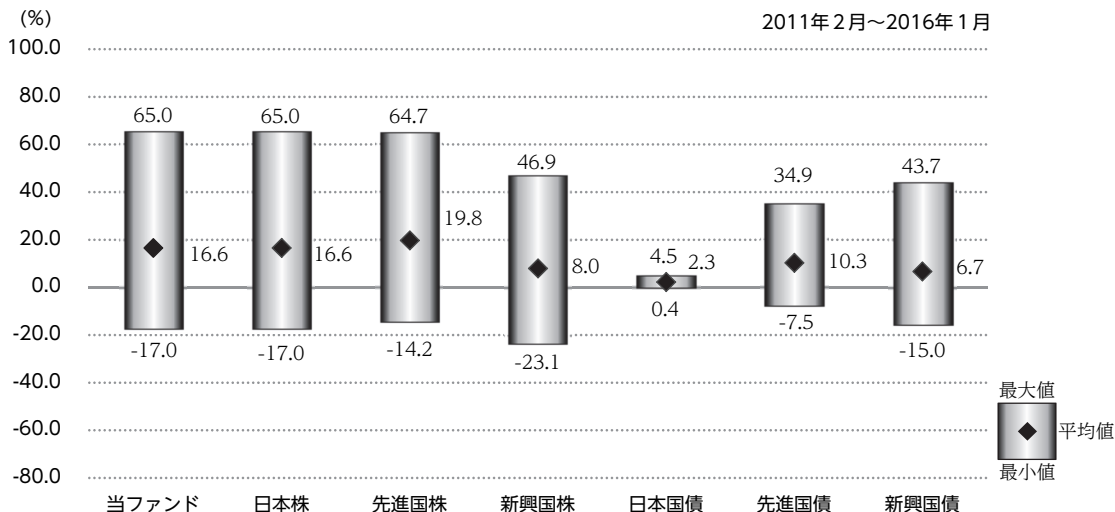
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2016年2月22日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

<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

参考情報

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- (注1) 上記は、当ファンドの騰落率（税引前分配金再投資基準価額騰落率）と代表的な資産クラスの騰落率を比較したものであり、各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- (注2) 2011年2月～2016年1月の5年間における1年リターンの平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。
- (注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年分に満たないため、設定日以前のデータはファンドのベンチマークを用いて騰落率を算出しています。したがって、すべてがファンドの実績ではありません。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOP I X（東証株価指数）（配当込み）
- 先進国株・・・MSC I コクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
- 新興国株・・・MSC I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ベース）

- ・すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし（対円）」の指数を採用しています。

・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。

・MSC I コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

・MSC I エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

・NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、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、一切責任を負いません。

・シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

◆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) 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

(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。以下同じです。

(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		
(設定日) 2015年4月27日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —
4月末	9,840	△1.6	9,839	△1.6	97.3	2.8
5月末	10,343	3.4	10,339	3.4	98.2	1.6
6月末	10,081	0.8	10,089	0.9	98.4	1.6
7月末	10,260	2.6	10,269	2.7	98.1	1.8
8月末	9,502	△5.0	9,514	△4.9	96.6	5.0
9月末	8,789	△12.1	8,799	△12.0	96.8	3.3
10月末	9,705	△3.0	9,716	△2.8	97.4	2.6
11月末	9,840	△1.6	9,854	△1.5	97.8	2.2
12月末	9,642	△3.6	9,664	△3.4	96.9	3.0
2016年1月末	8,926	△10.7	8,945	△10.5	97.9	2.2
(期末) 2016年2月22日	8,098	△19.0	8,120	△18.8	98.3	1.7

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は設定日比です。

◆親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2015年4月27日～2016年2月22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	3,307,891	4,896,869	1,083,291	1,609,945

(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	14,505,199千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	41,217,954千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.35

(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

(2015年4月27日～2016年2月22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

(2016年2月22日現在)

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	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	2,843,483

(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26,708,202千口です。

◆投資信託財産の構成

(2016年2月22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	2,843,483	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,774	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	2,856,258	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

(2016年2月22日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,856,258,487円
コール・ローン等	2,350,716
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,843,483,731
未 収 入 金	10,424,040
(B) 負 債	12,848,697
未 払 解 約 金	10,350,168
未 払 信 託 報 酬	2,438,930
そ の 他 未 払 費 用	59,599
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,843,409,790
元 本	3,511,316,929
次 期 繰 越 損 益 金	△ 667,907,139
(D) 受 益 権 総 口 数	3,511,316,929口
1万口当たり基準価額 (C/D)	8,098円

- (注1) 設定元本額 182,848,809円
 期中追加設定元本額 5,032,385,821円
 期中一部解約元本額 1,703,917,701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
 667,907,139円です。

◆損益の状況

当期 (2015年4月27日～2016年2月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	210円
受 取 利 息	210
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△395,795,686
売 買 益	65,540,274
売 買 損	△461,335,960
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,081,576
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△399,877,052
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金 *	△268,030,087
(売 買 損 益 相 当 額)	(△268,030,087)
(F) 合 計 (D+E)	△667,907,139
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	△667,907,139
追 加 信 託 差 損 益 金	△268,030,087
(配 当 等 相 当 額)	(4,563,981)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△272,594,068)
分 配 準 備 積 立 金	13,322,459
繰 越 欠 損 金	△413,199,511

- (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)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。設定時の金額に、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

計算期間末における信託報酬等控除後の配当等収益 (13,322,459円)、信託報酬等控除後の有価証券売買等損益 (0円)、追加信託差損益金 (4,563,981円)、および分配準備積立金 (0円)より、分配対象収益は17,886,440円 (1万口当たり50.94円) ですが、当期の収益分配は見送らせていただきました。

※当ファンドは、マザーファンドの配当等収益および追加信託差損益金相当額を分配対象収益に充当する方式を適用しており、上記の計算過程はこの方式による調整後の金額を記載しています。

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド

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		主に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を行い、TOPIX（東証株価指数）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	＜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16期

(計算期間：2015年2月21日～2016年2月22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	国内の証券取引所上場株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）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を維持する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

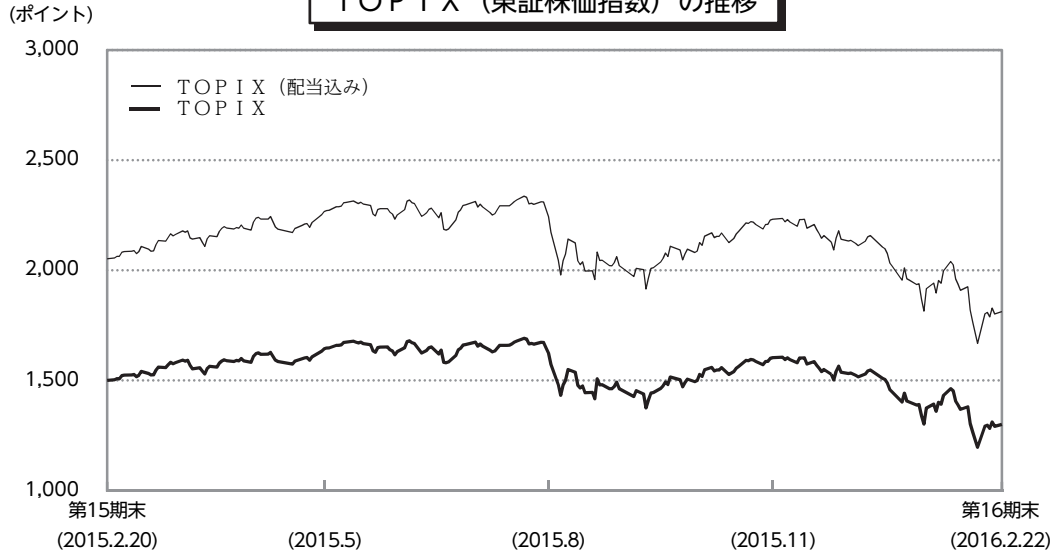
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

(2015年2月21日から2016年2月22日まで)

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。

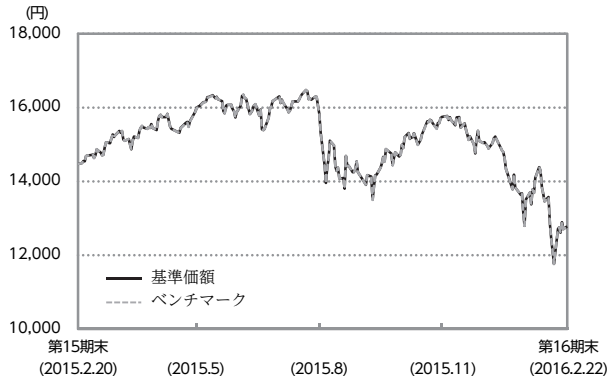
期初は、国内景気に対する回復期待や中国の金融緩和などを受けて、投資家の買い安心感が広がったことから、国内株式市場は上昇基調で推移し、その後も国内企業の好調な決算や米利上げ観測による円安進行などを背景として堅調に推移しました。

しかし、8月中旬に中国人民銀行（中央銀行）が人民元の基準値切り下げを発表したことで、中国景気の減速懸念が高まり世界景気に対する後退懸念へとつながったため、世界的に株式市場が急落し、その後も米利上げ時期に対する不透明感などを背景に乱高下する展開が続きました。

10月に入ると、ECB総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどを受けて、投資家のリスク回避姿勢が後退したため上昇基調に転じ、その後も米国の利上げ観測による円安の進行を背景として堅調に推移しました。

しかし、12月には、原油安等を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に株価は軟調な推移となり、年明け以降も、中国経済への懸念が一段と強まったため下落しました。その後、日銀によるマイナス金利の導入を好感して上昇する場面もありましたが、原油安や円高進行などを受けて、下落基調のまま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

当期は、国内株式市場が下落したことから、基準価額も同様の動きとなりました。期初は堅調に推移しましたが、8月中旬に中国景気の減速懸念を背景として世界的に株式市場が急落したため、基準価額も下落しました。10月に入ると、欧州中央銀行（ECB）のドラギ総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどをを受けて上昇基調に転じましたが、12月以降は、原油安や世界経済への懸念などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価が下落したことから、基準価額も下落基調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1,650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（市場でのウェイトが大きな銘柄については、ベンチマークであるTOPIX（配当込み）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-11.7%となり、ベンチマーク騰落率（-11.7%）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を行い、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。

お知らせ

■約款変更

信用リスク分散規制にかかる投資制限条項を追加するため、関連条項に所要の変更を行いました。
(2015年4月27日)

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク		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
12期(2012年2月20日)	7,427	△13.9	7,487	△14.0	98.2	1.3	29,035
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

(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		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)	円	%		%	%	%
2015年2月20日	14,473	—	14,609	—	98.6	1.3
2月末	14,703	1.6	14,842	1.6	99.4	0.7
3月末	15,006	3.7	15,147	3.7	98.0	2.0
4月末	15,492	7.0	15,635	7.0	97.3	2.8
5月末	16,288	12.5	16,430	12.5	98.2	1.6
6月末	15,880	9.7	16,032	9.7	98.4	1.6
7月末	16,165	11.7	16,319	11.7	98.1	1.8
8月末	14,975	3.5	15,118	3.5	96.6	5.0
9月末	13,856	△4.3	13,982	△4.3	96.8	3.3
10月末	15,303	5.7	15,440	5.7	97.4	2.6
11月末	15,521	7.2	15,659	7.2	97.8	2.2
12月末	15,213	5.1	15,357	5.1	96.9	3.0
2016年1月末	14,086	△2.7	14,214	△2.7	97.9	2.2
(期末)						
2016年2月22日	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7

(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

◆売買および取引の状況

(2015年2月21日～2016年2月22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
		6,495 (△ 545)	7,541,553	8,896	11,042,123

(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	株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
		14,452	14,419	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆主要な売買銘柄

(2015年2月21日～2016年2月22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	35	252,921	7,104	トヨタ自動車	84	631,442	7,499
三菱UFJフィナンシャル・グループ	218	154,643	709	三菱UFJフィナンシャル・グループ	361	261,792	725
ソフトバンクグループ	21	137,167	6,321	日本電信電話	30	158,697	5,254
三井住友フィナンシャルグループ	29	131,842	4,515	三井住友フィナンシャルグループ	35	156,639	4,475
日本たばこ産業	25	113,021	4,414	本田技研工業	41	153,712	3,739
日本電信電話	18	96,689	5,226	ソフトバンクグループ	24	149,022	6,057
みずほフィナンシャルグループ	407	92,197	226	みずほフィナンシャルグループ	612	134,382	219
ソニー	28	91,457	3,209	KDDI	43	131,340	2,998
武田薬品工業	15	89,620	5,744	キャノン	31	122,065	3,826
本田技研工業	24	87,838	3,541	日本たばこ産業	29	120,541	4,086

(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

(2016年2月22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%)			
極洋	9	8	2,096
日本水産	26	22	12,285
マルハニチロ	4	4	8,944
サカタのタネ	3	2	7,989
ホクト	2	2	4,046
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	6	6	632
日鉄鉱業	6	5	2,050
三井松島産業	14	13	1,534
国際石油開発帝石	113	103	85,047
日本海洋掘削	0.600	0.600	1,217
石油資源開発	3	3	7,886
K&Oエナジーグループ	1	1	1,592
建設業(3.1%)			
ショーボンドホールディングス	2	2	8,064
ミライト・ホールディングス	6	6	4,770
タマホーム	2	—	—
ダイセキ環境ソリューション	0.600	—	—
安藤・間	14	13	6,785
東急建設	7	6	5,267
コムシスホールディングス	9	8	14,263
ミサワホーム	2	2	1,518
高松コンストラクショングループ	1	1	3,220
東建コーポレーション	0.800	0.800	6,856
ヤマウラ	3	—	—
大成建設	109	102	70,584
大林組	65	58	58,054
清水建設	66	60	51,900
飛島建設	14	14	2,279
長谷工コーポレーション	27	22	21,568
松井建設	2	2	1,467
銭高組	3	3	1,326
鹿島建設	95	92	59,248
不動テトラ	16	13	1,573
鉄建建設	13	12	3,084
日鉄住金テックスエンジ	4	—	—
西松建設	23	23	9,867
三井住友建設	87	75	6,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
大豊建設	6	8	3,408
前田建設工業	14	12	9,012
佐田建設	8	2	967
ナカノフドー建設	2	1	946
奥村組	20	19	10,564
東鉄工業	2	2	6,969
イチケン	4	3	894
浅沼組	—	6	1,362
戸田建設	27	23	10,465
熊谷組	27	29	8,584
青木あすなる建設	1	1	996
北野建設	4	4	1,068
植木組	4	4	856
三井ホーム	3	3	1,518
矢作建設工業	2	2	1,973
ビーエス三菱	—	2	963
日本ハウスホールディングス	2	4	1,596
大東建託	8	7	110,887
新日本建設	2	2	1,196
N I P P O	5	5	8,445
東亜道路工業	4	4	1,400
前田道路	7	6	10,302
日本道路	6	6	3,336
東亜建設工業	16	17	4,131
若築建設	12	11	1,265
東洋建設	5	6	2,543
五洋建設	24	21	10,155
大林道路	3	2	1,681
世紀東急工業	3	3	1,447
福田組	3	3	2,736
住友林業	15	13	17,199
日本基礎技術	2	2	983
日成ビルド工業	6	5	1,845
ヤマダ・エスバイエルホーム	13	15	1,020
巴コーポレーション	2	—	—
パナホーム	8	7	5,761
大和ハウス工業	63	57	177,099
ライト工業	3	3	4,164
積水ハウス	66	65	117,948

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
日特建設	2	2	955
北陸電気工事	2	1	994
ユアテック	3	3	2,361
西部電気工業	2	—	—
四電工	3	—	—
中電工	3	2	6,554
関電工	10	8	6,712
きんでん	14	11	17,098
東京エネシス	2	2	1,746
トーエネック	3	3	2,037
住友電設	1	1	1,999
日本電設工業	3	3	6,835
協和エクシオ	9	7	9,709
新日本空調	1	1	1,537
NDS	4	3	846
九電工	4	4	8,976
三機工業	4	4	4,029
日揮	22	20	34,200
中外炉工業	7	6	1,056
太平電業	3	3	2,670
高砂熱学工業	6	5	8,862
三晃金属工業	5	—	—
朝日工業社	3	2	894
明星工業	3	3	1,442
大気社	3	2	6,091
ダイダン	3	3	2,262
日比谷総合設備	2	2	3,914
東芝プラントシステム	3	3	4,035
OSJBホールディングス	—	3	788
東洋エンジニアリング	10	10	2,630
千代田化工建設	16	14	11,858
新興ブランテック	4	4	3,520
食料品 (5.2%)			
日本製粉	13	13	10,465
日清製粉グループ本社	23	21	40,039
昭和産業	9	8	3,616
鳥越製粉	1	1	1,022
中部飼料	2	1	1,427
フィード・ワン	13	11	1,380
東洋精糖	12	10	1,010
日本甜菜製糖	11	10	1,870
三井製糖	8	8	3,840
塩水港精糖	4	4	989
日新製糖	—	0.300	1,297

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
森永製菓	19	18	11,556
中村屋	5	5	2,315
江崎グリコ	5	4	27,270
名糖産業	1	0.900	1,170
不二家	12	11	2,090
山崎製パン	16	14	30,170
モロゾフ	3	3	1,263
亀田製菓	1	1	4,730
寿スピリッツ	0.500	0.500	2,735
カルビー	8	7	33,444
森永乳業	19	18	9,648
六甲バター	0.100	0.900	1,611
ヤクルト本社	11	10	58,380
明治ホールディングス	6	11	108,228
雪印メグミルク	5	4	12,507
プリマハム	12	12	3,336
日本ハム	16	14	35,532
伊藤ハム	12	9	6,354
林兼産業	—	11	1,023
丸大食品	11	10	4,220
米久	0.700	0.600	1,539
S Foods	1	1	2,578
サッポロホールディングス	35	30	16,470
アサヒグループホールディングス	43	36	128,339
キリンホールディングス	92	79	118,870
宝ホールディングス	16	14	11,658
オエノンホールディングス	6	5	1,025
養命酒製造	1	0.600	1,149
コカ・コーラウエスト	7	6	17,146
コカ・コーライストジャパン	6	6	14,158
サントリー食品インターナショナル	12	13	66,866
ダイドードリンコ	1	1	5,120
伊藤園	6	5	18,821
キーコーヒー	1	1	3,061
ユニカフェ	1	0.600	553
ジャパンフーズ	1	—	—
日清オイリオグループ	10	10	4,540
不二製油グループ本社	5	5	10,134
かどや製油	0.400	—	—
J-オイルミルズ	9	8	2,720
キッコーマン	18	15	57,150
味の素	50	42	120,981
キュービー	11	10	25,540
ハウス食品グループ本社	8	6	14,773

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		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カゴメ	8	7	14,973
焼津水産化学工業	1	1	1,005
アリアケジャパン	2	1	10,208
エバラ食品工業	—	0.500	973
ニチレイ	23	21	18,627
東洋水産	11	9	39,984
日清食品ホールディングス	9	8	44,903
永谷園ホールディングス	2	2	2,076
一正蒲鉾	—	1	949
フジッコ	2	1	4,178
ロック・フィールド	1	1	2,996
日本たばこ産業	119	115	525,509
ケンコーマヨネーズ	—	0.600	1,390
わらべや日洋	1	1	2,589
なとり	1	1	1,592
ユーグレナ	4	6	10,038
ミヨシ油脂	9	8	968
理研ビタミン	0.600	0.600	2,244
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	2	2	2,716
グンゼ	16	15	4,290
東洋紡	80	72	11,304
ユニチカ	59	53	2,703
富士紡ホールディングス	10	9	1,836
倉敷紡績	21	19	3,325
シキボウ	12	11	1,177
日本毛織	6	6	4,446
ダイドーリミテッド	2	2	980
帝国繊維	2	1	2,800
帝人	82	75	28,425
東レ	156	133	121,535
サカイオーベックス	2	—	—
住江織物	5	5	1,430
日本フェルト	2	2	953
日本バイリーン	3	—	—
芦森工業	7	7	1,043
アツギ	17	14	1,526
ダイニック	7	—	—
セーレン	5	4	4,894
東海染工	9	3	351
小松精練	3	2	1,618
ワコールホールディングス	12	11	14,421
ホギメディカル	1	1	6,648
レナウン	—	9	969

銘柄	当期末		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
TSIホールディングス	9	8	5,977
三陽商会	11	10	2,570
オンワードホールディングス	14	12	8,460
ルック	6	—	—
ゴールドウイン	5	0.800	3,656
デサント	4	4	7,194
キング	2	2	919
ヤマトインターナショナル	2	2	988
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	12	11	4,048
王子ホールディングス	83	75	32,250
日本製紙	9	9	17,337
三菱製紙	31	28	2,240
北越紀州製紙	12	11	7,033
中越パルプ工業	8	8	1,272
大王製紙	9	8	7,063
レンゴー	18	16	8,624
トーモク	7	6	1,500
ザ・バック	1	1	3,434
化学 (6.1%)			
クラレ	34	28	35,807
旭化成	126	114	74,795
共和レザー	1	1	991
コープケミカル	8	—	—
昭和電工	134	122	13,786
住友化学	149	135	67,770
日本化成	8	9	1,026
住友精化	4	4	2,348
日産化学工業	13	11	28,193
ラサ工業	9	10	1,010
クレハ	14	14	5,054
テイカ	3	3	1,578
石原産業	34	33	2,409
日本曹達	13	12	6,060
東ソー	50	49	20,972
トクヤマ	31	30	4,200
セントラル硝子	21	20	10,860
東亜合成	25	11	10,032
大阪ソーダ	8	8	3,312
関東電化工業	5	4	3,508
デンカ	42	38	15,238
信越化学工業	36	32	186,140
日本カーバイド工業	7	8	952
堺化学工業	8	7	2,079

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
エア・ウォーター	18	15	23,745
大陽日酸	26	14	14,184
日本化学工業	7	7	1,351
日本バーカライジング	4	9	9,039
高圧ガス工業	3	3	1,758
四国化成工業	3	3	2,607
戸田工業	4	4	1,268
ステラ ケミファ	1	0.900	2,070
保土谷化学工業	6	6	1,044
日本触媒	16	2	18,333
大日精化工業	8	7	3,094
カネカ	27	25	21,600
三菱瓦斯化学	35	31	17,701
三井化学	92	78	30,888
J S R	19	17	27,124
東京応化工業	4	3	10,966
大阪有機化学工業	2	—	—
三菱ケミカルホールディングス	126	122	74,725
日本合成化学工業	5	4	2,648
ダイセル	28	25	38,935
住友ベークライト	19	17	8,211
積水化学工業	47	41	53,078
日本ゼオン	17	16	11,136
アイカ工業	6	5	12,023
宇部興産	102	98	18,816
積水樹脂	3	2	3,763
タキロン	4	4	2,172
旭有機材工業	7	6	1,212
日立化成	10	9	16,821
ニチバン	3	2	1,248
リケンテクノス	3	3	1,077
大倉工業	5	4	1,088
積水化成成品工業	6	5	1,735
群栄化学工業	5	5	1,335
ミライアル	0.800	1	1,030
ダイキョーニシカワ	0.500	2	3,681
日本化薬	13	12	13,692
カーリットホールディングス	1	2	976
日本精化	1	1	1,081
扶桑化学工業	—	1	1,630
ADEKA	9	9	13,455
日油	17	14	11,088
新日本理化	5	6	979
ハリマ化成グループ	2	1	961

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
花王	54	49	287,721
第一工業製薬	4	4	1,248
三洋化成工業	6	6	4,596
大日本塗料	12	10	1,980
日本ペイントホールディングス	17	14	33,445
関西ペイント	24	20	34,962
中国塗料	6	5	3,565
日本特殊塗料	—	1	1,288
藤倉化成	2	2	1,290
太陽ホールディングス	1	1	4,790
D I C	81	73	17,666
サカタインクス	4	3	4,206
東洋インキSCホールディングス	20	18	8,046
T&K TOKA	0.700	1	1,181
富士フイルムホールディングス	46	41	178,444
資生堂	35	34	84,182
ライオン	23	21	25,704
高砂香料工業	7	1	2,725
マンダム	2	1	7,888
ミルボン	1	1	4,829
ファンケル	4	4	5,842
コーセー	3	3	28,680
シーズ・ホールディングス	1	2	4,234
シーボン	0.400	0.400	960
ポーラ・オルビスホールディングス	2	1	16,340
ノエビアホールディングス	1	1	3,624
アジバンコスメジャパン	—	1	998
エステー	1	1	1,314
アグロ カネショウ	1	0.900	793
コニシ	1	1	3,663
長谷川香料	2	2	3,332
星光PMC	—	1	1,005
小林製薬	3	2	27,132
荒川化学工業	1	1	1,483
メック	1	1	1,177
日本高純度化学	0.600	0.500	1,012
J C U	0.500	0.500	1,645
新田ゼラチン	1	—	—
デクセリアルズ	—	4	4,210
アース製薬	1	1	5,265
イハラケミカル工業	3	2	3,460
北興化学工業	3	3	876
大成ラミック	0.600	0.500	1,507
クミアイ化学工業	4	3	4,362

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
日本農薬	4	4	2,473
アキレス	17	15	2,190
有沢製作所	3	2	1,512
日東電工	15	14	84,346
レック	0.900	0.800	1,006
きもと	4	5	968
藤森工業	1	1	3,908
前澤化成工業	1	1	1,267
JSP	1	1	2,686
エフビコ	1	1	7,040
天馬	1	1	2,669
信越ポリマー	4	3	2,091
東リ	5	5	1,455
ニフコ	4	3	17,710
日本バルカー工業	8	7	1,932
ユニ・チャーム	40	37	89,355
医薬品 (5.8%)			
協和発酵キリン	24	21	35,390
武田薬品工業	75	72	394,357
アステラス製薬	229	204	322,969
大日本住友製薬	14	12	15,944
塩野義製薬	31	26	127,198
田辺三菱製薬	23	21	43,260
わかもと製薬	—	4	1,072
あすか製薬	2	2	2,704
日本新薬	5	4	16,296
ビオフェルミン製薬	—	0.300	1,053
中外製薬	20	18	61,334
科研製薬	7	3	23,040
エーザイ	26	22	157,500
ロート製薬	9	9	18,549
小野薬品工業	9	8	163,634
久光製薬	5	5	28,614
持田製薬	1	1	11,102
参天製薬	7	33	58,705
扶桑薬品工業	7	6	1,512
日本ケミファ	3	3	1,440
ツムラ	6	5	16,199
日医工	4	4	11,743
キッセイ薬品工業	3	3	8,470
生化学工業	3	3	4,676
栄研化学	1	1	3,207
日水製薬	0.700	—	—
鳥居薬品	1	1	2,809

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
JCRファーマ	1	1	2,811
東和薬品	1	0.800	4,176
富士製薬工業	0.600	0.500	1,012
沢井製薬	3	3	23,622
ゼリア新薬工業	4	3	5,139
第一三共	67	61	138,928
キョーリン製薬ホールディングス	5	4	10,422
大幸薬品	0.900	0.900	1,210
ダイト	0.800	0.800	2,164
大塚ホールディングス	40	39	163,173
大正製薬ホールディングス	4	4	39,204
ペプチドリーム	—	2	9,361
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	18	14	1,124
昭和シェル石油	18	18	17,222
コスモ石油	56	—	—
ニチレキ	2	2	1,639
東燃ゼネラル石油	30	28	25,200
ユシロ化学工業	1	1	1,232
ビービー・カストロール	1	0.800	981
富士石油	4	4	1,159
MORESCO	0.600	0.300	441
出光興産	9	9	17,062
JXホールディングス	223	216	96,385
コスモエネルギーホールディングス	—	5	6,534
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	23	11	20,933
東洋ゴム工業	9	8	14,201
ブリヂストン	63	61	246,244
住友ゴム工業	15	17	28,334
藤倉ゴム工業	1	2	996
オカモト	7	6	5,628
フコク	0.800	0.300	255
ニッタ	2	2	5,824
住友理工	3	3	3,876
三ツ星ベルト	5	4	3,492
バンドー化学	7	7	3,017
ガラス・土石製品 (0.8%)			
日東紡績	15	12	4,356
旭硝子	99	97	52,865
日本板硝子	97	89	6,408
日本山村硝子	8	7	1,148
日本電気硝子	39	38	20,216
住友大阪セメント	37	36	14,832

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
太平洋セメント	126	114	25,992
日本ヒューム	2	1	984
日本コンクリート工業	3	4	1,000
三谷セキサン	1	0.900	1,234
アジアパイルホールディングス	2	2	966
東海カーボン	17	16	4,368
日本カーボン	11	9	1,926
東洋炭素	1	1	1,453
ノリタケカンパニーリミテド	11	10	2,430
TOTO	30	13	43,349
日本碍子	25	23	47,265
日本特殊陶業	17	15	34,207
MARUWA	0.600	0.700	1,742
品川リフラクトリーズ	5	5	1,015
黒崎播磨	5	4	936
ヨータイ	3	—	—
東京窯業	6	6	1,002
ニッカトー	3	2	969
フジインコーポレーテッド	2	1	1,864
エーアンドエーマテリアル	11	14	994
ニチアス	9	9	5,652
ニチハ	2	2	3,669
鉄鋼(1.1%)			
新日鐵住金	853	82	154,417
神戸製鋼所	349	336	28,896
中山製鋼所	15	21	1,365
合同製鐵	10	10	1,920
ジェイ エフ イーホールディングス	51	50	64,625
日新製鋼	8	8	9,677
東京製鐵	10	10	7,312
共英製鋼	2	1	3,231
大和工業	4	4	9,228
東京鐵鋼	4	4	1,556
大阪製鐵	1	1	1,899
淀川製鋼所	14	2	6,617
東洋鋼鈑	5	4	1,324
丸一鋼管	6	6	19,062
モリ工業	3	—	—
大同特殊鋼	34	31	12,679
日本冶金工業	15	13	1,514
山陽特殊製鋼	12	11	5,269
愛知製鋼	12	11	4,653
日立金属	21	20	24,912
日本金属	8	10	1,070

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額 千円
大平洋金属	13	13	4,056
新日本電工	12	10	1,699
栗本鐵工所	10	9	1,404
日本鑄鉄管	5	7	938
三菱製鋼	13	13	2,275
日亜鋼業	—	3	969
日本精練	2	2	954
シンニッタン	1	0.600	352
新家工業	7	7	924
非鉄金属(0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	—	4	1,028
日本軽金属ホールディングス	49	41	6,955
三井金属鉱業	55	47	7,520
東邦亜鉛	11	10	2,810
三菱マテリアル	126	114	35,454
住友金属鉱山	56	50	58,025
DOWAホールディングス	24	24	14,448
古河機械金属	31	29	4,640
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	1	2,937
東邦チタニウム	3	3	2,681
UACJ	23	26	5,564
古河電気工業	59	57	13,167
住友電気工業	76	73	98,124
フジクラ	28	25	11,650
昭和電線ホールディングス	23	22	1,210
東京特殊電線	0.800	1	1,028
タツタ電線	3	3	1,250
沖電線	4	—	—
カナレ電気	—	0.600	1,015
平河ヒューテック	0.900	—	—
リョービ	11	11	4,477
アーレスティ	1	2	1,375
アサヒホールディングス	3	2	4,032
金属製品(0.7%)			
稲葉製作所	1	1	1,158
トーカロ	1	1	2,449
アルファ	1	—	—
SUMCO	13	14	10,910
川田テクノロジーズ	0.400	0.300	945
東洋製鐵グループホールディングス	14	13	25,623
ホッカンホールディングス	5	5	1,445
コロナ	1	1	1,000
横河ブリッジホールディングス	3	3	3,703
駒井ハルテック	4	4	896

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
高田機工	5	5	930
三和ホールディングス	19	18	13,301
文化シャッター	6	5	4,615
三協立山	2	2	3,117
アルインコ	—	1	987
東洋シャッター	1	—	—
LIXILグループ	30	25	61,021
日本ファイルコン	2	2	956
ノーリツ	3	3	6,818
長府製作所	2	2	4,980
リンナイ	3	3	33,116
ダイニチ工業	—	0.900	548
日東精工	3	3	906
岡部	4	3	2,576
ジーテクト	1	1	2,226
東プレ	3	3	7,192
高周波熱錬	3	3	2,777
東京製網	14	12	1,668
サンコール	1	2	993
モリテックスチール	3	4	992
パイオラックス	1	0.900	4,707
日本発条	17	17	17,544
中央発條	4	4	1,052
三益半導体工業	1	1	1,333
機械(4.6%)			
日本ドライケミカル	0.500	0.500	1,040
日本製鋼所	29	30	11,400
三浦工業	9	8	14,842
タクマ	7	7	6,090
ツガミ	6	5	1,995
オークマ	13	12	10,344
東芝機械	11	10	3,700
アマダホールディングス	30	26	28,967
アイダエンジニアリング	4	4	4,147
滝澤鉄工所	6	8	992
富士機械製造	6	6	6,462
牧野フライス製作所	10	9	6,498
オーエスジー	9	8	15,869
ダイジェット工業	6	8	1,040
旭ダイヤモンド工業	5	5	4,880
DMG森精機	12	10	9,827
ソディック	—	3	2,583
ディスコ	2	2	24,794
日東工器	1	1	2,278

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
豊和工業	1	1	972
OKK	8	9	1,008
石川製作所	12	14	952
津田駒工業	8	10	980
島精機製作所	2	2	4,461
日阪製作所	2	2	1,851
やまびこ	0.800	3	2,475
ペガサスミシン製造	2	2	980
ナブテスコ	12	9	21,080
三井海洋開発	2	2	3,097
レオン自動機	2	1	968
SMC	6	5	150,507
新川	—	2	955
ホソカワミクロン	3	3	1,584
ユニオンツール	1	0.800	1,944
オイレス工業	2	2	4,264
日精エー・エス・ビー機械	0.600	0.700	1,264
サトーホールディングス	2	2	6,230
日本エアータック	1	1	967
日精樹脂工業	1	1	1,020
ワイエイシイ	1	—	—
小松製作所	100	89	156,038
住友重機械工業	55	53	24,592
日立建機	9	8	13,423
日工	3	3	975
巴工業	0.800	0.700	996
井関農機	21	19	3,420
TOWA	1	1	1,245
丸山製作所	5	6	990
北川鉄工所	9	8	1,648
クボタ	97	87	127,077
荏原実業	0.900	0.800	968
三菱化工機	7	6	1,338
月島機械	3	3	3,524
帝国電機製作所	1	1	926
新東工業	4	4	3,726
澁谷工業	1	1	1,998
アイチコーポレーション	2	2	2,007
小森コーポレーション	4	4	5,288
鶴見製作所	1	1	2,461
住友精密工業	3	3	1,032
酒井重工業	4	—	—
荏原製作所	42	40	17,040
石井鐵工所	—	7	1,022

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
西島製作所	2	1	1,841
北越工業	1	2	1,284
ダイキン工業	28	25	198,348
オルガノ	4	3	1,239
トーヨーカネツ	12	10	2,400
栗田工業	11	11	28,006
椿本チエイン	10	10	6,270
日本コンベヤ	6	—	—
木村化工機	2	—	—
アネスト岩田	3	2	2,502
ダイフク	9	9	16,487
加藤製作所	4	4	1,496
油研工業	5	—	—
タダノ	9	8	7,792
フジテック	5	5	5,982
CKD	5	4	3,826
キトー	2	2	1,634
平和	4	5	12,980
理想科学工業	2	1	3,393
SANKYO	5	4	20,825
日本金銭機械	1	1	1,582
マースエンジニアリング	1	1	1,947
福島工業	1	1	2,490
オーイズミ	1	2	997
ダイコク電機	0.800	0.800	974
竹内製作所	—	2	3,736
アマノ	6	5	8,548
JUKI	14	2	2,241
サンデンホールディングス	12	11	3,201
蛇の目ミシン工業	19	1	966
マックス	3	3	3,570
グローリー	6	6	22,740
新晃工業	1	1	2,035
大和冷機工業	2	2	2,576
セガサミーホールディングス	20	18	22,484
日本ビストンリング	8	0.700	1,052
リケン	8	8	2,840
T P R	2	2	5,569
ツバキ・ナカシマ	—	1	2,500
ホシザキ電機	4	3	32,642
大豊工業	1	1	1,521
日本精工	40	35	37,623
NTN	45	43	15,566
ジェイテクト	20	18	28,830

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
不二越	18	16	6,048
日本トムソン	7	6	2,274
THK	12	11	22,840
ユーシン精機	0.900	0.700	1,206
前澤給装工業	0.900	0.700	958
イーグル工業	2	2	3,084
日本ビラー工業	2	1	1,641
キッツ	8	8	3,995
日立工機	5	4	3,478
マキタ	12	11	77,064
日立造船	15	13	7,093
三菱重工業	323	311	127,478
I H I	139	134	25,460
電気機器(11.4%)			
日清紡ホールディングス	13	9	10,767
イビデン	12	10	14,477
コニカミノルタ	45	43	40,199
ブラザー工業	24	22	27,074
ミネベア	29	28	22,176
日立製作所	463	445	212,087
東芝	406	368	67,528
三菱電機	193	186	210,924
富士電機	54	53	20,246
東洋電機製造	4	3	957
安川電機	22	21	27,797
シンフォニア テクノロジー	13	11	1,584
明電舎	18	16	7,424
オリジン電気	3	4	1,020
山洋電気	4	5	2,500
デンヨー	1	1	1,873
東芝テック	14	12	4,224
芝浦メカトロニクス	4	5	955
マブチモーター	5	5	23,100
日本電産	20	21	154,812
東光高岳	1	1	1,337
ダブル・スコープ	—	0.500	2,012
ダイヘン	11	10	4,540
田淵電機	—	2	961
J V Cケンウッド	14	12	3,763
ミマキエンジニアリング	—	1	429
第一精工	0.700	0.700	899
日新電機	5	4	3,759
大崎電気工業	3	3	2,151
オムロン	20	20	61,400

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		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日東工業	3	2	5,037
I D E C	2	2	2,352
不二電機工業	0.800	—	—
ジーエス・ユアサコーポレーション	37	34	15,232
サクサホールディングス	6	5	955
メルコホールディングス	1	1	2,237
テクノメディカ	—	0.400	894
日本電気	249	240	65,520
富士通	186	168	69,585
沖電気工業	67	76	11,552
岩崎通信機	13	14	1,008
電気興業	5	5	2,755
サンケン電気	10	10	3,030
アイホン	1	1	1,933
ルネサスエレクトロニクス	10	9	5,931
セイコーエプソン	13	26	46,774
ワコム	15	13	6,630
アルバック	3	3	10,496
アクセル	0.900	1	1,032
E I Z O	1	1	5,083
ジャパンディスプレイ	29	32	6,878
日本信号	5	4	3,835
京三製作所	5	4	1,284
能美防災	2	2	2,706
ホーチキ	1	1	1,474
エレコム	0.600	1	2,427
日本無線	4	4	1,068
パナソニック	234	199	168,597
シャープ	163	148	25,604
アンリツ	12	10	6,699
富士通ゼネラル	6	5	7,440
日立国際電気	5	4	5,064
ソニー	124	123	306,521
T D K	11	10	60,270
帝国通信工業	5	—	—
ミツミ電機	6	6	3,214
タムラ製作所	7	7	1,897
アルプス電気	15	14	26,699
パイオニア	28	28	6,905
日本電波工業	1	1	1,080
日本トリム	0.500	0.500	2,167
ローランド ディー. ジー.	0.800	0.900	2,100
フォスター電機	2	2	4,703
クラリオン	10	9	3,159

銘柄	当期末		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SMK	6	5	2,645
ヨコオ	2	—	—
東光	5	4	1,432
ティアック	21	23	966
ホシデン	6	5	3,503
ヒロセ電機	3	2	35,308
日本航空電子工業	6	5	5,755
T O A	2	2	2,125
日立マクセル	2	2	4,718
古野電気	2	2	1,465
ユニデンホールディングス	5	9	1,017
アルパイン	4	4	5,334
スミダコーポレーション	1	1	991
アイコム	1	1	2,196
リオン	—	0.700	1,092
船井電機	1	1	1,733
横河電機	19	17	19,670
新電元工業	7	6	2,166
アズビル	6	5	15,828
日本光電工業	4	7	20,629
チノー	1	1	1,005
共和電業	1	—	—
日本電子材料	—	2	960
堀場製作所	3	3	11,696
アドバンテスト	13	11	12,197
小野測器	1	—	—
エスベック	2	1	2,417
パナソニック デバイスSUNX	1	1	979
キーエンス	4	4	234,320
日置電機	1	0.900	2,015
シスメックス	14	13	89,910
日本マイクロニクス	—	2	2,205
メガチップス	2	1	1,913
OBARA GROUP	1	1	4,565
澤藤電機	5	5	895
コーセル	2	2	2,395
オブテックス	1	1	3,601
千代田インテグレ	0.800	0.900	2,284
レーザーテック	2	2	2,838
スタンレー電気	13	12	31,675
岩崎電気	7	6	1,044
ウシオ電機	11	10	16,726
岡谷電機産業	—	2	962
ヘリオス テクノホールディング	2	2	993

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
日本セラミック	1	1	1,820
日本デジタル研究所	1	1	2,353
古河電池	1	—	—
双信電機	2	3	984
山一電機	2	1	972
図研	1	1	1,511
日本電子	8	7	3,668
カシオ計算機	19	17	36,785
ファナック	20	17	305,016
日本シイエムケイ	4	3	1,482
エンブラス	0.900	0.900	3,433
ローム	9	8	40,291
浜松ホトニクス	8	13	38,148
三井ハイテック	2	2	1,320
新光電気工業	7	6	4,276
京セラ	31	28	141,404
太陽誘電	10	8	9,443
村田製作所	20	18	245,860
ユーシン	2	2	1,515
双葉電子工業	3	3	4,512
北陸電気工業	8	8	992
ニチコン	6	5	4,031
日本ケミコン	16	14	1,988
KOA	2	2	2,073
市光工業	5	5	920
小糸製作所	11	10	51,765
ミツバ	3	3	4,491
スター精密	3	3	4,200
SCREENホールディングス	18	18	14,616
キャノン電子	1	1	2,628
キャノン	111	94	311,234
リコー	57	56	64,071
東京エレクトロン	16	15	110,732
輸送用機器(9.9%)			
トヨタ紡織	6	6	10,754
鬼怒川ゴム工業	4	4	2,096
ユニプレス	3	3	6,418
豊田自動織機	17	15	76,002
モリタホールディングス	3	3	3,856
三櫻工業	2	2	1,240
デンソー	47	43	181,020
東海理化電機製作所	5	5	12,020
三井造船	75	68	9,996
川崎重工業	141	136	41,208

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
名村造船所	5	5	3,510
サノヤスホールディングス	4	4	979
日本車輛製造	7	7	1,701
ニチユ三菱フォークリフト	2	2	948
近畿車輛	3	3	894
日産自動車	270	245	240,001
いすゞ自動車	60	50	57,557
トヨタ自動車	265	217	1,298,856
日野自動車	27	24	29,431
三菱自動車工業	70	69	56,063
エフテック	1	—	—
レシップホールディングス	1	1	990
GMB	—	1	991
ファルテック	—	0.700	926
武蔵精密工業	2	1	3,999
日産車体	8	8	9,630
新明和工業	8	8	6,136
極東開発工業	3	3	3,612
日信工業	3	3	5,623
トピー工業	16	14	2,996
ティラド	7	7	1,176
曙ブレーキ工業	8	8	2,112
タチエス	3	2	4,186
NOK	9	8	15,540
フタバ産業	5	5	2,453
KYB	22	20	5,880
シロキ工業	4	4	1,324
大同メタル工業	2	2	1,869
プレス工業	10	9	3,636
カルソニックカンセイ	15	13	10,582
太平洋工業	3	3	3,903
ケーヒン	4	4	6,498
河西工業	2	2	2,593
アイシン精機	17	17	78,848
マツダ	57	55	89,281
ダイハツ工業	23	20	32,988
今仙電機製作所	1	1	1,625
本田技研工業	173	157	459,517
スズキ	40	36	102,546
富士重工業	65	55	203,853
ヤマハ発動機	29	24	44,040
ショーワ	4	4	4,167
TBK	2	2	996
エクセディ	2	2	5,452

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
豊田合成	6	6	6	14,080
愛三工業	3	3	3	2,749
ヨロズ	1	1	1	3,475
エフ・シー・シー	2	2	2	5,394
シマノ	8	7	7	129,290
タカタ	3	3	3	1,622
テイ・エス テック	4	4	4	10,467
ジャムコ	—	0.800	—	1,991
精密機器(1.6%)				
テルモ	29	26	26	104,118
クリエートメディック	1	1	1	964
日機装	6	6	6	5,421
島津製作所	23	22	22	39,314
JMS	4	—	—	—
モリテックス	—	3	3	953
長野計器	—	1	1	956
ブイ・テクノロジー	0.500	0.400	0.400	1,470
東京計器	7	6	6	924
オーバル	3	4	4	989
東京精密	3	3	3	7,279
マニー	0.500	1	1	2,659
ニコン	36	32	32	55,159
トプコン	5	5	5	6,991
オリンパス	28	26	26	106,600
理研計器	1	1	1	1,461
タムロン	1	1	1	2,405
HOYA	45	40	40	168,490
ノーリツ鋼機	1	1	1	501
エー・アンド・デイ	2	2	2	945
シチズンホールディングス	23	21	21	13,459
リズム時計工業	8	8	8	1,136
大研医器	1	1	1	1,260
メニコン	—	0.900	—	2,754
松風	0.900	0.900	0.900	1,179
セイコーホールディングス	14	11	11	4,378
ニプロ	12	13	13	13,975
その他製品(1.6%)				
スノーピーク	—	0.300	—	1,036
パラマウントベッドホールディングス	2	1	1	6,741
SHO-BI	3	2	2	1,027
ニホンフラッシュ	—	1	1	980
前田工織	1	1	1	1,865
永大産業	3	—	—	—
アートネイチャー	1	1	1	1,344

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
ダンロップスポーツ	1	1	1	1,027
バンダイナムコホールディングス	21	18	18	42,444
共立印刷	4	3	3	958
SHOEI	—	0.800	—	1,456
フランスベッドホールディングス	14	2	2	2,313
パイロットコーポレーション	1	3	3	11,895
萩原工業	—	0.500	—	988
トッパン・フォームズ	3	3	3	4,107
フジールインターナショナル	2	2	2	7,665
タカラトミー	6	5	5	4,805
廣済堂	2	3	3	954
タカノ	2	—	—	—
プロネクス	2	1	1	1,779
ホクシン	9	9	9	972
ウッドワン	4	4	4	968
大建工業	8	7	7	1,673
凸版印刷	54	49	49	47,628
大日本印刷	59	52	52	51,480
図書印刷	4	3	3	1,383
共同印刷	6	6	6	2,028
日本写真印刷	3	2	2	5,034
光村印刷	4	5	5	1,025
宝印刷	—	0.800	—	1,007
アシックス	19	16	16	33,121
ツツミ	1	0.900	0.900	2,204
小松ウオール工業	0.600	0.600	0.600	1,000
ヤマハ	14	12	12	40,704
河合楽器製作所	0.700	0.600	0.600	1,138
クリナップ	1	2	2	1,446
ビジョン	3	9	9	26,106
キングジム	1	1	1	1,104
リンテック	4	4	4	8,925
イトーキ	4	3	3	2,578
任天堂	11	10	10	178,146
三菱鉛筆	1	1	1	5,668
タカラスタンダード	8	7	7	6,776
コクヨ	10	9	9	10,073
グロープライド	9	0.800	0.800	1,138
岡村製作所	7	6	6	6,057
美津濃	10	9	9	4,527
アデランス	2	3	3	1,695
電気・ガス業(2.2%)				
東京電力	163	148	148	82,936
中部電力	58	53	53	76,281

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
関西電力	78	71	88,003
中国電力	26	24	36,583
北陸電力	18	17	28,044
東北電力	48	43	63,568
四国電力	17	15	25,512
九州電力	42	38	41,919
北海道電力	18	16	15,762
沖縄電力	1	1	5,283
電源開発	13	14	51,405
イーレックス	—	0.300	499
東京瓦斯	234	195	105,475
大阪瓦斯	199	181	79,929
東邦瓦斯	49	44	34,980
北海道瓦斯	4	4	1,096
広島ガス	—	3	1,215
西部瓦斯	22	20	5,080
静岡ガス	5	5	3,620
メタウォーター	0.900	1	2,622
陸運業(4.9%)			
SBSホールディングス	1	1	1,098
東武鉄道	103	93	55,800
相鉄ホールディングス	33	30	21,030
東京急行電鉄	105	102	97,308
京浜急行電鉄	53	48	48,720
小田急電鉄	62	56	76,664
京王電鉄	54	49	52,773
京成電鉄	29	26	42,978
富士急行	5	5	6,165
新京成電鉄	—	2	838
東日本旅客鉄道	35	31	317,500
西日本旅客鉄道	18	16	114,475
東海旅客鉄道	17	15	323,778
西武ホールディングス	15	13	32,734
鴻池運輸	1	2	3,185
西日本鉄道	25	23	19,274
ハマキョウレックス	0.600	1	2,376
サカイ引越センター	0.300	0.700	1,871
近鉄グループホールディングス	194	176	86,240
阪急阪神ホールディングス	129	117	84,474
南海電気鉄道	43	39	26,208
京阪電気鉄道	43	39	30,771
神戸電鉄	5	4	1,420
名古屋鉄道	70	64	35,456
山陽電気鉄道	7	6	2,730

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本通運	76	68	35,088
ヤマトホールディングス	33	32	76,437
山九	23	23	12,144
丸全昭和運輸	6	6	2,394
センコー	8	8	5,688
トナミホールディングス	4	4	1,032
ニッコンホールディングス	6	5	11,166
日本石油輸送	5	4	960
福山通運	12	11	5,874
セイノーホールディングス	15	12	14,855
神奈川中央交通	2	2	1,370
日立物流	4	3	6,231
C&Fロジホールディングス	—	1	1,441
海運業(0.2%)			
日本郵船	163	157	33,441
商船三井	102	86	17,974
川崎汽船	85	77	14,553
NSユナイテッド海運	9	8	1,216
飯野海運	10	9	3,913
乾汽船	1	1	1,075
空運業(0.7%)			
日本航空	36	33	140,012
ANAホールディングス	379	324	105,591
バスコ	1	2	822
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.600	0.500	3,170
日新	7	7	1,925
三菱倉庫	13	12	17,916
三井倉庫ホールディングス	11	10	2,730
住友倉庫	14	13	7,150
澁澤倉庫	5	5	1,380
日本トランスシティ	4	4	1,412
ケイヒン	6	7	1,015
中央倉庫	—	1	1,003
安田倉庫	1	1	975
東洋埠頭	6	7	1,008
宇徳	1	3	939
上組	23	21	22,050
サンリツ	2	—	—
キューソー流通システム	0.900	0.500	1,037
郵船ロジスティクス	1	1	1,926
近鉄エクスプレス	1	3	4,631
エーアイティー	1	1	1,014
内外トランスライン	—	0.700	627

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		
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
情報・通信業(8.3%)			
NECネットエスアイ	2	2	3,819
システナ	1	1	2,575
デジタルアーツ	—	0.800	1,548
新日鉄住金ソリューションズ	1	2	5,710
コア	1	0.800	1,052
I Tホールディングス	6	5	14,312
電算システム	—	0.700	1,069
グリー	11	10	5,680
コーエーテコモホールディングス	4	4	6,883
三菱総合研究所	0.700	0.700	2,436
電算	0.500	0.400	958
AGS	1	1	978
ファインデックス	0.300	1	1,115
ヒト・コミュニケーションズ	—	0.600	1,039
KL a b	2	2	1,333
ホールドウィング・ピットルホールディングス	1	1	1,067
ネクソン	18	16	27,406
アイスタイル	—	2	2,022
エムアップ	1	2	999
エイチーム	0.200	0.700	1,001
e n i s h	0.900	—	—
コロブラ	3	4	9,499
ブロードリーフ	1	1	2,304
ハーツユナイテッドグループ	0.700	0.500	957
バイキューブ	—	0.800	1,029
ティーガイア	1	1	2,046
テクマトリックス	—	0.700	1,040
邦ホ・オンライン・エンターテイメント	—	30	8,548
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	9,165
ザッパラス	1	2	980
インターネットイニシアティブ	3	2	6,070
さくらインターネット	—	0.800	1,427
ビットアイル	2	—	—
SRAホールディングス	1	1	2,256
パイブドビッツ	0.600	—	—
g u m i	1	1	1,152
パイブドHD	—	0.900	968
パソニック インフォメーションシステムズ	0.400	—	—
フェイス	0.900	0.800	954
野村総合研究所	10	12	46,524
サイバネットシステム	2	1	1,276
インタージホールディングス	1	0.900	1,283
東邦システムサイエンス	2	1	986

銘柄	当 期 末		
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
クレスコ	0.700	0.600	1,054
フジ・メディア・ホールディングス	19	17	23,520
オービック	6	5	32,863
ジャストシステム	2	3	2,638
TDCソフトウェアエンジニアリング	1	0.900	938
ヤフー	136	123	53,475
トレンドマイクロ	10	8	32,424
インフォメーション・ディベロプメント	—	1	968
日本オラクル	3	2	15,064
アルファシステムズ	0.700	0.600	1,039
フューチャーアーキテクト	2	2	1,684
CAC Holdings	1	1	1,012
ソフトバンク・テクノロジー	1	0.800	1,040
トーセ	1	1	974
オービックビジネスコンサルタント	1	0.900	4,059
伊藤忠テクノソリューションズ	2	3	8,876
アイティフォー	2	2	1,001
東計電算	0.700	0.500	962
大塚商会	5	4	25,162
サイボウズ	3	3	999
電通国際情報サービス	1	1	2,313
イーエムシステムズ	0.700	0.400	1,027
ウェザーニューズ	0.600	0.600	2,127
C I J	2	2	1,005
東洋ビジネスエンジニアリング	0.900	0.700	919
日本エンタープライズ	3	3	893
WOWOW	0.500	0.800	2,051
イマジカ・ロボットホールディングス	2	2	1,011
ネットワンシステムズ	7	7	4,410
アルゴグラフィックス	0.800	0.800	1,348
マーベラス	3	2	2,380
エイベックス・グループ・ホールディングス	3	3	4,166
日本ユニシス	5	4	6,696
兼松エレクトロニクス	1	1	2,017
東京放送ホールディングス	11	10	18,148
日本テレビホールディングス	17	15	31,023
朝日放送	1	1	1,162
テレビ朝日ホールディングス	5	4	9,512
スカパーJSATホールディングス	14	13	8,947
テレビ東京ホールディングス	1	1	2,955
コネクシオ	1	1	1,615
日本通信	—	9	1,556
日本電信電話	74	133	640,958
KDD I	64	175	527,576

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
光通信	1	2		16,338
NTTドコモ	156	132		351,121
エムティーアイ	—	2		1,617
GMOインターネット	6	6		7,795
カドカワ	4	5		9,784
学研ホールディングス	6	6		1,422
ゼンリン	2	2		4,259
昭文社	1	1		1,001
インプレスホールディングス	9	7		975
アイネット	1	1		1,090
松竹	13	11		11,220
東宝	13	12		34,636
東映	7	6		5,274
AOI Pro.	—	1		1,004
エヌ・ティ・ティ・データ	11	10		59,572
DTS	2	1		3,969
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6	7		21,316
シーイーシー	1	1		1,202
カプコン	4	4		10,577
ジャステック	—	1		1,005
SCSK	4	4		17,958
アイネス	2	2		2,613
TKC	1	1		5,032
富士ソフト	2	2		6,071
NSD	4	3		6,134
コナミホールディングス	7	7		22,183
福井コンピュータホールディングス	1	1		1,008
JBCCホールディングス	1	1		954
ミロク情報サービス	—	1		1,192
ソフトバンクグループ	100	97		497,272
卸売業(4.3%)				
高千穂交易	1	1		958
伊藤忠食品	0.500	0.500		2,092
エレマテック	0.900	0.800		1,719
JALUX	0.600	0.600		1,228
あらた	4	0.800		1,736
トーマンデバイス	0.700	0.600		1,033
東京エレクトロンデバイス	0.800	0.600		901
フィールズ	—	1		1,906
双日	127	108		24,435
アルフレッサホールディングス	22	21		43,291
横浜冷凍	4	4		4,390
山下医科器械	0.700	0.600		955
ラサ商事	2	1		960

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アルコニックス	1	1		1,432
神戸物産	0.600	1		2,611
あいホールディングス	3	3		8,658
ダイワボウホールディングス	17	16		3,200
マクニカ・富士エレクトロニクス	—	3		4,110
バイタルゲ-エスケ-ホールディングス	3	3		2,871
UKCホールディングス	1	1		2,271
OCHIホールディングス	0.800	1		1,007
TOKAIホールディングス	9	7		4,309
三洋貿易	1	0.900		1,161
シップヘルスケアホールディングス	3	3		9,768
協栄産業	—	8		1,000
小野建	1	1		1,441
佐鳥電機	1	1		964
エコートレーディング	1	1		968
伯東	1	1		1,210
コンドーテック	1	1		1,071
ナガイレーベン	2	2		4,982
三菱食品	2	1		5,639
松田産業	1	1		1,586
第一興商	—	3		13,950
メディカルホールディングス	19	17		29,910
アドヴァン	1	1		1,886
アズワン	1	1		5,102
尾家産業	1	1		1,015
シモジマ	1	1		1,297
ドウシシャ	2	2		4,284
小津産業	0.600	0.500		1,079
高速	1	1		941
黒田電気	3	3		5,193
丸文	1	1		1,057
ハビネット	1	1		1,489
橋本総業	—	0.600		909
エクセル	0.900	0.800		1,035
マルカキカイ	0.600	0.700		970
ガリバーインターナショナル	5	4		5,133
日本エム・ディ・エム	2	—		—
進和	1	1		1,408
エスケイジャパン	5	2		992
ダイトエレクトロン	1	—		—
シークス	1	1		3,116
田中商事	—	1		992
オーハシテクニカ	1	1		1,258
マクニカ	1	—		—

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
白銅	1	1	1,012
伊藤忠商事	159	135	186,373
丸紅	166	169	99,114
高島	5	—	—
長瀬産業	11	10	12,168
蝶理	1	1	1,570
豊田通商	21	19	44,736
三共生興	3	2	1,011
兼松	38	37	5,587
ツカモトコーポレーション	9	9	945
三井物産	161	155	204,565
日本紙バルブ商事	10	9	2,844
日立ハイテクノロジーズ	6	6	18,180
カメイ	2	2	2,162
東都水産	6	6	1,038
スターゼン	7	0.600	1,887
山善	7	6	5,986
椿本興業	4	3	858
住友商事	112	108	123,310
内田洋行	5	4	1,560
三菱商事	145	129	242,049
第一実業	5	4	1,824
キャノンマーケティングジャパン	5	4	9,535
西華産業	6	6	1,302
佐藤商事	1	1	933
菱洋エレクトロ	2	2	2,190
東京産業	2	2	982
ユアサ商事	1	1	3,907
神鋼商事	5	5	990
小林産業	4	5	965
阪和興業	19	17	7,395
カナデン	2	1	1,297
菱電商事	3	3	1,872
フルサト工業	1	0.900	1,406
岩谷産業	21	20	12,180
すてきなイスグループ	8	7	924
昭光通商	8	13	975
イワキ	5	5	925
三愛石油	5	4	3,476
稲畑産業	4	4	4,895
ワキタ	4	3	3,052
東邦ホールディングス	6	5	12,798
サンゲツ	3	6	12,090
ミツウロコグループホールディングス	3	2	1,559

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シナネンホールディングス	4	4	1,760
伊藤忠エネクス	4	4	3,594
サンリオ	5	5	11,130
サンワテクノス	1	1	1,014
リョーサン	3	2	7,616
新光商事	2	2	2,060
トーホー	4	0.800	1,769
三信電気	2	2	2,008
東陽テクニカ	2	2	2,715
モスフードサービス	2	2	7,141
加賀電子	1	1	2,065
ソーダニッカ	2	2	990
立花エレテック	1	1	1,418
PALTA C	3	2	4,869
三谷産業	—	3	992
ヤマタネ	9	8	1,280
日鉄住金物産	12	11	3,696
トラスコ中山	2	2	7,820
オートバックスセブン	7	6	12,837
加藤産業	2	2	7,349
イノテック	2	2	968
イエローハット	1	1	3,040
富士エレクトロニクス	1	—	—
J Kホールディングス	2	2	957
日伝	0.800	0.700	1,971
北沢産業	6	6	988
杉本商事	1	1	1,260
因幡電機産業	2	2	8,268
バイテックホールディングス	1	1	950
ミスミグループ本社	7	19	29,818
江守グループホールディングス	1	—	—
タキヒヨー	3	3	1,380
スズケン	7	7	28,977
ジェコス	1	1	1,074
ルネサスイーストン	—	2	984
小売業(4.8%)			
ローソン	7	6	59,605
サンエー	1	1	5,766
カワチ薬品	1	1	2,516
イービーシー・マート	2	2	14,872
ハードオフコーポレーション	—	0.800	1,304
アスクール	2	2	7,171
ゲオホールディングス	3	3	5,553
アダストリア	1	1	9,472

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
シー・ガイ・エス・ベイエリア	—	12	996
くらコーポレーション	1	1	5,200
キャンドウ	0.900	0.900	1,314
パル	1	1	2,551
エディオン	8	7	6,248
サーラコーポレーション	2	—	—
ワッツ	1	1	937
ハローズ	—	0.500	1,328
あみやき亭	0.300	0.300	1,297
ひらまつ	2	2	1,567
ゲンキー	0.200	0.400	1,120
大黒天物産	0.500	0.400	1,884
ハニーズ	1	1	1,818
ファーマライズホールディングス	—	2	986
アルペン	1	1	2,665
クオール	1	1	2,419
ジェイアイエヌ	1	1	5,694
ビックカメラ	8	8	7,912
DCMホールディングス	9	8	7,140
Monotaro	3	6	14,713
きちり	—	0.100	65
アーランドサービス	0.300	0.500	1,428
J. フロント リテイリング	24	21	29,146
ドール・プレスホールディングス	3	3	5,394
マツモトキヨシホールディングス	4	3	18,648
ブロンコビリー	0.300	0.700	1,862
スタートトゥデイ	5	5	17,628
物語コーポレーション	0.500	0.500	2,610
ココカラファイン	2	1	7,893
三越伊勢丹ホールディングス	37	34	45,104
ウエルシアホールディングス	1	1	8,415
クリエイトSDホールディングス	0.900	2	6,045
エー・ピーカンパニー	0.600	—	—
チムニー	0.500	0.400	1,086
ジョイフル本田	1	2	6,188
キリン堂ホールディングス	—	1	1,007
すかいらーく	7	5	7,950
マインスト・スーパーマーケットホールディングス	—	5	5,392
ブックオフコーポレーション	1	1	995
あさひ	1	1	1,691
日本調剤	—	0.400	1,442
コスモス薬品	1	0.900	14,994
トーエル	1	—	—
一六堂	—	2	962

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セブン&アイ・ホールディングス	79	72	328,487
薬王堂	—	0.400	1,032
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1	1	4,417
ツルハホールディングス	4	4	38,080
サンマルクホールディングス	0.700	1	4,054
フェリシモ	1	—	—
トリドール	2	2	4,729
クスリのアオキ	0.700	1	7,335
メディカルシステムネットワーク	—	2	977
総合メディカル	0.500	0.800	2,756
はるやま商事	1	1	980
カッパ・クリエイト	3	2	2,702
ライトオン	—	1	1,895
良品計画	2	2	47,700
三城ホールディングス	2	2	979
コナカ	2	2	1,066
ハウス オブ ローゼ	0.800	0.700	1,022
G-7ホールディングス	1	—	—
イオン北海道	1	1	984
コジマ	—	4	980
ヒマラヤ	1	1	1,006
コーナン商事	2	2	3,712
エコス	—	0.800	944
ワタミ	2	2	2,152
マルシェ	1	1	1,003
ドンキホーテホールディングス	6	11	41,125
西松屋チェーン	3	3	3,304
ゼンショーホールディングス	9	8	12,397
幸楽苑ホールディングス	1	1	1,719
ハークスレイ	1	—	—
サイゼリヤ	2	2	6,437
VTホールディングス	—	5	3,300
ユナイテッドアローズ	2	2	12,700
ハイデイ日高	1	1	4,543
京都きもの友禅	1	1	1,010
コロワイド	6	5	9,861
ピーシーデポコーポレーション	—	1	1,439
荳番屋	0.900	0.800	4,736
トップカルチャー	2	2	959
PLANT	0.900	0.800	930
スギホールディングス	3	3	16,833
スクロール	4	2	1,050
ヨンドシーホールディングス	1	1	3,168
ファミリーマート	6	5	29,468

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
木曽路	2	2	4,680
サトレストラシテムズ	1	2	1,560
千趣会	3	3	2,397
ケーヨー	3	2	1,458
上新電機	4	4	3,412
日本瓦斯	3	2	4,160
ベスト電器	7	8	996
マルエツ	5	—	—
ロイヤルホールディングス	3	2	5,849
東天紅	6	7	910
いなげや	2	1	2,337
島忠	4	4	11,110
チヨダ	2	2	5,632
ライフコーポレーション	1	1	2,569
カスミ	3	—	—
リンガーハット	1	1	3,857
MR MAX	4	3	997
テンアライド	3	2	980
AOKIホールディングス	4	3	4,828
オークワ	3	3	3,015
コメリ	3	2	5,867
青山商事	4	3	13,777
しまむら	2	2	24,120
CFSコーポレーション	1	—	—
高島屋	28	25	23,000
松屋	3	3	2,975
エイチ・ツー・オーリテイリング	9	8	16,280
近鉄百貨店	7	7	2,142
ニッセンホールディングス	4	6	963
パルコ	1	1	1,472
丸井グループ	22	21	31,650
アクシアル リテイリング	1	1	4,381
イオン	78	70	101,067
ユニグループ・ホールディングス	18	16	12,358
イズミ	4	3	14,705
平和堂	3	3	7,332
フジ	2	1	3,906
ヤオコー	1	2	8,250
ゼビオホールディングス	2	2	4,034
ケーズホールディングス	4	3	12,528
Olympicグループ	1	1	963
アインホールディングス	2	2	10,384
元気寿司	0.600	0.500	1,071
ヤマダ電機	75	52	27,143

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アークランドサカモト	1	2	3,001
ニトリホールディングス	8	7	62,308
グルメ杵屋	1	1	996
愛眼	4	4	982
吉野家ホールディングス	5	6	9,145
松屋フーズ	0.900	0.800	2,249
サガミチェーン	2	2	2,796
関西スーパーマーケット	1	1	1,082
王将フードサービス	1	1	5,083
ブレナス	2	1	3,710
ミニストップ	1	1	2,650
アークス	3	3	7,356
パローホールディングス	4	3	8,942
藤久	0.700	0.600	1,027
ベルク	0.800	0.800	3,052
大庄	1	0.800	1,145
ファーストリテイリング	3	3	111,160
サンドラッグ	4	3	27,216
サックスパー ホールディングス	1	1	2,396
やまや	—	0.100	187
ベルーナ	4	4	2,167
銀行業(7.2%)			
島根銀行	0.800	0.800	924
じもとホールディングス	13	12	1,798
足利ホールディングス	12	12	3,981
東京TYフィナンシャルグループ	2	2	6,232
九州フィナンシャルグループ	—	26	17,397
ゆうちょ銀行	—	33	39,422
新生銀行	181	149	21,009
あおぞら銀行	128	109	38,913
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,525	1,382	659,914
りそなホールディングス	222	201	78,543
三井住友トラスト・ホールディングス	420	360	116,820
三井住友フィナンシャルグループ	143	138	417,588
第四銀行	24	22	8,096
北越銀行	21	19	3,458
西日本シティ銀行	67	56	11,200
千葉銀行	74	66	35,508
横浜銀行	131	116	58,487
常陽銀行	69	62	23,870
群馬銀行	45	38	18,506
武蔵野銀行	3	2	7,813
千葉興業銀行	3	4	2,100
筑波銀行	7	7	2,008

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
七十七銀行	32	27	10,854
青森銀行	15	13	3,835
秋田銀行	13	11	2,948
山形銀行	11	10	3,770
岩手銀行	1	1	4,446
東邦銀行	17	15	4,845
東北銀行	10	9	1,260
みちのく銀行	9	9	1,494
ふくおかフィナンシャルグループ	77	75	26,400
静岡銀行	56	51	41,922
十六銀行	24	22	7,942
スルガ銀行	20	16	29,848
八十二銀行	34	31	15,624
山梨中央銀行	12	11	4,312
大垣共立銀行	24	23	7,889
福井銀行	16	15	2,790
北國銀行	21	19	5,263
清水銀行	0.600	0.600	1,264
富山銀行	—	0.300	810
滋賀銀行	19	16	7,168
南都銀行	18	17	5,117
百五銀行	18	15	5,895
京都銀行	36	33	23,991
紀陽銀行	7	6	8,051
三重銀行	8	8	1,528
ほくほくフィナンシャルグループ	129	117	19,539
広島銀行	56	51	20,910
山陰合同銀行	12	10	6,780
中国銀行	13	12	14,347
鳥取銀行	6	6	954
伊予銀行	20	18	14,204
百十四銀行	21	19	6,004
四国銀行	15	13	2,691
阿波銀行	16	14	7,028
鹿児島銀行	13	—	—
大分銀行	12	10	3,390
宮崎銀行	13	11	2,860
肥後銀行	16	—	—
佐賀銀行	12	10	2,000
十八銀行	12	11	2,530
沖縄銀行	1	1	4,837
琉球銀行	3	3	3,965
セブン銀行	64	64	31,201
みずほフィナンシャルグループ	2,632	2,427	403,709

銘柄	当期末		
	期首(前期末) 株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
山口フィナンシャルグループ	19	16	16,800
長野銀行	6	6	1,056
名古屋銀行	17	14	4,984
北洋銀行	28	26	7,176
愛知銀行	0.700	0.600	2,625
第三銀行	11	10	1,400
中京銀行	8	7	1,344
東日本銀行	8	8	2,168
大光銀行	7	6	1,140
愛媛銀行	11	10	2,080
トマト銀行	8	7	1,022
みなと銀行	17	16	2,432
京葉銀行	16	14	5,880
関西アーバン銀行	2	2	2,508
栃木銀行	10	9	3,762
北日本銀行	0.600	0.500	1,304
東和銀行	26	24	1,944
福島銀行	23	21	1,491
大東銀行	12	10	1,770
トモニホールディングス	14	13	4,369
フィデアホールディングス	10	10	1,823
池田泉州ホールディングス	15	18	7,082
証券、商品先物取引業(1.1%)			
FPG	1	5	4,880
SBIホールディングス	22	20	21,031
ジャフコ	2	2	9,207
大和証券グループ本社	178	161	108,159
野村ホールディングス	388	331	163,843
岡三証券グループ	16	15	7,980
丸三証券	6	5	6,114
東洋証券	8	7	2,023
麒麟フィナンシャル・ホールディングス	21	19	10,355
光世証券	5	4	552
水戸証券	5	5	1,711
いちよし証券	4	3	4,204
松井証券	9	8	8,474
だいきょう証券ビジネス	1	—	—
マネックスグループ	22	20	5,744
カブドットコム証券	8	15	5,049
極東証券	2	2	3,052
岩井コスモホールディングス	1	1	1,688
藍澤証券	—	2	1,353
マネースクウェアHD	0.900	1	995
マネーパートナーズグループ	3	3	985

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	
保険業(2.4%)				
かんぽ生命保険	—	5	12,598	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	42	38	117,772	
アニコムホールディングス	0.800	1	2,742	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	60	51	153,058	
ソニーフィナンシャルホールディングス	18	16	25,608	
第一生命保険	121	110	144,182	
東京海上ホールディングス	78	69	264,611	
T&Dホールディングス	69	62	70,116	
その他金融業(1.3%)				
全国保証	4	4	14,895	
クレディセゾン	15	13	24,287	
芙蓉総合リース	2	2	9,210	
興銀リース	3	3	6,032	
東京センチュリーリース	4	4	14,960	
日本証券金融	9	7	3,640	
アイフル	31	28	8,467	
ポケットカード	0.900	2	968	
リコーリース	1	1	4,438	
イオンフィナンシャルサービス	12	11	28,250	
アコム	38	34	16,192	
ジャックス	10	10	3,750	
オリエントコーポレーション	43	74	14,229	
日立キャピタル	3	4	9,721	
アプラスフィナンシャル	9	11	957	
オリックス	134	122	174,399	
三菱UFJリース	48	43	21,019	
日本取引所グループ	27	50	87,487	
イー・ギョランティ	0.700	0.600	1,296	
アサックス	0.700	—	—	
NECキャピタルソリューション	0.800	0.700	1,082	
不動産業(2.9%)				
いちごグループホールディングス	—	14	5,162	
日本駐車場開発	20	18	2,237	
ヒューリック	32	35	35,505	
野村不動産ホールディングス	11	11	22,758	
三重交通グループホールディングス	—	3	1,367	
日本商業開発	—	0.600	1,048	
プレサンスコーポレーション	0.600	0.600	2,127	
ユニゾホールディングス	0.800	1	4,312	
日本管理センター	1	1	2,086	
サンセイランディック	—	1	1,017	
フージャースホールディングス	2	2	1,024	
オープンハウス	1	2	5,265	

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	
東急不動産ホールディングス	49	41	29,481	
飯田グループホールディングス	12	16	32,832	
パーク24	9	8	25,604	
バラカ	—	0.800	1,064	
三井不動産	101	91	241,332	
三菱地所	141	128	274,496	
平和不動産	3	3	3,907	
東京建物	41	18	25,080	
ダイビル	4	4	4,096	
京阪神ビルディング	3	2	1,655	
住友不動産	46	41	126,485	
大京	30	33	6,006	
テーオーシー	6	6	6,036	
東京楽天地	3	3	1,419	
レオパレス21	20	20	13,560	
スターツコーポレーション	2	2	4,614	
フジ住宅	2	2	1,491	
空港施設	2	2	1,047	
明和地所	2	1	966	
住友不動産販売	1	1	2,775	
ゴールドクレスト	1	1	2,262	
日本エスリード	1	0.900	933	
日神不動産	2	2	969	
タカラレーベン	8	7	4,522	
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,015	
イオンモール	12	11	17,796	
ファースト住建	—	0.800	1,028	
トーセイ	2	2	1,690	
穴吹興産	5	4	984	
エヌ・ティ・ティ都市開発	11	10	11,836	
サンフロンティア不動産	2	2	2,110	
エフ・ジュー・ネクスト	2	2	994	
ランドビジネス	3	3	1,001	
グランディハウス	4	2	946	
日本空港ビルデング	6	5	22,055	
サービス業(3.8%)				
日本工営	7	6	2,160	
ネクスト	2	5	5,356	
日本M&Aセンター	3	2	14,308	
ノバレーゼ	1	1	991	
アコーディア・ゴルフ	7	7	7,905	
タケエイ	2	1	1,163	
トラスト・テック	—	0.400	955	
パソナグループ	1	1	1,011	

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
リンクアンドモチベーション	7	8	8	1,029
GCAサヴィアン	1	1	1	1,403
エス・エム・エス	2	2	2	4,144
テンポホールディングス	4	12	12	18,662
リニカル	1	1	1	1,707
クックパッド	1	4	4	8,265
アイ・ケイ・ケイ	—	1	1	958
学情	—	1	1	1,019
スタジオアリス	0.900	0.800	0.800	1,785
シミックホールディングス	0.800	0.800	0.800	1,246
NJS	—	0.800	0.800	923
総合警備保障	6	6	6	35,319
カカコム	13	13	13	26,109
ルネサンス	1	0.900	0.900	1,084
ディップ	0.400	2	2	4,358
オプトホールディング	2	1	1	997
新日本科学	1	2	2	985
ツクイ	2	2	2	2,941
総合臨床ホールディングス	2	—	—	—
キャリアデザインセンター	1	1	1	994
エムスリー	17	15	15	42,644
ツカダ・グローバルホールディング	1	1	1	1,009
アウトソーシング	0.800	0.800	0.800	2,324
ウェルネット	0.500	0.700	0.700	2,201
ディー・エヌ・エー	9	8	8	14,309
博報堂DYホールディングス	27	25	25	31,903
ぐるなび	2	2	2	5,281
エスアールジータカミヤ	1	3	3	954
一休	1	—	—	—
ジャパンベストレスキューシステム	4	4	4	975
ファンコミュニケーションズ	3	4	4	2,738
ジェイコムホールディングス	1	—	—	—
PGMホールディングス	2	—	—	—
WDBホールディングス	—	1	1	959
ティア	2	1	1	1,000
バリューコマース	2	2	2	991
インフォマート	—	2	2	2,490
J Pホールディングス	5	4	4	1,161
E P Sホールディングス	2	2	2	2,714
プレステージ・インターナショナル	1	1	1	1,810
アミューズ	0.600	0.500	0.500	2,055
ドリームインキュベータ	0.700	0.600	0.600	1,299
TAC	5	5	5	966
ケネディクス	28	24	24	11,368

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
電通	22	20	20	112,462
テイクアンドギヴ・ニーズ	1	2	2	968
びあ	0.600	0.500	0.500	1,081
イオンファンタジー	0.800	0.600	0.600	1,275
みらかホールディングス	5	4	4	22,372
アルプス技研	0.800	0.700	0.700	1,533
ダイオーズ	1	1	1	1,005
日本空調サービス	1	0.900	0.900	999
オリエンタルランド	5	19	19	157,797
ダスキン	5	5	5	11,232
明光ネットワークジャパン	2	2	2	2,377
ファルコホールディングス	1	0.800	0.800	1,013
秀英予備校	—	1	1	943
田谷	1	—	—	—
ラウンドワン	5	5	5	3,938
リゾートトラスト	7	7	7	19,098
ビー・エム・エル	1	1	1	4,504
りらいあコミュニケーションズ	3	3	3	2,946
リソー教育	—	3	3	1,047
ユー・エス・エス	24	22	22	37,989
サイバーエージェント	3	4	4	23,085
楽天	87	85	85	85,265
セントラルスポーツ	0.700	0.600	0.600	1,363
フルキャストホールディングス	—	1	1	1,133
リゾートソリューション	5	—	—	—
テクノプロ・ホールディングス	2	3	3	9,210
リブセンス	1	0.700	0.700	272
ジャパンマテリアル	0.800	0.800	0.800	1,772
ベクトル	—	0.600	0.600	1,552
アサンテ	0.800	0.700	0.700	1,047
アビスト	—	0.500	0.500	990
ウィルグループ	—	1	1	985
リクルートホールディングス	22	36	36	124,384
日本郵政	—	40	40	55,918
ベルシステム24ホールディングス	—	2	2	2,586
リロ・ホールディング	0.700	0.700	0.700	8,995
東祥	—	0.500	0.500	1,972
エイチ・アイ・エス	3	3	3	9,780
共立メンテナンス	1	1	1	11,900
イチネンホールディングス	2	1	1	1,719
建設技術研究所	1	1	1	1,005
スペース	1	1	1	1,239
燦ホールディングス	0.700	—	—	—
東京アトル	8	8	8	936

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
ナガワ	—	0.300		819
よみうりランド	4	4		1,676
東京都競馬	14	12		2,544
常磐興産	8	7		1,043
カナモト	2	2		6,197
東京ドーム	14	15		7,815
西尾レントオール	1	1		3,897
トランス・コスモス	2	2		5,079
乃村工藝社	3	3		5,588
藤田観光	7	7		3,864
KNT-CTホールディングス	10	9		1,530
日本管財	1	1		2,809
トーカイ	0.900	0.800		2,456
白洋舎	5	—		—
セコム	19	19		154,280
セントラル警備保障	0.900	0.800		1,691
丹青社	2	3		2,278
メイテック	2	2		9,154
アサツー ディ・ケイ	3	3		9,148
応用地質	2	1		2,325
船井総研ホールディングス	2	2		3,497
進学会	2	1		995

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
ベネッセホールディングス	7	6		21,563
イオンデイライト	1	1		6,543
ナック	1	1		1,000
ニチイ学館	3	3		2,524
ダイセキ	3	3		5,973
ステップ	1	—		—
合 計	株数・金額	31,843	28,896	33,569,060
	銘柄数<比率>	1,625	1,672	<98.3%>

- (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	T O P I X	571	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆投資信託財産の構成

(2016年2月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
	33,569,060	94.6
コール・ローン等、その他	1,925,458	5.4
投資信託財産総額	35,494,519	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

(2016年2月22日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,494,519,243円
コール・ローン等	1,682,065,577
株 式 (評価額)	33,569,060,310
未 収 入 金	40,981,020
未 収 配 当 金	53,632,336
差 入 委 託 証 拠 金	148,780,000
(B) 負 債	1,357,071,503
未 払 金	1,295,076,600
未 払 解 約 金	61,994,903
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	34,137,447,740
元 本	26,708,202,183
次 期 繰 越 損 益 金	7,429,245,557
(D) 受 益 権 総 口 数	26,708,202,183口
1万口当たり基準価額 (C/D)	12,782円

(注1) 期首元本額	29,591,687,886円
期中追加設定元本額	11,413,846,574円
期中一部解約元本額	14,297,332,277円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファン ド別内訳は、次の通りです。	
ニッセイTOPIXオープン	8,316,998,974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)	7,359,394,307円
ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定)	28,333,451円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	8,035,580円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	639,417,761円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	3,086,722,705円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	2,271,160,116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)	106,618,067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)	634,211,990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)	524,533,318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)	1,336,991,960円
DCニッセイ国内株式インデックス	6,973,595円
ニッセイターゲットデートファンドI (適格機関投資家限定)	312,638円
ニッセイターゲットデートファンドII (適格機関投資家限定)	298,736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	2,224,600,009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資産的枠型)	163,598,976円

◆損益の状況

当期 (2015年2月21日～2016年2月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	796,010,582円
受 取 配 当 金	794,828,982
受 取 利 息	506,740
そ の 他 収 益 金	674,860
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,160,935,086
売 買 益	2,099,576,556
売 買 損	△ 7,260,511,642
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 33,317,760
取 引 益	317,798,940
取 引 損	△ 351,116,700
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 4,398,242,264
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	13,235,239,320
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,598,301,711
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 7,006,053,210
(H) 合 計 (D+E+F+G)	7,429,245,557
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	7,429,245,557

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。