

第2期末 (2016年11月21日)	
基準価額	10,212円
純資産総額	10億円
騰落率	△8.9%
分配金	0円

<購入・換金手数料なし> ニッセイJPX日経400 インデックスファンド

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11月21日～2016年11月21日

第2期 (決算日 2016年11月21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JPX日経400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JPX日経400インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、JPX日経インデックス400 (配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。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

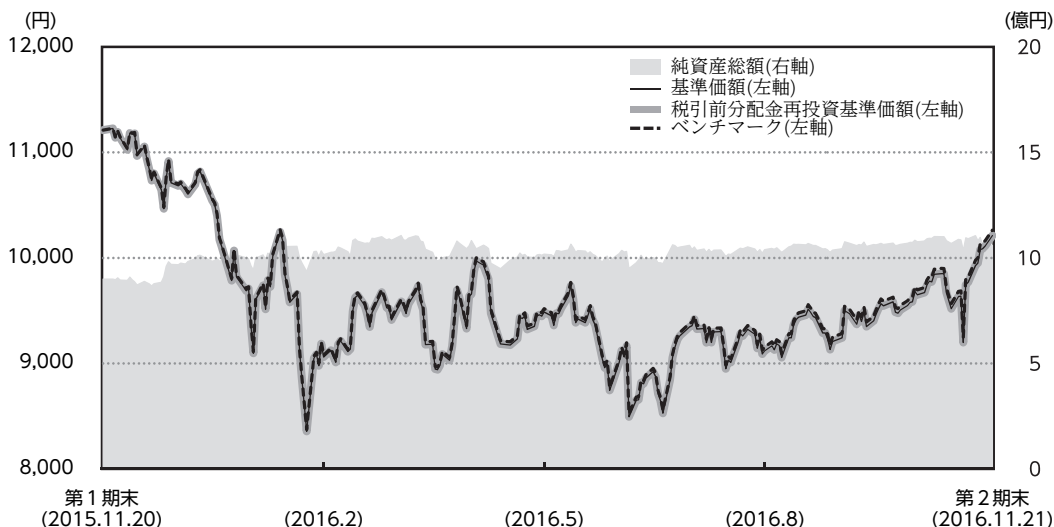
東京都千代田区丸の内1-6-6

<購入・換金手数料なし>ニッセイJPX日経400インデックスファンド

運用経過

2015年11月21日～2016年11月21日

基準価額等の推移



第2期首	11,211円	既払分配金	0円
第2期末	10,212円	騰落率(分配金再投資ベース)	△8.9%

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

基準価額の変動要因

期初は原油安などから株価が下落し、基準価額も下落しました。また、1月下旬の日銀によるマイナス金利導入後に株価は一時反発しましたが、円高進行などから、基準価額は再度下落しました。しかし、2月中旬には欧州での信用不安後退を受け、株価が反発したため、基準価額も上昇し、その後はおおむね横ばいとなりました。

6月にはイギリスの国民投票で欧州連合(EU)離脱派が勝利したことを受け、円高が進行し、基準価額は下落しましたが、7月に各国の政策対応への期待や米雇用統計の改善などから株価が反発し、基準価額も上昇しました。以降、株価は徐々に上昇基調となり、基準価額も上昇し、11月の米大統領選後には米早期利上げ観測が強まったことでさらに上昇しましたが、当期末の水準は期初を下回る結果となりました。

<購入・換金手数料なし>ニッセイJPX日経400インデックスファンド

1 万口当たりの費用明細

2015年11月21日～2016年11月21日

項目	第2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	32円	0.335%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は9,568円です。
(投信会社)	(15)	(0.152)	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)	(15)	(0.152)	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)	(0.032)	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	1	0.008	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$
(先物・オプション)	(1)	(0.008)	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	1	0.011	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(1)	(0.011)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	・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	34	0.354	

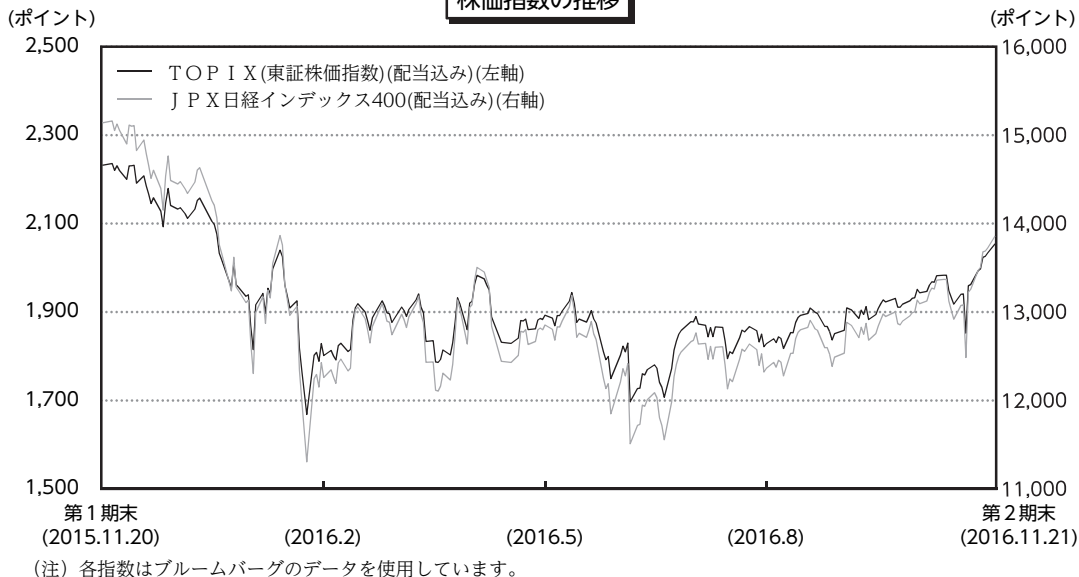
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

国内株式市況

株価指数の推移



期初は原油安など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、中国経済への懸念が一段と強まったためさらに下落しました。また、1月下旬には日銀によるマイナス金利の導入を好感して上昇しましたが、原油安や円高進行などから、株価は再度下落しました。しかし2月中旬には、欧州での信用不安後退や、原油価格の反発などから、株価は上昇し、その後はおおむね横ばい圏で推移しました。

6月にはイギリスの国民投票でEU離脱派が勝利したことを受け、円高が進行し、株価は下落しましたが、7月には各国の政策対応への期待や米雇用統計の改善などから上昇しました。その後は、米早期利上げへの思惑などから株価は徐々に上昇基調となり、11月の米大統領選後は12月にも米国が利上げすると観測からさらに上昇しましたが、期初を下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 J P X 日経400インデックスファンド

ポートフォリオ

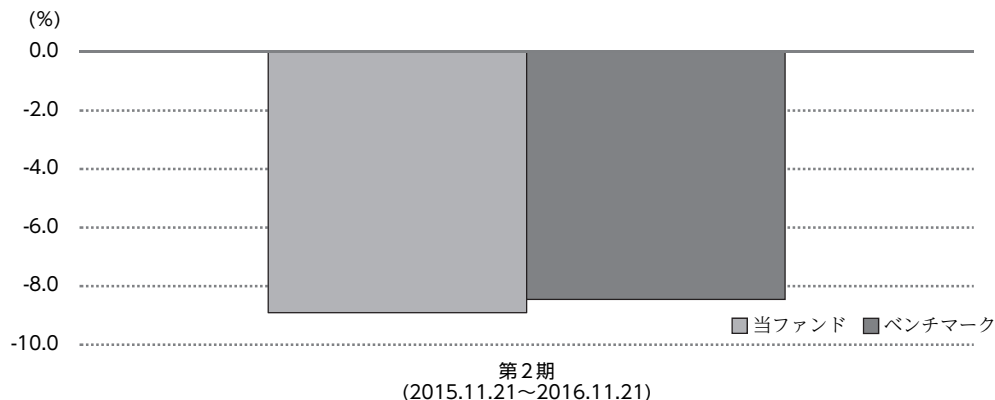
当ファンド

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

マザーファンド

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

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-8.9%となり、ベンチマーク騰落率（-8.5%）を下回りました。

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

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（1万円当たり）

項目	当期
	2015年11月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税引前）	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	826円

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

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

今後の運用方針

当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、J P X 日経インデックス400（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

マザーファンド

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

<購入・換金手数料なし>ニッセイJPX日経400インデックスファンド

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	ベンチマーク	株式		純資産 総額
	(分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率			組入比率	先物比率	
(設定日) 2015年1月29日	円 10,000	円 -	% -	円 10,000	10,000	% -	% -	百万円 74
1期(2015年11月20日)	11,211	0	12.1	11,211	11,346	13.5	97.3	899
2期(2016年11月21日)	10,212	0	△ 8.9	10,212	10,387	△ 8.5	96.7	1,059

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

(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		
	騰落率	騰落率		組入比率	先物比率	
(期首) 2015年11月20日	円 11,211	% -	11,346	% -	% 97.3	% 2.9
11月末	11,025	△ 1.7	11,167	△ 1.6	97.3	2.7
12月末	10,818	△ 3.5	10,966	△ 3.4	96.5	3.5
2016年1月末	10,015	△10.7	10,153	△10.5	97.6	2.4
2月末	9,112	△18.7	9,243	△18.5	97.9	2.0
3月末	9,511	△15.2	9,652	△14.9	96.5	3.5
4月末	9,474	△15.5	9,623	△15.2	96.7	4.0
5月末	9,734	△13.2	9,884	△12.9	94.6	5.5
6月末	8,807	△21.4	8,943	△21.2	96.7	3.3
7月末	9,299	△17.1	9,445	△16.8	98.2	1.9
8月末	9,365	△16.5	9,518	△16.1	98.1	1.8
9月末	9,348	△16.6	9,505	△16.2	97.3	2.7
10月末	9,851	△12.1	10,019	△11.7	96.6	2.4
(期末) 2016年11月21日	10,212	△ 8.9	10,387	△ 8.5	96.7	3.4

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

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

◆親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2015年11月21日～2016年11月21日)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド	1,495,324	1,585,806	1,285,474	1,360,501

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	56,699,015千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	52,490,618千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	1.08

(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11月21日～2016年11月21日)

当期における利害関係人との取引はありません。

◆親投資信託残高 (2016年11月21日現在)

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド	727,658	937,507	1,059,664

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド全体の口数は44,772,428千口です。

◆投資信託財産の構成 (2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド	1,059,664	94.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	58,737	5.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,118,402	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 J P X 日経400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

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	1,118,402,408円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,760,640
ニッセイ J P X 日経400インデックス マザーファンド(評価額)	1,059,664,946
未 収 入 金	56,976,822
(B)負 債	58,767,332
未 払 解 約 金	56,946,288
未 払 信 託 報 酬	1,765,420
そ の 他 未 払 費 用	55,624
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	1,059,635,076
元 本	1,037,655,257
次 期 繰 越 損 益 金	21,979,819
(D)受 益 権 総 口 数	1,037,655,257口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,212円

(注) 期首元本額 802,626,033円
 期中追加設定元本額 1,651,546,561円
 期中一部解約元本額 1,416,517,337円

◆損益の状況

当期 (2015年11月21日～2016年11月21日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	△ 223円
受 取 利 息	69
支 払 利 息	△ 292
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	43,337,469
売 買 益	108,208,800
売 買 損	△ 64,871,331
(C)信 託 報 酬 等	△ 3,548,476
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	39,788,770
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,861,469
(分 配 準 備 積 立 金)	(7,861,469)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	△ 25,670,420
(配 当 等 相 当 額)	(35,896,012)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 61,566,432)
(G)合 計 (D + E + F)	21,979,819
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	21,979,819
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 25,670,420
(配 当 等 相 当 額)	(38,133,929)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 63,804,349)
分 配 準 備 積 立 金	47,650,239

(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	20,361,386円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	19,427,384円
(c)信託約款に定める収益調整金	38,133,929円
(d)信託約款に定める分配準備積立金	7,861,469円
(e)分配対象額 (a + b + c + d)	85,784,168円
(f)分配対象額 (1万口当たり)	826.71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)

関連会社の実質保有比率

2016年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に10.9%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

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

当ファンドの概要

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

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

運用報告書



第4期

(計算期間：2016年5月21日～2016年11月21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	主に国内の金融商品取引所上場株式に投資を行い、J P X 日経インデックス400（配当込み）の動きに連動する成果を目標に運用を行います。
主要運用対象	国内の金融商品取引所上場株式
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

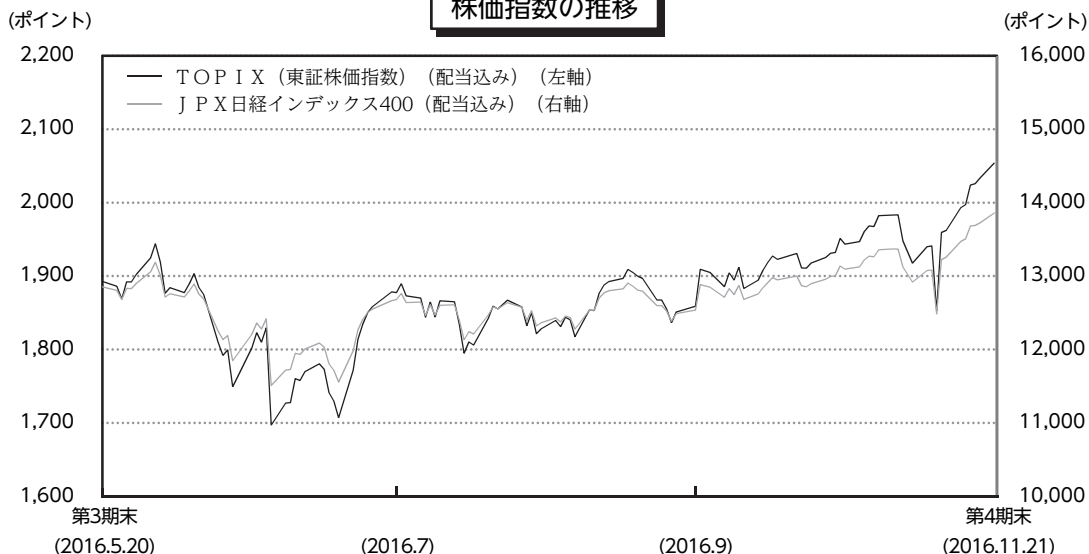
ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

運用経過

2016年5月21日～2016年11月21日

国内株式市況

株価指数の推移



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は、期初以降おおむね横ばいで推移しましたが、6月下旬にイギリスの国民投票で欧州連合（EU）離脱派が勝利すると、先行きへの不透明感が強まり、円高が進行し、株価は下落しました。

7月に入ると各国の政策対応への期待や米雇用統計の改善などから投資家のリスク回避傾向は一服し、株価は上昇に転じました。その後は、政策対応への期待感や、為替市場の動向などをにらみつつ、株価は上下動しながらおおむね横ばいで推移しましたが、米早期利上げへの思惑などから徐々に上昇基調となりました。また、11月の米大統領選後に、株価は一時急落しましたが、12月にも米国が利上げするとの観測が強まったことで急上昇し、以降上昇を続けて期初を上回る水準で当期末を迎えました。

ニッセイ J P X 日経400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

期初はおおむね横ばいで推移しました。6月には円高による株価下落の影響から基準価額も下落しましたが、7月には各国の政策対応への期待などから株価が反発し、基準価額も上昇しました。以降、株価は徐々に上昇基調となり、基準価額も上昇し、11月の米大統領選後には米早期利上げ観測が強まったことからさらに上昇しました。結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は7.8%と、ベンチマーク騰落率 (7.8%) に連動しました。

今後の運用方針

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

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

◆設定以来の運用実績

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
(設定日) 2014年10月31日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -	百万円 5,000
1期(2015年5月20日)	12,691	26.9	12,884	28.8	95.9	4.1	15,865
2期(2015年11月20日)	12,366	△ 2.6	12,656	△ 1.8	97.3	2.9	44,341
3期(2016年5月20日)	10,482	△ 15.2	10,745	△ 15.1	95.1	5.0	49,360
4期(2016年11月21日)	11,303	7.8	11,586	7.8	96.7	3.4	50,607

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

(注3) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注4) 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
(期首) 2016年5月20日	円 10,482	% -	10,745	% -	% 95.1	% 5.0
5月末	10,757	2.6	11,026	2.6	94.6	5.5
6月末	9,735	△ 7.1	9,976	△ 7.2	96.7	3.3
7月末	10,282	△ 1.9	10,536	△ 1.9	98.2	1.9
8月末	10,358	△ 1.2	10,617	△ 1.2	98.1	1.8
9月末	10,342	△ 1.3	10,602	△ 1.3	97.3	2.7
10月末	10,902	4.0	11,176	4.0	96.6	2.4
(期末) 2016年11月21日	11,303	7.8	11,586	7.8	96.7	3.4

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ J P X 日経400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5月21日～2016年11月21日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)	0.003% (0.003)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.003	

(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（10,330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5月21日～2016年11月21日)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		8,482 (△2,306)	9,756,448	8,134	11,124,003

(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
		14,934	15,716	2,756	2,755

(注) 単位未満は切り捨てています。

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

◆主要な売買銘柄

(2016年5月21日～2016年11月21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
三菱UFJフィナンシャル・グループ	664	358,513	539	日本電信電話	82	378,210	4,601
トヨタ自動車	57	342,080	5,938	日本たばこ産業	89	354,721	3,954
三井住友フィナンシャルグループ	93	320,057	3,441	KDDI	113	348,616	3,079
みずほフィナンシャルグループ	1,835	314,382	171	ソフトバンクグループ	46	307,615	6,601
本田技研工業	78	235,834	2,996	みずほフィナンシャルグループ	904	155,799	172
日本航空	68	208,752	3,034	三菱UFJフィナンシャル・グループ	290	152,091	524
中部電力	119	162,891	1,365	アステラス製薬	92	144,258	1,568
日本電信電話	33	152,903	4,633	武田薬品工業	29	138,319	4,720
東日本旅客鉄道	13	126,011	9,403	トヨタ自動車	22	136,666	5,967
日本たばこ産業	29	122,022	4,108	日産自動車	132	135,455	1,023

(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11月21日現在)

(1) 国内株式 上場株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.0%)			
日本水産	—	45	22,070
鉱業(0.4%)			
国際石油開発帝石	188	184	199,491
建設業(3.1%)			
安藤・間	23	25	19,227
東急建設	—	12	11,212
コムシスホールディングス	15	13	26,030
ミサワホーム	4	—	—
大成建設	186	178	140,086
大林組	107	105	111,301
清水建設	109	107	107,749
長谷工コーポレーション	41	40	45,685
鹿島建設	168	154	117,964
三井住友建設	137	134	15,724
熊谷組	—	55	15,565

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
大東建託	13	12	219,171
NIPPON	8	8	16,672
前田道路	—	11	21,296
住友林業	24	24	37,379
大和ハウス工業	105	103	320,331
積水ハウス	119	110	196,843
協和エクシオ	14	13	21,426
九電工	—	6	20,876
日揮	36	32	64,157
千代田化工建設	26	—	—
食料品(4.2%)			
江崎グリコ	—	8	44,880
カルビー	13	14	50,336
ヤクルト本社	19	18	96,068
明治ホールディングス	21	20	187,200
日本ハム	26	24	68,184

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評価額	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円			
アサヒグループホールディングス	67	65	244,249			
キリンホールディングス	144	151	276,632			
伊藤園	10	10	38,948			
キッコーマン	27	25	86,750			
味の素	75	72	158,083			
キューピー	18	17	48,647			
ニチレイ	38	17	37,212			
東洋水産	17	17	68,886			
日清食品ホールディングス	15	13	79,597			
日本たばこ産業	207	147	562,083			
繊維製品(0.5%)						
東レ	242	238	220,626			
パルプ・紙(0.2%)						
王子ホールディングス	137	128	58,368			
大王製紙	14	13	16,623			
化学(6.9%)						
クラレ	52	55	87,271			
旭化成	208	204	196,860			
住友化学	246	241	120,982			
日産化学工業	20	18	70,290			
東ソー	90	95	69,635			
デンカ	69	68	33,048			
信越化学工業	59	58	486,570			
エア・ウォーター	28	27	50,220			
大陽日酸	25	25	29,525			
日本パーカライズング	17	16	22,092			
三菱瓦斯化学	—	30	52,033			
J S R	31	33	52,305			
三菱ケミカルホールディングス	223	219	156,926			
日本合成化学工業	8	—	—			
ダイセル	47	44	56,841			
積水化学工業	75	74	125,438			
日本ゼオン	29	28	27,664			
アイカ工業	10	10	31,059			
宇部興産	179	165	37,785			
日立化成	16	18	45,754			
日本化薬	22	21	27,762			
日油	25	26	27,846			
花王	89	83	424,830			
日本ペイントホールディングス	25	25	88,423			
関西ペイント	37	34	70,864			
D I C	132	12	42,505			
富士フイルムホールディングス	76	65	270,400			
資生堂	63	62	184,827			

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			
コーセー	5	5	49,555			
シーズ・ホールディングス	4	4	12,624			
小林製薬	5	9	46,774			
日東電工	25	23	185,826			
ニフコ	6	5	35,454			
ユニ・チャーム	67	66	158,895			
医薬品(6.1%)						
協和発酵キリン	40	39	66,600			
武田薬品工業	133	122	577,261			
アステラス製薬	374	335	532,147			
塩野義製薬	48	44	239,227			
田辺三菱製薬	38	38	81,633			
中外製薬	33	32	107,906			
科研製薬	5	6	38,186			
エーザイ	41	40	286,718			
ロート製薬	16	—	—			
小野薬品工業	75	74	193,849			
久光製薬	10	9	54,464			
持田製薬	2	—	—			
参天製薬	61	60	90,841			
ツムラ	10	11	35,915			
沢井製薬	5	5	35,168			
第一三共	112	96	238,210			
キョーリン製薬ホールディングス	8	8	19,464			
大塚ホールディングス	71	70	333,958			
大正製薬ホールディングス	8	7	68,110			
石油・石炭製品(—)						
昭和シェル石油	33	—	—			
ゴム製品(1.2%)						
横浜ゴム	20	19	39,738			
東洋ゴム工業	15	17	25,707			
ブリヂストン	112	110	469,386			
住友ゴム工業	31	30	57,071			
ガラス・土石製品(1.0%)						
旭硝子	176	161	117,208			
住友大阪セメント	—	61	24,705			
太平洋セメント	209	198	68,310			
TOTO	24	24	107,968			
日本碍子	42	41	90,748			
日本特殊陶業	28	28	65,875			
鉄鋼(1.2%)						
新日鐵住金	150	147	350,138			
神戸製鋼所	614	56	56,473			
ジェイ エフ イー ホールディングス	91	89	148,198			

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立金属	38	33	48,463
非鉄金属(0.9%)			
三井金属鉱業	85	—	—
三菱マテリアル	208	20	69,054
住友金属鉱山	92	85	128,732
DOWAホールディングス	43	36	29,700
住友電気工業	133	123	193,339
アサヒホールディングス	5	—	—
金属製品(0.3%)			
三和ホールディングス	33	32	35,132
三協立山	4	4	6,690
リンナイ	6	5	51,744
日本発条	31	30	31,138
機械(5.3%)			
オーエスジー	15	14	34,687
DMG森精機	—	19	24,541
ディスコ	4	3	50,350
ニューフレアテクノロジー	0.600	0.700	3,864
ナブテスコ	17	17	49,674
SMC	10	9	309,876
小松製作所	163	151	380,797
住友重機械工業	97	96	63,744
日立建機	14	14	34,061
クボタ	160	157	264,106
荏原製作所	74	13	41,480
ダイキン工業	46	42	447,923
椿本チエイン	19	19	16,777
ダイフク	—	15	34,132
タダノ	15	16	20,532
平和	9	9	23,328
ユニバーサルエンターテインメント	3	—	—
竹内製作所	—	5	13,326
セガサミーホールディングス	34	—	—
T P R	3	3	10,552
ホシザキ	9	9	90,252
日本精工	65	64	80,439
ジェイテクト	34	33	60,287
不二越	30	31	13,702
T H K	21	22	55,051
イーグル工業	3	3	5,161
マキタ	20	20	156,060
三菱重工業	568	525	256,095

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
I H I	245	241	76,638
電気機器(13.2%)			
コニカミノルタ	79	73	73,373
ブラザー工業	41	40	79,056
ミネベア	51	50	57,405
日立製作所	814	752	461,352
三菱電機	340	333	533,238
富士電機	96	94	53,204
安川電機	39	36	64,432
日本電産	38	40	418,992
オムロン	36	33	138,528
日本電気	439	430	128,140
富士通	308	302	197,538
沖電気工業	138	13	20,508
ルネサスエレクトロニクス	—	16	13,397
セイコーエプソン	47	46	102,100
ワコム	25	—	—
エレコム	—	2	5,051
パナソニック	364	357	371,546
アンリツ	19	—	—
富士通ゼネラル	10	11	24,871
日立国際電気	7	8	18,023
T D K	19	17	134,464
アルプス電気	27	28	82,827
ヒロセ電機	5	5	69,972
日本航空電子工業	9	10	15,500
横河電機	31	33	54,138
日本光電工業	13	13	33,667
堀場製作所	5	6	30,907
キーエンス	7	7	547,978
シスメックス	24	24	168,885
スタンレー電気	22	22	70,000
カシオ計算機	32	26	35,026
ファナック	32	31	621,954
エンプラス	1	1	4,438
浜松ホトニクス	24	24	72,760
京セラ	52	51	279,821
村田製作所	33	32	492,656
小糸製作所	19	18	110,168
ミツバ	5	5	8,914
SCREENホールディングス	—	6	43,840
キヤノン	171	168	526,394

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評価額	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円	千株	千株	千円
リコー	103	94	86,666			
東京エレクトロン	26	20	211,508			
輸送用機器(8.6%)						
トヨタ紡織	11	—	—			
ユニプレス	6	—	—			
豊田自動織機	29	28	148,485			
デンソー	78	77	373,339			
東海理化電機製作所	9	—	—			
三井造船	124	—	—			
川崎重工業	248	244	81,984			
名村造船所	9	9	6,166			
日産自動車	447	374	389,396			
いすゞ自動車	92	90	114,327			
トヨタ自動車	93	128	814,587			
日野自動車	45	44	51,807			
三菱自動車工業	126	—	—			
日信工業	—	7	11,501			
NOK	15	15	32,782			
カルソニックカンセイ	24	21	27,762			
アイシン精機	32	28	133,419			
マツダ	101	99	176,893			
ダイハツ工業	38	—	—			
本田技研工業	214	251	801,279			
スズキ	66	62	240,560			
富士重工業	100	97	433,317			
ヤマハ発動機	45	44	114,257			
エクセディ	4	—	—			
豊田合成	11	10	24,613			
日本精機	8	—	—			
シマノ	12	12	230,958			
ティ・エス テック	7	7	21,520			
精密機器(1.8%)						
テルモ	48	48	195,360			
島津製作所	—	40	67,080			
ニコン	59	54	85,066			
トプコン	10	15	28,645			
オリンパス	47	50	190,500			
H O Y A	72	65	294,007			
朝日インテック	—	7	34,837			
セイコーホールディングス	21	22	8,316			
その他製品(0.7%)						
パンダイナムホールディングス	33	34	109,882			
パイロットコーポレーション	5	5	25,905			
アシックス	29	31	74,080			

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
ヤマハ	23	21	70,157			
ビジョン	18	18	55,358			
電気・ガス業(1.4%)						
中部電力	—	103	160,836			
東北電力	—	78	99,079			
電源開発	27	24	58,041			
東京瓦斯	356	336	157,617			
大阪瓦斯	330	304	127,436			
東邦瓦斯	—	79	67,940			
陸運業(5.1%)						
東武鉄道	171	167	89,846			
相鉄ホールディングス	73	67	35,510			
東京急行電鉄	186	170	142,800			
小田急電鉄	102	50	109,518			
京王電鉄	89	87	78,996			
京成電鉄	48	23	60,700			
東日本旅客鉄道	58	60	588,183			
西日本旅客鉄道	30	30	199,201			
東海旅客鉄道	28	26	470,470			
西日本鉄道	55	50	24,650			
近鉄グループホールディングス	321	315	136,395			
阪急阪神ホールディングス	214	39	138,250			
南海電気鉄道	96	88	45,144			
京阪ホールディングス	95	94	67,680			
名古屋鉄道	155	152	83,144			
日本通運	123	121	71,511			
ヤマトホールディングス	59	56	129,416			
山九	42	41	26,609			
海運業(0.1%)						
日本郵船	286	264	58,608			
空運業(0.8%)						
日本航空	—	56	191,647			
A N Aホールディングス	592	581	180,691			
倉庫・運輸関連業(—)						
近鉄エクスプレス	5	—	—			
情報・通信業(6.6%)						
グリー	19	18	11,298			
ネクソン	30	34	56,916			
コロプラ	—	8	8,058			
ティーガイア	3	3	4,966			
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	73	64	17,107			
野村総合研究所	22	21	77,070			
フジ・メディア・ホールディングス	32	—	—			
オービック	10	10	52,735			

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評価額	
	千株	千株	千円	
ヤフー	225	221	90,995	
トレンドマイクロ	15	16	65,764	
日本オラクル	5	5	27,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	7	7	21,070	
大塚商会	8	8	44,820	
U S E N	14	14	4,540	
エイベックス・グループ・ホールディングス	5	—	—	
日本テレビホールディングス	28	28	52,762	
日本電信電話	189	140	614,040	
K D D I	287	207	596,074	
光通信	3	3	34,373	
N T T ドコモ	242	230	579,559	
GMOインターネット	11	11	17,243	
東宝	22	20	65,246	
エヌ・ティ・ティ・データ	19	19	106,196	
S C S K	7	8	32,088	
ソフトバンクグループ	126	96	664,152	
卸売業(4.7%)				
双日	198	182	52,560	
アルフレッサ ホールディングス	39	36	68,364	
シップヘルスケアホールディングス	6	5	17,493	
第一興商	7	6	29,982	
メディバルホールディングス	31	30	50,583	
伊藤忠商事	247	226	341,260	
丸紅	310	304	183,676	
豊田通商	35	34	93,740	
兼松	67	66	12,342	
三井物産	284	279	418,680	
日立ハイテクノロジーズ	10	10	46,866	
住友商事	198	194	252,947	
三菱商事	236	231	565,939	
阪和興業	—	31	22,785	
岩谷産業	37	34	20,298	
東邦ホールディングス	10	9	21,671	
サンリオ	9	9	18,012	
日鉄住金物産	28	2	11,259	
ミスミグループ本社	35	34	71,863	
小売業(4.5%)				
ローソン	11	10	83,674	
エービーシー・マート	4	5	36,120	
ゲオホールディングス	5	5	6,141	
セリア	3	3	30,044	
MonotaRO	11	10	25,909	
J. フロント リテイリング	39	39	64,045	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評価額	
	千株	千株	千円	
マツモトキヨシホールディングス	6	5	30,798	
スタートトゥデイ	9	28	50,675	
三越伊勢丹ホールディングス	62	—	—	
ウエルシアホールディングス	3	4	28,126	
クリエイティブSDホールディングス	—	4	10,723	
コスモス薬品	1	1	33,200	
セブン&アイ・ホールディングス	131	129	563,441	
ツルハホールディングス	7	7	79,875	
クスリのアオキホールディングス	—	2	12,961	
ノジマ	—	4	6,216	
良品計画	3	4	87,166	
ドンキホーテホールディングス	20	20	82,500	
V T ホールディングス	14	13	7,797	
ユナイテッドアローズ	4	4	11,270	
スギホールディングス	5	6	36,720	
エー・ファミリーマートホールディングス	9	9	66,975	
日本瓦斯	4	5	18,354	
AOK Iホールディングス	7	—	—	
しまむら	3	3	47,880	
高島屋	46	52	49,348	
イオン	129	127	191,984	
イズミ	6	6	29,615	
ヤオコー	3	3	15,032	
ケーズホールディングス	6	14	28,911	
アインホールディングス	3	3	28,490	
ニトリホールディングス	13	13	153,216	
パローホールディングス	6	6	18,317	
ファーストリテイリング	6	5	207,844	
サンドラッグ	6	5	44,722	
銀行業(8.3%)				
東京MFフィナンシャルグループ	—	4	16,717	
九州フィナンシャルグループ	—	67	51,376	
コソディア・フィナンシャルグループ	211	202	106,773	
新生銀行	273	294	56,448	
あおぞら銀行	199	195	77,220	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	965	1,340	909,459	
りそなホールディングス	368	361	196,999	
三井住友トラスト・ホールディングス	658	64	268,320	
三井住友フィナンシャルグループ	164	221	928,620	
西日本シティ銀行	103	—	—	
千葉銀行	121	119	83,895	
常陽銀行	114	—	—	
群馬銀行	70	68	39,708	
ふくおかフィナンシャルグループ	136	125	62,250	

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
静岡銀行	92	84	84	78,036
十六銀行	53	—	—	—
スルガ銀行	29	31	31	79,537
八十二銀行	76	79	79	48,018
ほくほくフィナンシャルグループ	214	20	20	37,945
広島銀行	93	91	91	44,954
中国銀行	29	29	29	45,289
伊予銀行	44	—	—	—
セブン銀行	118	115	115	36,940
みずほフィナンシャルグループ	3,244	4,176	4,176	840,231
山口フィナンシャルグループ	39	39	39	47,073
北洋銀行	47	50	50	22,780
京葉銀行	35	—	—	—
証券・商品先物取引業(1.5%)				
F P G	—	11	11	9,581
S B Iホールディングス	37	34	34	48,545
ジャフコ	5	5	5	19,708
大和証券グループ本社	295	289	289	193,369
野村ホールディングス	606	631	631	382,370
岡三証券グループ	27	26	26	16,692
東海証券フィナンシャル・ホールディングス	36	35	35	21,051
松井証券	15	17	17	15,540
カブドットコム証券	27	23	23	8,257
保険業(3.5%)				
SOMPOホールディングス	70	64	64	230,622
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	94	92	92	321,757
ソニーフィナンシャルホールディングス	30	29	29	48,129
第一生命ホールディングス	201	186	186	347,449
東京海上ホールディングス	127	125	125	596,202
T & Dホールディングス	114	112	112	162,031
その他金融業(1.5%)				
全国保証	—	8	8	33,973
クレディセゾン	23	—	—	—
芙蓉総合リース	3	3	3	18,235
興銀リース	5	5	5	13,775
東京センチュリー	7	6	6	22,909
イオンフィナンシャルサービス	20	19	19	35,775
アコム	63	—	—	—
オリエントコーポレーション	—	66	66	13,426
日立キャピタル	7	7	7	19,783

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
オリックス	223	218	218	384,103
三菱UFJリース	79	78	78	41,081
日本取引所グループ	92	96	96	161,063
不動産業(3.3%)				
いちご	—	29	29	12,540
ヒューリック	65	64	64	64,593
野村不動産ホールディングス	20	20	20	38,191
プレサンスコーポレーション	1	4	4	6,475
東急不動産ホールディングス	76	74	74	48,704
飯田グループホールディングス	29	25	25	54,876
パーク24	15	15	15	51,558
三井不動産	167	164	164	440,258
三菱地所	234	230	230	506,690
東京建物	34	35	35	52,234
住友不動産	75	74	74	224,590
大京	59	57	57	13,167
レオパレス21	37	39	39	22,971
スターツコーポレーション	4	4	4	8,631
住友不動産販売	2	2	2	7,618
タカラレーベン	13	13	13	8,694
イオンモール	20	19	19	30,407
エヌ・ティ・ティ都市開発	19	19	19	18,393
サービス業(3.1%)				
ミクシィ	6	8	8	33,836
日本M&Aセンター	5	9	9	30,221
テンブホールディングス	23	25	25	43,263
クックパッド	7	7	7	7,497
総合警備保障	11	11	11	53,371
カカクコム	23	23	23	42,196
ディップ	—	4	4	10,420
エムスリー	28	28	28	83,768
ディー・エヌ・エー	14	14	14	53,361
博報堂DYホールディングス	46	45	45	59,660
ぐるなび	—	4	4	11,693
電通	37	36	36	189,280
みらかホールディングス	8	—	—	—
オリエンタルランド	36	35	35	213,670
リゾートトラスト	14	12	12	28,371
ユー・エス・エス	40	39	39	70,488
サイバーエージェント	8	17	17	46,543

ニッセイ J P X 日経400インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
楽天	155	167	190,964
リログループ	1	1	24,848
エイチ・アイ・エス	5	5	16,562
カナモト	4	4	11,385
セコム	34	34	275,536
ベネッセホールディングス	11	—	—
イオンディライト	3	3	11,488
合 計	株数・金額	33,874	31,916
	銘柄数<比率>	400	400
			48,932,618
			<96.7%>

- (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。
- (注4) 業種は東証33業種分類によるものです。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国		百万円	百万円
内	T O P I X	1,730	—

(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11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
	48,932,618	92.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,169,137	7.9
投 資 信 託 財 産 総 額	53,101,755	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイJPX日経400インデックスマザーファンド

◆資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	57,047,025,649円
コール・ローン等	3,708,725,474
株 式 (評価額)	48,932,618,120
未 収 入 金	25,545,200
未 収 配 当 金	434,866,855
差 入 委 託 証 拠 金	3,945,270,000
(B)負 債	6,439,216,736
未 払 金	2,088,688,200
未 払 解 約 金	395,845,461
差入委託証拠金代用有価証券	3,954,680,000
そ の 他 未 払 費 用	3,075
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	50,607,808,913
元 本	44,772,428,703
次 期 繰 越 損 益 金	5,835,380,210
(D)受 益 権 総 口 数	44,772,428,703口
1万口当たり基準価額 (C/D)	11,303円

- (注1) 担保に供している資産
先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れています。
- | | |
|----|----------------|
| 株式 | 4,013,098,180円 |
|----|----------------|
- (注2) 期首元本額 47,089,289,710円
期中追加設定元本額 6,078,576,361円
期中一部解約元本額 8,395,437,368円
- (注3) 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、次のとおりです。
- | | |
|------------------------------------|-----------------|
| JPX日経400インデックスファンド (通称機関投資家限定) | 43,834,921,009円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイJPX日経400インデックスファンド | 937,507,694円 |

◆損益の状況

当期 (2016年5月21日~2016年11月21日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	544,063,448円
受 取 配 当 金	544,276,755
受 取 利 息	13,036
そ の 他 収 益 金	282,645
支 払 利 息	△ 508,988
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,349,611,551
売 買 益	5,073,681,232
売 買 損	△1,724,069,681
(C)先 物 取 引 等 損 益	54,614,060
取 引 益	272,885,400
取 引 損	△ 218,271,340
(D)信 託 報 酬 等	△ 28,960
(E)当期損益金 (A + B + C + D)	3,948,260,099
(F)前 期 繰 越 損 益 金	2,271,487,815
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	142,236,032
(H)解 約 差 損 益 金	△ 526,603,736
(I)合 計 (E + F + G + H)	5,835,380,210
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	5,835,380,210

- (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。