

第6期末 (2021年2月22日)

基準価額	13,386円
純資産総額	368億円
騰落率	18.3%
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:2020年2月21日～2021年2月22日

第6期(決算日 2021年2月22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6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

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

お客様の口座内容に関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年2月21日～2021年2月22日

基準価額等の推移



第6期首	11,313円	既払分配金	0円
第6期末	13,386円	騰落率(分配金再投資ベース)	18.3%

(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す。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(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。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは後掲の「国内株式市況」をご参照ください。

1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.155%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,116円です。
(投信会社)	(7)	(0.066)	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)	(7)	(0.066)	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)	(2)	(0.022)	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	
(株式)	(0)	(0.000)	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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)	(0.002)	
その他費用	0	0.001	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(0)	(0.001)	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	18	0.157	

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

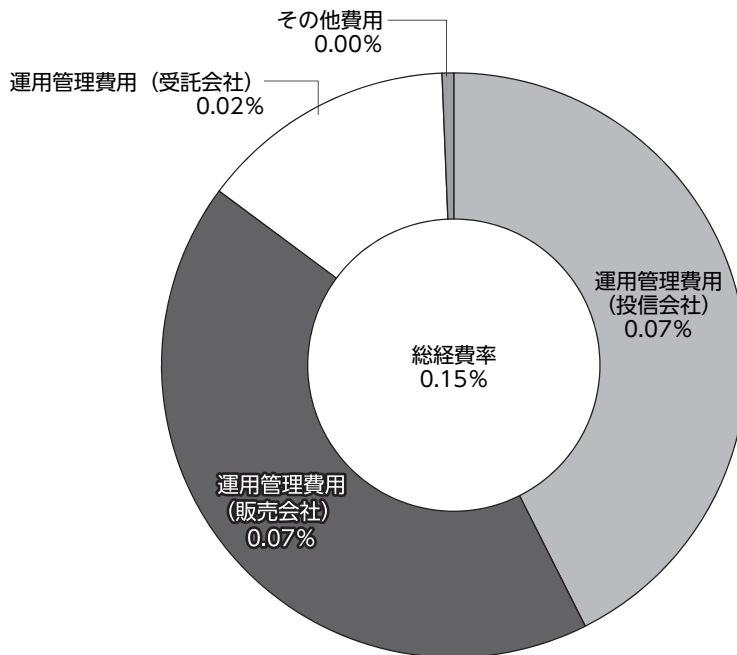
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.15%**です。



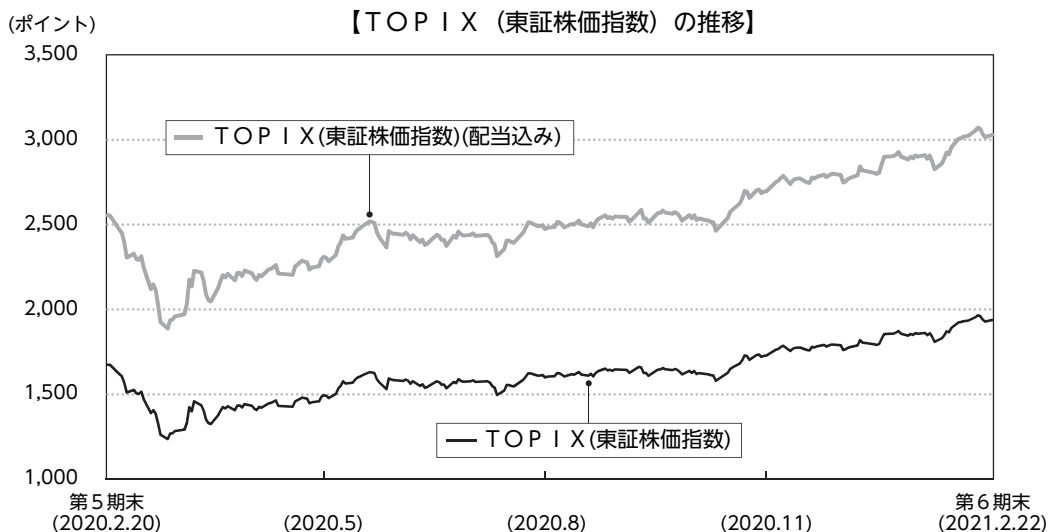
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大懸念から市場心理が大幅に悪化し、2020年3月中旬にかけて株価は大幅に下落しました。

その後、各国における緊急経済対策の発表や中央銀行の金融支援策の決定等を背景に株価は反発し、新型コロナウイルスの感染拡大に落ち着きが見られたことによる経済活動再開への期待感の高まりなどから6月上旬まで上昇基調となりました。

6月中旬には新型コロナウイルスの感染拡大第2波に対する警戒感や「香港国家安全維持法案」を巡る米中対立の懸念から株価は下落しました。7月には新型コロナウイルスの治療薬開発への期待感などを背景に上昇する場面もありましたが、感染拡大に歯止めがかからなかったことや米中対立の激化、加えて円高進行や企業業績の悪化が懸念され、株価は下落する展開となりました。8月に入ると米株高に加えて国内企業の第1四半期決算の内容や通期予想の下方修正が想定内であったこと、ワクチン開発への期待感などを背景に株価は反発し、その後はおおむね横ばいで推移しました。

11月以降は米大統領選において民主党のバイデン候補が当選を確実にしたことで先行き不透明感が後退したことや、ワクチン実用化への期待感から世界的な株高の流れが強まり、国内株式市場も上昇基調となりました。1月以降は国内における緊急事態宣言の再発令などを背景に株価は下落する場面もありましたが、米ジョージア州の上院決選投票の結果を受けて、バイデン次期政権下における追加経済対策への期待感が高まったことなどから株価は上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

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

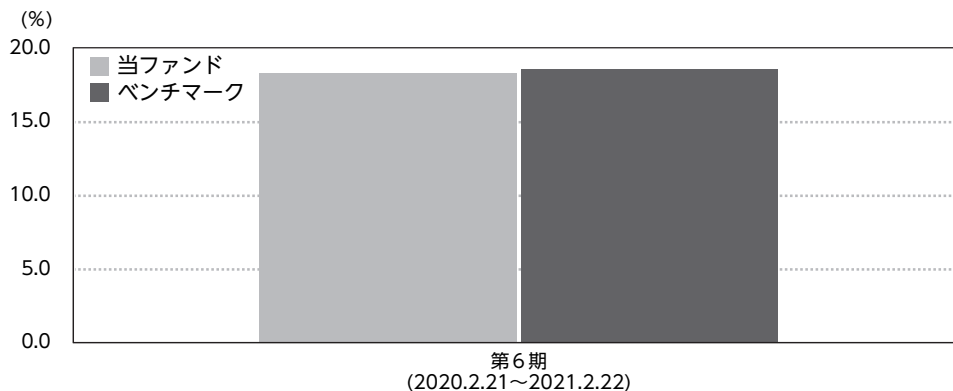
当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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。

*ベンチマークはTOP I X（東証株価指数）（配当込み）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+18.3%となり、ベンチマーク騰落率（+18.6%）におおむね連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。
 なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2020年2月21日～2021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	4,226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。

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6期末 2021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。

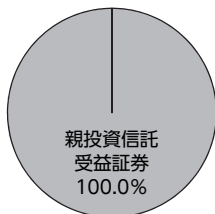
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

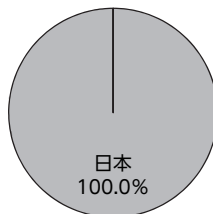
項目	第6期末 2021年2月22日
純資産総額	36,858,902,842円
受益権総口数	27,535,698,674口
1万口当たり基準価額	13,386円

(注) 当期間中における追加設定元本額は19,379,876,555円、同解約元本額は15,702,426,469円です。

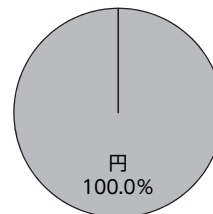
■資産別配分



■国別配分



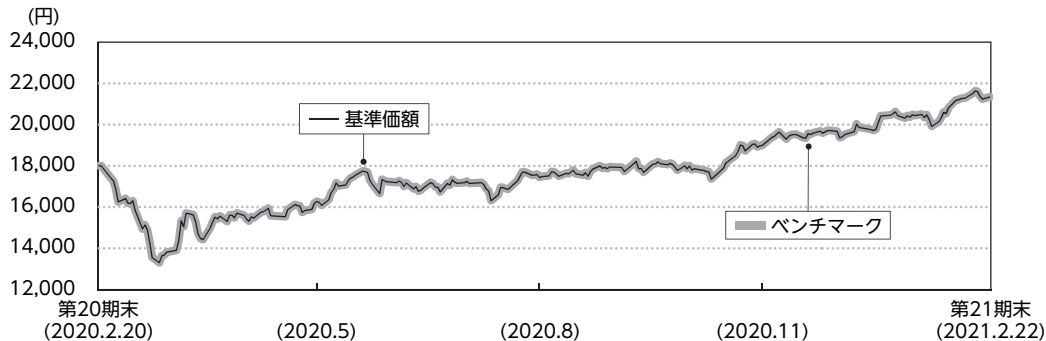
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2021年2月22日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

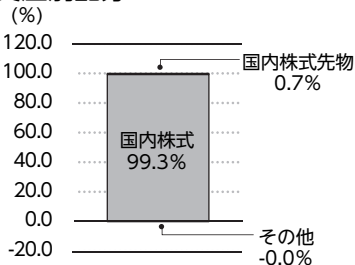
銘柄名	通貨	比率
ソフトバンクグループ	円	3.1%
トヨタ自動車	円	3.1
ソニー	円	2.8
キーエンス	円	2.1
任天堂	円	1.5
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.4
リクルートホールディングス	円	1.4
日本電産	円	1.3
信越化学工業	円	1.3
日本電信電話	円	1.2
組入銘柄数		1,853

■ 1万口当たりの費用明細

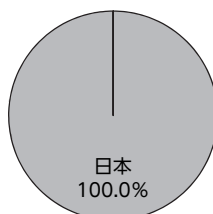
2020.2.21~2021.2.22

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

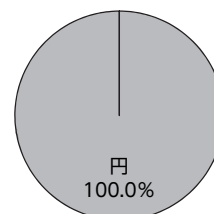
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2021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。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最近5期の運用実績

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					
	円	円	%	円		%	%	%	百万円
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
3期(2018年2月20日)	11,396	0	16.0	11,396	11,492	16.3	98.2	1.9	15,003
4期(2019年2月20日)	10,646	0	△ 6.6	10,646	10,754	△ 6.4	98.4	1.5	22,172
5期(2020年2月20日)	11,313	0	6.3	11,313	11,442	6.4	98.3	1.6	26,990
6期(2021年2月22日)	13,386	0	18.3	13,386	13,566	18.6	99.3	0.7	36,858

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「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3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注5) 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。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率
(期首)2020年2月20日	11,313	—	11,442	—	98.3	1.6
2月末	10,211	△ 9.7	10,327	△ 9.7	97.9	1.8
3月末	9,595	△ 15.2	9,708	△ 15.2	96.7	3.7
4月末	10,007	△ 11.5	10,131	△ 11.5	95.9	4.2
5月末	10,686	△ 5.5	10,821	△ 5.4	95.4	5.6
6月末	10,667	△ 5.7	10,800	△ 5.6	98.3	1.7
7月末	10,238	△ 9.5	10,366	△ 9.4	97.2	2.7
8月末	11,072	△ 2.1	11,213	△ 2.0	96.7	3.2
9月末	11,212	△ 0.9	11,359	△ 0.7	96.1	3.9
10月末	10,892	△ 3.7	11,037	△ 3.5	96.0	4.0
11月末	12,107	7.0	12,266	7.2	96.7	3.3
12月末	12,465	10.2	12,630	10.4	96.7	3.4
2021年1月末	12,492	10.4	12,659	10.6	98.3	1.7
(期末)2021年2月22日	13,386	18.3	13,566	18.6	99.3	0.7

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2020年2月21日～2021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	12,169,148	21,126,555	9,885,166	17,589,670

(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	78,746,765千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	130,753,086千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.60

(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

2020年2月21日～2021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

2021年2月22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	14,991,687	17,275,669	36,859,368

(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79,813,755千口です。

投資信託財産の構成

2021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	36,859,368	99.5
コール・ローン等、その他	183,102	0.5
投資信託財産総額	37,042,471	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

(2021年2月22日現在)

項目	当期末
(A)資産	37,042,471,481円
コール・ローン等	24,982,516
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	36,859,368,807
未収入金	158,120,158
(B)負債	183,568,639
未払解約金	157,647,107
未払信託報酬	25,737,762
その他未払費用	183,770
(C)純資産総額(A-B)	36,858,902,842
元本	27,535,698,674
次期繰越損益金	9,323,204,168
(D)受益権総口数	27,535,698,674口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,386円

(注) 期首元本額	23,858,248,588円
期中追加設定元本額	19,379,876,555円
期中一部解約元本額	15,702,426,469円

損益の状況

当期(2020年2月21日～2021年2月22日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 4,240円
受取利息	1,326
支払利息	△ 5,566
(B)有価証券売買損益	6,070,209,483
売買益	7,431,091,036
売買損	△ 1,360,881,553
(C)信託報酬等	△ 46,584,410
(D)当期損益金(A+B+C)	6,023,620,833
(E)前期繰越損益金	664,862,066
(分配準備積立金)	(745,543,591)
(繰越欠損金)	(△ 80,681,525)
(F)追加信託差損益金*	2,634,721,269
(配当等相当額)	(4,910,517,508)
(売買損益相当額)	(△ 2,275,796,239)
(G)合計(D+E+F)	9,323,204,168
次期繰越損益金(G)	9,323,204,168
追加信託差損益金	2,634,721,269
(配当等相当額)	(4,950,437,680)
(売買損益相当額)	(△ 2,315,716,411)
分配準備積立金	6,688,482,899

- (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	649,332,629円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	5,293,606,679円
(c) 信託約款に定める収益調整金	4,950,437,680円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	745,543,591円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	11,638,920,579円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	4,226.85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

代表取締役社長に大関洋が就任いたしました。

(2020年3月25日)

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 21 期

(計算期間：2020年2月21日～2021年2月22日)

運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への投資は行いません。



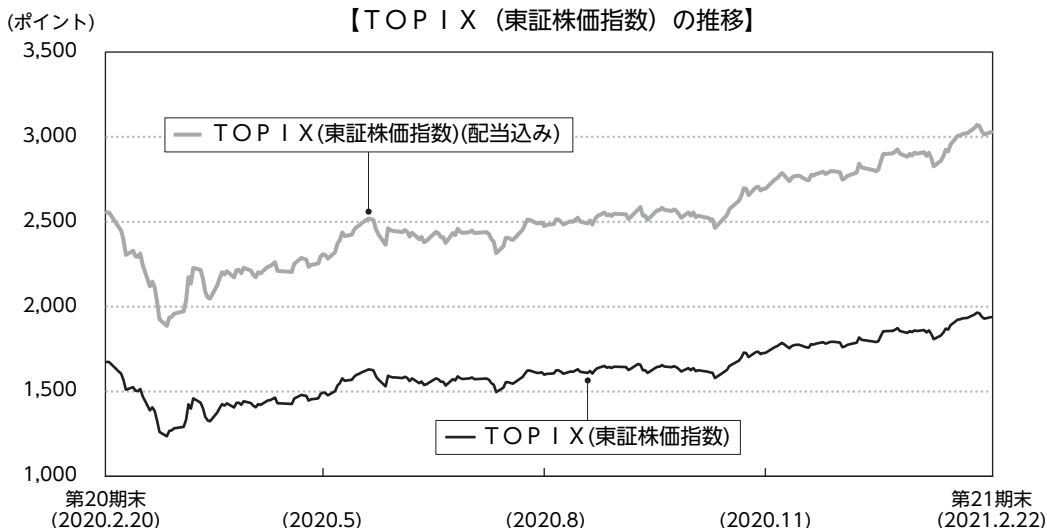
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年2月21日～2021年2月22日

国内株式市況



当期の国内株式市場は上昇しました。

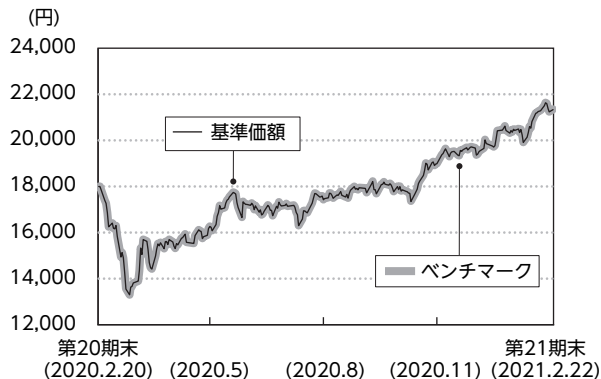
期初以降、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大懸念から市場心理が大幅に悪化し、2020年3月中旬にかけて株価は大幅に下落しました。

その後、各国における緊急経済対策の発表や中央銀行の金融支援策の決定等を背景に株価は反発し、新型コロナウイルスの感染拡大に落ち着きが見られたことによる経済活動再開への期待感の高まりなどから6月上旬まで上昇基調となりました。

6月中旬には新型コロナウイルスの感染拡大第2波に対する警戒感や「香港国家安全維持法案」を巡る米中対立の懸念から株価は下落しました。7月には新型コロナウイルスの治療薬開発への期待感などを背景に上昇する場面もありましたが、感染拡大に歯止めがかからなかったことや米中対立の激化、加えて円高進行や企業業績の悪化が懸念され、株価は下落する展開となりました。8月に入ると米株高に加えて国内企業の第1四半期決算の内容や通期予想の下方修正が想定内であったこと、ワクチン開発への期待感などを背景に株価は反発し、その後はおおむね横ばいで推移しました。

11月以降は米大統領選において民主党のバイデン候補が当選を確実にしたことで先行き不透明感が後退したことや、ワクチン実用化への期待感から世界的な株高の流れが強まり、国内株式市場も上昇基調となりました。1月以降は国内における緊急事態宣言の再発令などを背景に株価は下落する場面もありましたが、米ジョージア州の上院決選投票の結果を受けて、バイデン次期政権下における追加経済対策への期待感が高まったことなどから株価は上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

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

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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

また資金の流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+18.5%となり、ベンチマーク騰落率（+18.6%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率		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
		円	%		%	%			
17期(2017年2月20日)	15,544		21.6	15,699		21.7	97.7	2.3	40,998
18期(2018年2月20日)	18,076		16.3	18,261		16.3	98.2	1.9	50,868
19期(2019年2月20日)	16,916	△	6.4	17,088	△	6.4	98.4	1.5	58,316
20期(2020年2月20日)	18,004		6.4	18,182		6.4	98.3	1.6	68,225
21期(2021年2月22日)	21,336		18.5	21,558		18.6	99.3	0.7	170,293

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入比率	株式先物比率
		円	%		%	%		
(期首)2020年2月20日	18,004		－	18,182		－	98.3	1.6
2月末	16,251	△	9.7	16,410	△	9.7	97.9	1.8
3月末	15,273	△	15.2	15,427	△	15.2	96.7	3.7
4月末	15,931	△	11.5	16,098	△	11.5	95.9	4.2
5月末	17,014	△	5.5	17,195	△	5.4	95.4	5.6
6月末	16,986	△	5.7	17,163	△	5.6	98.3	1.7
7月末	16,304	△	9.4	16,472	△	9.4	97.2	2.7
8月末	17,635	△	2.0	17,818	△	2.0	96.7	3.2
9月末	17,860	△	0.8	18,050	△	0.7	96.1	3.9
10月末	17,352	△	3.6	17,538	△	3.5	96.0	4.0
11月末	19,290		7.1	19,492		7.2	96.7	3.3
12月末	19,863		10.3	20,070		10.4	96.7	3.4
2021年1月末	19,909		10.6	20,117		10.6	98.3	1.7
(期末)2021年2月22日	21,336		18.5	21,558		18.6	99.3	0.7

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年2月21日～2021年2月22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（17,705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

2020年2月21日～2021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
		43,919	71,806,619	3,992	6,940,146
		(△ 6,715)			

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	33,249	34,694	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2020年2月21日～2021年2月22日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	374	2,423,034	6,470	NTTドコモ	443	1,705,218	3,843
ソニー	223	1,442,267	6,444	トヨタ自動車	45	338,103	7,382
キーエンス	37	1,398,831	37,806	日本電信電話	81	215,540	2,651
ソフトバンクグループ	275	1,142,633	4,145	エムスリー	23	210,146	9,097
日本電信電話	440	1,092,980	2,482	日立ハイテック	20	161,636	7,962
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,375	1,017,404	428	ソニーフィナンシャルホールディングス	49	128,675	2,594
武田薬品工業	294	990,131	3,362	日立化成	27	125,435	4,611
KDDI	303	946,036	3,116	ファミリーマート	48	109,945	2,281
信越化学工業	67	796,653	11,750	三菱商事	45	108,153	2,382
任天堂	20	775,927	37,666	バンダイナムコホールディングス	11	103,653	9,092

(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

2021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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)				
極洋	1	2	2	8,845
日本水産	38	80	80	40,360
マルハニチロ	5	13	13	33,728
雪国まいたけ	-	5	5	9,547
カネコ種苗	1	2	2	4,152
サカタのタネ	4	10	10	40,352
ホフト	2	7	7	15,658
鉱業(0.2%)				
住石ホールディングス	12	2	2	297
日鉄鉱業	0.900	2	2	11,980
三井松島ホールディングス	0.900	5	5	4,939
国際石油開発帝石	154	318	318	247,078
石油資源開発	5	11	11	25,300
K&Oエナジーグループ	1	4	4	6,148

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(2.3%)				
ヒノキヤグループ	1	2	2	4,601
ショーボンドホールディングス	6	12	12	58,652
ミライト・ホールディングス	11	30	30	51,360
タマホーム	2	5	5	9,869
ファーストコーポレーション	3	5	5	4,118
ベステラ	1	-	-	-
スペースパリュールホールディングス	4	10	10	8,628
ダイセキ環境ソリューション	1	3	3	2,707
安藤・間	23	55	55	43,401
東急建設	11	25	25	13,817
コムシスホールディングス	13	30	30	99,775
ピーアールホールディングス	4	10	10	6,976
高松コンストラクショングループ	2	5	5	11,485
東建コーポレーション	1	2	2	23,139

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
ソネック	－	5	4,243
ヤマウラ	1	4	4,288
大成建設	29	62	235,738
大林組	89	199	187,106
清水建設	90	187	153,024
飛鳥建設	2	5	6,378
長谷工コーポレーション	34	65	88,687
松井建設	3	7	5,656
銭高組	0.400	1	4,575
鹿島建設	70	146	208,176
不動テトラ	2	4	8,844
大末建設	1	5	4,630
鉄建建設	1	4	7,864
西松建設	6	14	37,122
三井住友建設	21	48	22,218
大豊建設	2	4	16,192
前田建設工業	22	50	49,999
佐田建設	4	9	4,099
ナカノフドー建設	3	10	3,932
奥村組	4	11	29,502
東鉄工業	3	8	22,772
浅沼組	1	2	10,872
戸田建設	37	83	61,669
熊谷組	4	9	26,040
北野建設	0.700	1	4,212
植木組	0.700	1	4,365
矢作建設工業	3	8	7,453
ピーエス三菱	2	6	4,658
日本ハウスホールディングス	6	13	4,569
大東建託	10	21	269,230
新日本建設	3	8	7,191
N I P P O	7	16	46,728
東亜道路工業	0.600	1	4,968
前田道路	9	12	24,837
日本道路	0.900	1	15,219
東亜建設工業	2	5	11,501
日本国土開発	6	19	10,825
若築建設	1	3	4,597
東洋建設	10	22	12,387
五洋建設	35	84	67,495
世紀東急工業	4	9	8,544

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
福田組	1	2	11,546
住友林業	22	47	98,653
日本基礎技術	4	8	4,332
巴コーポレーション	4	10	4,168
大和ハウス工業	88	184	590,720
ライト工業	5	11	18,775
積水ハウス	97	216	451,160
日特建設	2	5	4,239
北陸電気工事	－	3	4,172
ユアテック	5	11	9,302
日本リーテック	－	4	10,474
四電工	0.700	1	4,206
中電工	3	9	20,341
関電工	12	32	28,730
きんでん	21	43	76,723
東京エネシス	3	6	6,058
トーエネック	0.900	2	7,470
住友電設	2	5	13,630
日本電設工業	4	11	21,252
協和エクシオ	13	30	82,476
新日本空調	2	5	12,031
九電工	6	14	47,460
三機工業	6	14	18,403
日揮ホールディングス	27	66	90,378
中外炉工業	1	2	4,360
ヤマト	2	6	4,281
太平電業	2	4	11,717
高砂熱学工業	7	18	28,887
三晃金属工業	0.700	1	4,642
朝日工業社	0.600	1	4,515
明星工業	5	12	10,397
大気社	4	9	28,585
ダイダン	2	4	12,359
日比谷総合設備	2	6	12,019
OSJBホールディングス	14	29	7,944
東洋エンジニアリング	3	－	－
レイズネクスト	4	10	12,593
食料品(3.3%)			
ニッポン	8	18	30,088
日清製粉グループ本社	32	72	124,862
昭和産業	2	5	17,523

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	千株	千円
		千株	千株	千円
鳥越製粉	2	5		4,896
中部飼料	3	7		11,255
フィード・ワン	19	8		7,860
東洋精糖	1	—		—
日本甜菜製糖	1	3		5,560
三井製糖	2	5		9,690
塩水港精糖	7	18		4,309
日新製糖	1	3		5,610
森永製菓	6	15		59,700
中村屋	0.700	1		5,955
江崎グリコ	8	17		78,848
名糖産業	1	3		4,545
井村屋グループ	1	3		9,057
不二家	1	4		9,339
山崎製パン	21	48		90,576
モロゾフ	0.500	1		5,650
亀田製菓	1	3		17,316
寿スピリッツ	2	6		42,284
カルビー	13	29		84,767
森永乳業	5	11		56,994
六甲バター	1	4		7,299
ヤクルト本社	19	44		243,320
明治ホールディングス	18	42		294,831
雪印メグミルク	6	15		33,710
プリマハム	4	9		30,060
日本ハム	10	24		114,292
林兼産業	—	7		4,444
丸大食品	3	6		10,697
S F o o d s	2	5		19,750
柿安本店	1	2		5,992
伊藤ハム米久ホールディングス	18	41		30,694
サッポロホールディングス	9	21		48,919
アサヒグループホールディングス	59	139		635,810
キリンホールディングス	120	271		573,799
宝ホールディングス	21	47		71,052
オエノンホールディングス	7	18		7,280
養命酒製造	0.900	2		4,232
コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス	20	49		89,768
サントリー食品インターナショナル	19	42		161,356
グアールグループホールディングス	1	3		19,476
伊藤園	8	19		122,414

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
キーコーヒー	2	6		13,589
日清オイリオグループ	3	8		26,199
不二製油グループ本社	7	15		49,764
かどや製油	0.500	1		4,504
J-オイルミルズ	1	3		11,415
キッコーマン	20	46		340,400
味の素	63	152		345,113
キューピー	15	35		85,226
ハウス食品グループ本社	10	23		88,908
カゴメ	10	26		87,174
アリアケジャパン	2	5		39,440
ピエトロ	1	2		4,272
エバラ食品工業	0.800	0.900		2,382
ニチレイ	13	30		85,613
東洋水産	14	32		151,833
イートアンドホールディングス	1	2		4,462
大冷	0.900	2		4,120
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1	4		4,689
日清食品ホールディングス	12	25		209,334
永谷園ホールディングス	1	3		7,309
一正蒲鉾	1	3		4,280
フジッコ	3	6		13,820
ロック・フィールド	3	6		10,729
日本たばこ産業	164	343		664,413
ケンコーマヨネーズ	1	3		7,893
わらべや日洋ホールディングス	1	4		7,207
なとり	1	3		7,268
ピックルスコオペレーション	—	1		5,370
北の達人コーオペレーション	10	22		14,182
ユーグレナ	12	27		27,423
ミヨシ油脂	1	3		4,320
理研ビタミン	1	6		8,178
繊維製品(0.5%)				
片倉工業	4	8		11,684
グンゼ	2	4		17,434
東洋紡	11	24		33,147
ユニチカ	8	18		8,161
富士紡ホールディングス	1	3		12,870
倉敷紡績	2	5		11,136
シキボウ	1	—		—
日本毛織	9	20		19,639

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
帝国繊維	3	7	15,925
帝人	22	58	110,132
東レ	201	452	319,544
サカイオーベックス	1	1	5,416
住江織物	0.800	—	—
日本フェルト	3	9	4,351
イチカワ	1	3	4,249
アツギ	2	8	4,695
セーレン	6	15	29,398
ソトー	1	5	4,316
東海染工	1	3	4,173
小松マテーレ	4	10	10,444
ワコールホールディングス	7	15	34,678
ホギメディカル	3	8	26,754
クラウドシアホールディングス	3	16	4,704
T S I ホールディングス	9	19	5,282
マツオカコーポレーション	0.900	2	4,023
ワールド	3	8	11,324
三陽商会	1	0.400	291
オンワードホールディングス	16	37	10,350
ゴールドウイン	5	10	76,014
デサント	5	10	18,949
ヤマトインターナショナル	4	12	4,166
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	1	3	17,993
王子ホールディングス	116	281	199,299
日本製紙	12	27	38,805
三菱製紙	4	11	4,295
北越コーポレーション	18	44	22,975
中越パルプ工業	1	3	4,327
大王製紙	12	30	66,942
阿波製紙	1	0.200	90
レンゴー	26	64	56,607
トーモク	1	3	7,102
ザ・パックス	2	4	12,863
化学(7.4%)			
クラレ	43	98	117,566
旭化成	184	413	474,835
昭和電工	19	47	122,860
住友化学	204	491	256,563
住友精化	1	3	12,060

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産化学	15	34	214,656
ラサ工業	—	2	4,496
クレハ	2	5	38,826
多木化学	0.800	2	15,336
テイカ	2	4	6,624
石原産業	5	11	9,195
片倉コープアグリ	1	3	4,382
日本曹達	4	8	29,449
東ソー	43	96	191,938
トクヤマ	8	18	49,617
セントラル硝子	5	11	27,381
東亞合成	17	38	47,358
大阪ソーダ	2	6	16,650
関東電化工業	6	14	13,127
デンカ	10	22	93,936
信越化学工業	47	115	2,164,470
日本カーバイド工業	1	3	4,415
堺化学工業	1	4	8,694
第一稀元素化学工業	3	6	6,589
エア・ウォーター	25	63	111,029
日本酸素ホールディングス	26	51	103,262
日本化学工業	0.900	1	5,958
日本パーカライジニング	14	31	34,681
高压ガス工業	4	9	7,316
四国化成工業	4	8	10,466
ステラケミファ	1	3	11,135
保土谷化学工業	1	1	8,874
日本触媒	4	11	65,427
大日精化工業	2	5	12,500
カネカ	7	16	68,827
三菱瓦斯化学	26	62	162,312
三井化学	25	53	174,636
J S R	25	62	212,553
東京応化工業	4	10	72,867
大阪有機化学工業	2	5	22,272
三菱ケミカルホールディングス	186	417	305,328
K H ネオケム	4	10	25,832
ダイセル	38	83	65,022
住友ベークライト	4	9	43,463
積水化学工業	59	132	266,772
日本ゼオン	25	56	93,120

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイカ工業	8	17	66,816
宇部興産	14	31	67,441
積水樹脂	5	10	21,279
タキロンシーアイ	6	13	9,328
旭有機材	1	3	5,155
日立化成	12	-	-
ニチバン	1	3	6,012
リケンテクノス	7	15	7,524
大倉工業	1	2	5,800
積水化成成品工業	3	8	4,712
群栄化学工業	0.700	1	4,253
タイガースポリマー	3	10	4,856
ダイキョーニシカワ	5	13	10,546
竹本容器	2	-	-
森六ホールディングス	1	3	6,959
日本化薬	17	38	40,916
カーリットホールディングス	3	6	4,513
日本精化	2	4	6,376
扶桑化学工業	2	4	19,453
トリケミカル研究所	0.600	5	23,800
ADEKA	12	28	53,468
日油	10	23	137,475
新日本理化	8	15	4,240
ハリマ化成グループ	2	4	4,360
花王	68	152	1,109,402
第一工業製薬	1	2	7,917
日華化学	2	4	4,262
ニイタカ	0.800	1	4,056
三洋化成工業	1	3	19,351
有機合成薬品工業	6	13	3,907
大日本塗料	3	7	6,560
日本ペイントホールディングス	23	51	448,565
関西ペイント	31	70	204,481
中国塗料	7	15	14,040
日本特殊塗料	2	4	5,423
藤倉化成	3	8	4,410
太陽ホールディングス	2	4	27,094
DIC	11	26	75,504
サカタインクス	6	13	15,000
東洋インキSCホールディングス	5	13	26,492
T&K TOKA	2	5	4,140

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富士フィルムホールディングス	54	112	709,296
資生堂	56	126	1,032,605
ライオン	36	82	180,307
高砂香料工業	1	4	10,436
マンダム	6	13	25,058
ミルボン	3	8	54,400
ファンケル	11	23	94,656
コーセー	5	12	217,200
コタ	1	3	6,763
シーボン	0.700	2	4,189
ポーラ・オルビスホールディングス	12	27	67,347
ノエビアホールディングス	2	5	26,271
アジュバンコスメジャパン	1	4	4,396
エステー	1	4	8,089
アグロカネショウ	1	2	4,382
コニシ	4	10	17,619
長谷川香料	3	11	21,461
星光PMC	2	5	4,174
小林製薬	8	17	196,721
荒川化学工業	2	5	6,863
メック	2	4	9,121
日本高純度化学	0.800	1	4,838
タカラバイオ	7	16	51,519
JCU	3	7	24,552
新田ゼラチン	2	6	4,216
OATアグリオ	-	3	4,428
デクセリアルズ	7	17	27,376
アース製薬	2	4	29,136
北興化学工業	2	5	6,171
大成ラミック	0.900	2	5,870
クミアイ化学工業	11	26	23,284
日本農薬	5	11	6,042
アキレス	2	4	6,542
有沢製作所	4	8	8,739
日東電工	19	40	384,744
レック	3	7	10,305
三光合成	5	5	2,575
藤森工業	2	5	26,391
前澤化成工業	1	4	4,259
未来工業	1	2	4,166
ウェーブロックホールディングス	-	4	3,596

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
J S P	1	3	6,715
エフピコ	3	11	49,725
天馬	1	4	10,320
信越ポリマー	5	9	10,064
東リ	7	17	4,214
ニフコ	10	23	88,803
バルカー	2	5	11,039
ユニ・チャーム	54	135	627,868
医薬品(5.6%)			
協和キリン	28	64	197,748
武田薬品工業	236	530	1,955,584
アステラス製薬	249	552	983,253
大日本住友製薬	21	47	80,457
塩野義製薬	36	80	466,042
わかもと製薬	7	13	3,381
あすか製薬	3	7	10,300
日本新薬	7	18	141,361
ビオフェルミン製薬	0.800	-	-
中外製薬	29	199	1,046,850
科研製薬	4	10	45,289
エーザイ	34	70	536,800
ロート製薬	14	30	90,196
小野薬品工業	65	146	447,252
久光製薬	7	18	130,795
持田製薬	3	8	36,476
参天製薬	52	110	174,334
扶桑薬品工業	1	2	5,573
ツムラ	8	21	73,165
日医工	8	18	20,018
キッセイ薬品工業	5	11	25,278
生化学工業	5	11	11,883
栄研化学	5	11	23,990
日水製薬	1	4	4,187
鳥居薬品	1	4	12,020
J C R ファーマ	2	18	58,860
東和薬品	3	9	20,516
富士製薬工業	1	4	5,504
沢井製薬	5	14	68,530
ゼリア新薬工業	5	11	23,478
第一三共	81	547	1,784,745
キョーリン製薬ホールディングス	6	14	27,227

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大幸薬品	1	7	10,311
ダイト	1	4	14,719
大塚ホールディングス	54	132	592,142
大正製薬ホールディングス	6	15	105,184
ペプチドリーム	14	32	175,608
石油・石炭製品(0.4%)			
日本コークス工業	24	53	5,605
ニチレキ	3	7	11,535
ユシロ化学工業	1	3	4,123
ビーピー・カストロール	1	-	-
富士石油	3	18	3,945
MORESCO	1	3	4,255
出光興産	32	70	194,133
ENEOSホールディングス	427	959	443,921
コスモエネルギーホールディングス	8	20	50,197
ゴム製品(0.6%)			
横浜ゴム	16	36	72,360
TOYOTIRE	16	33	64,041
ブリヂストン	87	169	711,730
住友ゴム工業	25	57	68,416
オカモト	1	3	16,048
フコク	2	5	4,194
ニッタ	3	6	15,813
住友理工	5	12	7,948
三ツ星ベルト	3	7	13,290
バンドー化学	5	11	8,254
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	4	9	41,705
AGC	28	58	228,442
日本板硝子	13	32	17,829
日本山村硝子	1	4	4,406
日本電気硝子	11	23	59,047
オハラ	1	2	5,130
住友大阪セメント	5	11	40,940
太平洋セメント	17	37	103,599
日本ヒューム	2	5	4,460
日本コンクリート工業	6	13	5,288
三谷セキサン	1	3	14,460
アジアパイルホールディングス	4	9	5,194
東海カーボン	29	62	94,384
日本カーボン	1	3	14,332

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
東洋炭素	1	3	7,351	
ノリタケカンパニーリミテド	1	3	12,652	
TOTO	20	45	311,675	
日本碍子	34	70	131,858	
日本特殊陶業	22	48	90,598	
MARUWA	1	2	23,254	
品川リフラクトリーズ	0.700	1	4,419	
黒崎播磨	0.600	1	5,307	
ヨータイ	2	4	5,086	
イソライト工業	3	7	4,672	
ニッカトー	2	5	3,728	
フジミンコーポレーテッド	2	5	21,547	
クニミネ工業	1	3	3,996	
ニチアス	7	16	40,024	
ニチハ	4	8	27,100	
鉄鋼(0.7%)				
日本製鉄	125	300	466,846	
神戸製鋼所	51	115	73,394	
中山製鋼所	3	11	4,651	
合同製鐵	1	3	7,072	
ジェイエフイーホールディングス	75	182	203,011	
東京製鐵	13	24	17,761	
共英製鋼	3	7	10,167	
大和工業	6	13	36,340	
東京鐵鋼	1	2	4,816	
大阪製鐵	1	3	4,144	
淀川製鋼所	3	8	19,575	
丸一鋼管	9	20	51,291	
モリ工業	0.800	1	4,432	
大同特殊鋼	4	10	48,358	
日本高周波鋼業	4	12	4,368	
日本冶金工業	2	4	10,383	
山陽特殊製鋼	1	7	13,292	
愛知製鋼	1	3	11,462	
日立金属	30	59	102,286	
日本金属	2	-	-	
大太平洋金属	1	4	10,750	
新日本電工	18	40	12,128	
栗本鐵工所	1	2	5,118	
三菱製鋼	2	2	1,528	
日亜鋼業	5	14	4,145	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
日本精線	0.300	1	4,020	
シンニッタン	4	20	4,511	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	4	9	7,619	
日本軽金属ホールディングス	71	17	37,272	
三井金属鉱業	7	17	66,045	
東邦亜鉛	1	3	8,452	
三菱マテリアル	18	41	108,076	
住友金属鉱山	35	80	449,586	
DOWAホールディングス	7	15	66,382	
古河機械金属	5	10	14,060	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	6	5,398	
東邦チタニウム	5	11	11,085	
UACJ	4	9	24,067	
CKサンエツ	0.600	1	5,141	
古河電気工業	8	19	56,271	
住友電気工業	105	220	340,890	
フジクラ	33	76	39,952	
昭和電線ホールディングス	3	6	10,693	
東京特殊電線	0.100	1	4,413	
タツタ電線	5	11	7,226	
カナレ電気	1	-	-	
平河ヒューテック	1	3	4,161	
リョービ	3	7	10,186	
アーレスティ	3	10	4,293	
アサヒホールディングス	4	11	50,917	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	1	3	4,994	
宮地エンジニアリンググループ	0.900	2	4,664	
トーカロ	7	16	22,868	
アルファ	1	4	4,603	
SUMCO	33	80	203,364	
川田テクノロジーズ	0.600	1	6,084	
RSTechnologies	0.800	2	12,660	
東洋製鐵グループホールディングス	17	40	54,576	
ホッカンホールディングス	1	3	4,576	
コロナ	1	4	4,184	
横河ブリッジホールディングス	5	10	20,649	
三和ホールディングス	27	59	78,111	
文化シャッター	8	18	18,600	
三協立山	3	8	6,706	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルインコ	2	4	4,285
LIXIL	41	86	262,570
日本フィルコン	3	8	4,150
ノーリツ	5	13	21,942
長府製作所	2	6	13,491
リンナイ	5	12	140,958
ダイニチ工業	2	4	3,919
日東精工	3	9	6,003
三洋工業	0.900	2	4,074
岡部	5	12	10,099
ジーテクト	3	7	11,294
東プレ	5	11	18,714
高周波熱錬	5	12	6,534
東京製綱	2	4	6,502
サンコール	1	6	3,311
モリテックスチール	5	9	4,074
パイオラックス	4	9	14,824
エイチワン	2	6	4,786
日本発条	30	62	50,993
立川ブラインド工業	1	3	4,067
三益半導体工業	2	4	12,980
機械(5.6%)			
日本製鋼所	8	19	55,141
三浦工業	12	27	167,622
タクマ	9	21	43,292
ツガミ	5	13	21,418
オークマ	3	7	43,581
芝浦機械	3	6	19,214
アマダ	35	92	119,103
アイダエンジニアリング	7	16	15,790
滝澤鉄工所	1	4	4,341
F U J I	12	25	67,208
牧野フライス製作所	3	7	29,785
オーエスジー	13	31	61,360
ダイジェット工業	1	3	4,284
旭ダイヤモンド工業	7	16	8,415
DMG森精機	17	39	63,800
ソディック	6	13	13,576
ディスコ	3	8	305,300
日東工器	1	3	5,574
日進工具	0.800	2	6,865

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パンチ工業	4	-	-
豊和工業	2	4	4,118
〇KK	2	-	-
東洋機械金属	3	9	4,167
エンシュウ	1	4	4,224
島精機製作所	4	9	21,196
オプトラン	3	7	21,922
NCホールディングス	2	7	4,693
イワキ	1	5	4,263
フリュー	2	6	6,944
ヤマシンフィルタ	6	12	11,303
日阪製作所	3	7	6,559
やまびこ	5	12	14,359
平田機工	1	3	21,840
ペガサスマシン製造	3	12	5,520
マルマエ	-	1	1,956
タツモ	-	2	4,438
ナプテスコ	16	37	180,306
三井海洋開発	3	6	11,738
レオン自動機	2	6	7,037
S M C	8	18	1,231,582
ヤマモーターロボティクスホールディングス	2	-	-
ホソカワミクロン	1	2	14,410
ユニオンツール	1	2	8,004
オイレス工業	3	8	14,933
日精イー・エス・ビー機械	0.900	1	10,134
サトーホールディングス	4	8	20,725
技研製作所	2	5	29,064
日本エアータック	1	-	-
カワタ	1	4	3,891
日精樹脂工業	2	4	4,420
オカダアイオン	1	3	4,284
小松製作所	128	288	939,466
住友重機械工業	16	36	105,886
日立建機	11	29	99,085
日工	3	9	6,906
巴工業	1	2	5,135
井関農機	2	6	9,862
T O W A	2	5	12,856
丸山製作所	1	2	4,284
北川鉄工所	1	3	4,581

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
ローツェ	1	2	22,708
タカキタ	3	6	4,110
クボタ	150	334	827,705
荏原実業	0.900	1	7,440
三菱化工機	1	2	5,932
月島機械	5	11	15,128
帝国電機製作所	2	4	5,324
新東工業	6	15	11,460
澁谷工業	2	5	19,768
アイチコーポレーション	4	11	9,867
小森コーポレーション	7	16	11,680
鶴見製作所	2	4	8,462
荏原製作所	11	26	108,504
石井鐵工所	-	1	4,407
西島製作所	2	6	5,350
北越工業	2	6	7,378
ダイキン工業	36	81	1,794,520
オルガノ	1	2	12,999
トーヨーカネツ	1	2	6,664
栗田工業	15	34	152,835
椿本チエイン	4	9	26,763
大同工業	-	5	4,495
木村化工機	3	-	-
アネスト岩田	4	10	11,630
ダイフク	14	35	396,981
サムコ	0.900	1	5,912
加藤製作所	1	4	4,408
油研工業	1	-	-
タダノ	13	30	31,200
フジテック	10	21	55,538
C K D	7	14	36,630
キトー	2	5	7,948
平和	7	17	28,497
理想科学工業	2	4	6,688
SANKYO	6	15	44,900
日本金銭機械	3	8	4,424
マースグループホールディングス	1	4	6,380
フクシマガリレイ	1	4	18,458
ダイコク電機	1	4	4,436
竹内製作所	4	10	29,735
アマノ	7	16	40,380

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
J U K I	4	8	7,387
サンデンホールディングス	3	-	-
蛇の目ミシン工業	4	5	4,715
マックス	4	8	14,203
グローリー	7	16	37,556
新晃工業	2	5	11,652
大和冷機工業	4	10	11,067
セガサミーホールディングス	28	58	106,256
日本ピストンリング	1	4	4,576
リケン	1	3	6,747
T P R	3	8	13,097
ツバキ・ナカシマ	5	12	15,542
ホシザキ	8	20	193,965
大豊工業	2	-	-
日本精工	53	130	132,732
N T N	65	147	46,462
ジェイテクト	27	61	70,020
不二越	2	5	27,641
日本トムソン	8	17	9,957
T H K	16	39	144,508
ユーシン精機	2	4	4,158
前澤給装工業	1	2	5,135
イーグル工業	3	7	9,108
日本ピラー工業	2	6	11,027
キッツ	11	19	11,465
マキタ	37	83	390,154
日立造船	22	50	35,703
三菱重工業	47	100	306,111
I H I	20	42	81,467
スター精密	4	9	15,856
電気機器(18.0%)			
日清紡ホールディングス	18	39	31,356
イビデン	17	30	147,974
コニカミノルタ	62	129	71,115
ブラザー工業	34	77	175,983
ミネベアミツミ	52	109	293,433
日立製作所	136	306	1,512,271
三菱電機	284	637	1,020,956
富士電機	17	38	179,136
東洋電機製造	1	3	4,235
安川電機	30	68	388,962

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
シンフォニアテクノロジー	3	8	11,113
明電舎	5	10	25,617
オリジン	1	3	4,393
山洋電気	1	3	18,724
デンヨー	2	5	11,431
東芝テック	3	6	26,248
芝浦メカトロニクス	0.500	1	5,577
マブチモーター	7	17	85,976
日本電産	34	153	2,247,310
トレックス・セミコンダクター	1	3	5,470
東光高岳	1	3	4,992
ダブル・スコープ	4	12	9,979
ダイヘン	3	7	32,760
ヤーマン	4	10	20,124
JVCケンウッド	23	55	10,653
ミマキエンジニアリング	3	8	4,950
I P E X	1	3	6,072
日新電機	6	14	18,923
大崎電気工業	5	12	7,734
オムロン	25	53	500,202
日東工業	4	9	19,683
I D E C	4	8	15,988
不二電機工業	1	3	4,067
ジーエス・ユアサコーポレーション	9	22	77,173
サクサホールディングス	1	3	4,485
メルコホールディングス	1	2	8,602
日本電気	34	81	509,490
富士通	27	57	912,947
沖電気工業	11	25	27,195
電気興業	1	3	9,123
サンケン電気	3	7	41,850
アイホン	1	3	6,310
ルネサスエレクトロニクス	135	274	344,121
セイコーエプソン	35	79	139,848
ワコム	19	46	36,695
アルバック	5	11	59,787
E I Z O	2	5	20,682
ジャパンディスプレイ	82	217	10,449
日本信号	7	14	14,259
京三製作所	6	13	5,836
能美防災	3	8	18,950

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホーチキ	2	4	5,952
エレコム	3	7	36,354
パナソニック	324	679	979,931
シャープ	32	73	157,932
アンリツ	18	38	91,154
富士通ゼネラル	7	19	58,227
ソニー	179	399	4,783,614
T D K	13	30	500,808
帝国通信工業	1	3	4,229
タムラ製作所	9	22	12,732
アルプスアルパイン	25	52	74,867
池上通信機	1	4	4,081
日本電波工業	3	6	4,302
鈴木	2	-	-
日本トリム	0.400	1	6,146
ローランドディー・ジー	1	3	7,254
フォスター電機	3	6	8,756
S M K	0.700	1	4,824
ヨコオ	1	4	14,085
ホシデン	7	17	18,913
ヒロセ電機	4	9	164,444
日本航空電子工業	6	14	24,761
T O A	3	7	6,772
マクセルホールディングス	6	12	18,338
古野電気	3	8	9,380
ユニデンホールディングス	0.900	2	4,712
スミダコーポレーション	2	5	5,545
アイコム	1	2	7,228
リオン	1	2	7,924
船井電機	2	-	-
横河電機	26	63	136,723
新電元工業	1	2	7,900
アズビル	17	43	215,931
東亜ディーケーケー	1	4	4,076
日本光電工業	11	26	79,426
共和電業	4	10	4,196
日本電子材料	1	2	4,376
堀場製作所	5	12	84,924
アドバンテスト	21	47	458,358
小野測器	3	7	4,251
エスペック	2	5	10,791

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
キーエンス	25	62	3,552,550
日置電機	1	3	11,811
シスメックス	20	49	584,472
日本マイクロニクス	4	11	20,956
メガチップス	2	6	22,048
OBARAGROUP	1	3	14,689
澤藤電機	0.900	1	2,319
原田工業	1	4	4,478
コーセル	3	7	9,079
イリソ電子工業	2	5	27,216
オプテックスグループ	4	10	18,501
千代田インテグレ	1	2	4,860
アイ・オー・データ機器	1	-	-
レーザーテック	12	28	408,240
スタンレー電気	20	44	153,768
岩崎電気	1	3	4,563
ウシオ電機	16	32	45,027
岡谷電機産業	4	11	4,350
ハリオステクノホールディング	4	-	-
エノモト	1	2	4,856
日本セラミック	2	6	17,810
遠藤照明	2	7	5,046
古河電池	2	4	7,146
双信電機	-	9	4,067
山一電機	2	4	6,216
図研	1	4	12,095
日本電子	5	11	50,054
カシオ計算機	25	51	105,421
ファナック	27	55	1,542,001
日本シイエムケイ	6	13	5,986
エンプラス	1	2	13,470
大真空	-	2	5,628
ローム	12	26	303,955
浜松ホトニクス	20	45	311,674
三井ハイテック	3	6	28,117
新光電気工業	9	21	64,949
京セラ	40	97	674,956
太陽誘電	12	28	165,272
村田製作所	83	187	1,850,898
双葉電子工業	4	10	10,551
北陸電気工業	1	4	4,216

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチコン	9	20	23,054
日本ケミコン	2	6	11,820
KOA	4	8	13,376
市光工業	4	9	7,248
小糸製作所	17	38	296,050
ミツバ	5	11	7,300
SCREENホールディングス	4	11	104,007
キャノン電子	3	5	9,813
キャノン	153	316	740,836
リコー	72	162	153,765
象印マホービン	8	17	31,372
MUTOHホールディングス	1	2	4,293
東京エレクトロン	18	37	1,726,990
輸送用機器(6.9%)			
トヨタ紡織	8	18	32,233
芦森工業	1	4	4,536
ユニプレス	5	10	10,004
豊田自動織機	23	51	491,232
モリタホールディングス	5	10	18,492
三櫻工業	3	8	8,272
デンソー	62	140	936,748
東海理化電機製作所	7	16	30,340
三井E&Sホールディングス	10	24	10,892
川崎重工業	22	49	114,427
名村造船所	9	-	-
日本車輛製造	1	2	5,729
三菱ロジスネクスト	3	8	9,693
近畿車輛	1	3	4,263
日産自動車	335	751	441,456
いすゞ自動車	82	184	207,602
トヨタ自動車	317	645	5,205,148
日野自動車	35	79	80,953
三菱自動車工業	105	236	69,148
エフテック	0.900	6	4,535
武蔵精密工業	6	14	26,937
日産車体	5	9	7,514
新明和工業	7	18	17,298
極東開発工業	5	11	17,655
日信工業	5	-	-
トピー工業	2	5	7,529
ティラド	1	3	5,731

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	千円
曙ブレーキ工業	15	35	5,740	
タチエス	4	9	10,789	
NOK	15	30	45,368	
フタバ産業	7	16	8,640	
K Y B	3	7	21,371	
大同メタル工業	5	13	7,365	
プレス工業	14	31	10,491	
ミクニ	5	15	4,419	
太平洋工業	5	13	16,146	
ケーヒン	6	-	-	
河西工業	3	9	3,803	
アイシン精機	23	46	169,988	
マツダ	83	200	171,885	
今仙電機製作所	2	5	4,389	
本田技研工業	223	501	1,494,407	
スズキ	56	126	621,635	
S U B A R U	88	182	371,794	
安永	1	-	-	
ヤマハ発動機	37	90	217,141	
ショーワ	6	-	-	
T B K	4	9	4,073	
エクセディ	3	8	14,311	
豊田合成	9	20	58,833	
愛三工業	4	10	5,780	
日本プラスト	2	-	-	
ヨロズ	2	5	7,199	
エフ・シー・シー	4	10	18,127	
シマノ	10	23	607,179	
テイ・エステック	6	14	45,140	
ジャムコ	1	6	5,505	
精密機器(2.6%)				
テルモ	80	195	835,921	
クリエートメディック	1	-	-	
日機装	8	20	22,145	
日本エム・ディ・エム	1	3	7,422	
島津製作所	34	82	357,930	
J M S	2	5	5,308	
長野計器	2	4	4,627	
ブイ・テクノロジー	1	3	17,820	
東京計器	1	4	4,078	
愛知時計電機	-	1	4,395	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	千円
インターアクション	1	3	8,611	
オーバル	7	4	1,342	
東京精密	5	10	54,891	
マニー	11	25	68,453	
ニコン	46	97	89,418	
トプコン	14	32	40,767	
オリンパス	157	352	790,224	
理研計器	2	5	15,629	
タムロン	2	5	10,041	
H O Y A	56	126	1,652,090	
シード	1	-	-	
ノーリツ鋼機	1	5	13,594	
エー・アンド・デイ	2	5	6,604	
朝日インテック	24	67	220,088	
シチズン時計	33	80	31,389	
リズム	2	6	4,740	
大研医器	1	7	4,182	
メニコン	3	9	66,738	
松風	1	2	5,243	
セイコーホールディングス	4	9	15,120	
ニプロ	19	47	65,930	
その他製品(2.5%)				
スノーピーク	1	3	12,046	
パラマウントベッドホールディングス	3	6	27,694	
トランザクション	1	-	-	
粧美堂	4	10	4,242	
ニホンフラッシュ	1	5	6,743	
前田工織	3	7	20,762	
永大産業	5	14	4,409	
アートネイチャー	3	6	4,355	
バンダイナムコホールディングス	29	52	460,808	
共立印刷	11	34	4,284	
S H O E I	1	5	23,856	
フランスベッドホールディングス	4	8	7,888	
パイロットコーポレーション	4	11	37,346	
萩原工業	1	3	5,236	
トッパン・フォームズ	6	11	11,856	
フジシールインターナショナル	6	13	28,151	
タカラトミー	12	28	28,571	
廣済堂	2	4	4,492	
アーク	19	-	-	

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
プロネクサス	2	5	6,644
ホクシン	11	37	4,366
大建工業	1	4	8,651
凸版印刷	40	96	162,888
大日本印刷	37	77	149,611
共同印刷	0.900	2	6,200
N I S S H A	5	13	18,877
光村印刷	1	-	-
TAKARA&COMPANY	1	3	5,409
アシックス	23	56	100,222
ツツミ	0.900	2	4,816
ローランド	-	3	12,950
小松ウオール工業	0.900	2	4,641
ヤマハ	16	37	218,683
河合楽器製作所	0.900	1	6,570
ピジョン	17	40	167,281
オリバー	0.700	1	4,116
キングジム	2	5	4,701
リンテック	6	13	32,844
イトーキ	6	12	4,622
任天堂	17	36	2,483,095
三菱鉛筆	4	10	14,700
タカラスタンダード	5	13	20,737
コクヨ	13	30	43,543
ナカバヤシ	-	6	4,216
グローブライド	1	3	12,586
オカムラ	9	24	26,288
美津濃	2	6	14,036
電気・ガス業(1.3%)			
東京電力ホールディングス	226	540	193,570
中部電力	86	195	257,887
関西電力	107	241	259,008
中国電力	39	91	119,837
北陸電力	26	58	39,294
東北電力	71	149	141,088
四国電力	25	53	40,333
九州電力	58	140	130,944
北海道電力	26	59	27,760
沖縄電力	5	12	18,066
電源開発	22	50	89,282
エフオン	1	3	3,668

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イーレックス	4	9	16,309
レノバ	4	10	36,112
東京瓦斯	54	122	283,573
大阪瓦斯	55	115	226,842
東邦瓦斯	14	31	203,158
北海道瓦斯	1	3	5,463
広島ガス	5	13	5,029
西部瓦斯	3	7	21,139
静岡ガス	8	18	17,321
メタウォーター	1	7	15,696
陸運業(3.5%)			
S B Sホールディングス	2	4	11,942
東武鉄道	30	66	201,856
相鉄ホールディングス	9	21	54,158
東急	71	160	233,642
京浜急行電鉄	36	81	147,993
小田急電鉄	42	102	329,272
京王電鉄	14	35	298,328
京成電鉄	19	47	181,162
富士急行	3	8	50,373
新京成電鉄	0.700	1	4,265
東日本旅客鉄道	50	112	855,525
西日本旅客鉄道	25	56	358,521
東海旅客鉄道	23	53	932,800
西武ホールディングス	38	76	99,686
鴻池運輸	4	10	11,009
西日本鉄道	7	17	53,365
ハマキョウレックス	2	4	16,390
サカイ引越センター	1	2	14,210
近鉄グループホールディングス	26	60	275,424
阪急阪神ホールディングス	35	80	291,812
南海電気鉄道	12	28	74,674
京阪ホールディングス	12	26	132,079
神戸電鉄	0.600	1	5,152
名古屋鉄道	22	49	137,044
山陽電気鉄道	1	4	8,578
日本通運	9	20	166,991
ヤマトホールディングス	47	84	241,448
山九	7	15	69,285
丸全昭和運輸	2	4	15,337
センコーグループホールディングス	14	33	34,632

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
トナミホールディングス	0.600	1	7,616
ニッコンホールディングス	9	20	43,726
日本石油輸送	0.500	1	3,991
福山通運	3	7	33,379
セイノーホールディングス	20	45	69,336
エスライン	1	-	-
神奈川中央交通	0.700	1	5,737
日立物流	4	13	44,621
丸和運輸機関	2	12	27,647
C&Fロジホールディングス	2	6	10,955
九州旅客鉄道	24	46	119,225
S Gホールディングス	28	114	302,935
海運業(0.2%)			
日本郵船	22	50	154,277
商船三井	17	35	120,444
川崎汽船	8	18	38,409
N S ユナイテッド海運	1	2	4,660
飯野海運	12	28	12,729
乾汽船	1	4	4,301
空運業(0.5%)			
日本航空	48	147	355,393
ANAホールディングス	49	162	415,476
パスコ	0.600	1	1,644
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.800	1	14,706
日新	2	4	6,676
三菱倉庫	8	20	70,851
三井倉庫ホールディングス	3	6	14,336
住友倉庫	9	21	31,747
澁澤倉庫	1	3	7,557
東陽倉庫	5	13	4,316
日本トランスシティ	5	13	7,567
ケイヒン	1	3	4,374
中央倉庫	1	-	-
安田倉庫	2	5	4,730
東洋埠頭	1	3	4,284
宇徳	3	9	4,194
上組	15	33	67,669
キューソー流通システム	0.900	2	4,247
近鉄エクスプレス	5	11	31,589
東海運	5	13	4,256

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エーアイティー	1	2	2,572
内外トランスライン	-	3	4,525
情報・通信業(9.7%)			
NE C ネットズエスアイ	2	20	39,102
クロスキャット	1	3	4,004
システナ	9	22	43,418
デジタルアーツ	1	3	39,564
日鉄ソリューションズ	4	9	30,315
キューブシステム	-	3	3,867
コア	1	2	4,314
ラクーンホールディングス	-	4	9,816
ソリトンシステムズ	-	3	5,772
ソフトクリエイトホールディングス	1	2	6,245
T I S	9	62	141,500
電算システム	1	2	7,521
グリー	17	38	23,155
コーエーテックホールディングス	5	12	81,536
三菱総合研究所	1	2	11,083
ボルテージ	3	-	-
電算	0.800	1	4,333
AG S	2	5	4,258
ファインデックス	2	5	6,476
ブレインパッド	0.700	1	8,128
K L a b	5	11	9,883
ポルトワイン・ビートルホールディングス	3	8	9,677
イーブックイニシアティブジャパン	-	1	3,393
ネクソン	79	158	551,420
アイスタイル	7	19	10,524
エムアップホールディングス	0.800	1	4,581
エイチーム	1	4	5,323
エニグモ	2	5	7,327
テクノスジャパン	3	6	4,296
コロプラ	9	20	18,655
オルトプラス	2	-	-
ブロードリーフ	13	31	15,903
クロス・マーケティンググループ	5	11	4,528
デジタルハーツホールディングス	1	-	-
システム情報	2	4	5,005
メディアドゥ	0.900	2	14,928
じげん	6	15	6,293
ブイキューブ	-	3	9,414

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
サイバーリンクス	－	2	4,014
フィックスターズ	3	6	6,720
CARTAHOLDINGS	1	3	4,857
オプティム	0.700	4	13,992
セレス	1	2	9,145
SHIFT	0.700	2	41,300
ティーガイア	2	6	12,575
セック	0.500	1	4,233
日本アジアグループ	－	6	7,476
豆蔵ホールディングス	1	－	－
テクマトリックス	2	9	16,984
プロシップ	1	2	3,932
ガンホ・オンライン・エンターテイメント	6	15	35,681
GMOペイメントゲートウェイ	4	13	210,539
ザッパラス	4	8	4,129
インターネットイニシアティブ	4	16	38,362
さくらインターネット	3	6	4,562
ヴェンクス	－	3	3,983
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.700	1	11,844
SRAホールディングス	1	3	8,586
朝日ネット	2	5	4,273
eBASE	1	7	6,975
アバント	2	6	9,440
アドソル日進	1	2	6,023
フリービット	2	4	4,091
コムチュア	3	5	16,455
サイバーコム	0.900	2	3,972
アステリア	3	4	4,122
アイル	1	3	5,754
マークラインズ	1	2	6,240
メディカル・データ・ビジョン	2	7	15,321
gumi	3	8	8,604
モバイルファクトリー	1	3	3,955
テラスカイ	1	2	7,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1	2	4,603
PCIホールディングス	0.800	－	－
PRTIMES	0.500	1	4,433
ランドコンピュータ	1	3	4,169
ダブルスタンダード	0.400	0.900	3,739
オープンドア	1	3	8,639
アカツキ	1	2	10,850

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ubicomホールディングス	1	1	4,976
LINE	6	－	－
カナミックネットワーク	－	5	4,506
チェンジ	0.600	8	30,145
シンクロ・フード	3	11	4,319
オークネット	1	3	4,448
AOITYOHOLDINGS	2	9	4,483
マクロミル	5	12	11,174
ビーグリー	1	－	－
オロ	0.700	2	7,900
ユーザーローカル	－	1	4,620
プロトコーポレーション	2	5	6,557
ハイマックス	－	3	5,871
野村総合研究所	39	114	406,766
サイバネットシステム	－	4	3,766
CEホールディングス	3	6	3,610
インテージホールディングス	3	7	9,336
東邦システムサイエンス	2	4	4,171
ソースネクスト	13	29	10,008
インフォコム	3	5	16,005
HEROZ	－	1	6,372
ラクスル	1	5	19,431
FIG	6	16	4,330
イーソル	1	3	4,800
アルテリア・ネットワークス	3	6	10,812
EDULAB	－	0.600	4,326
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1	2	4,435
トビラシステムズ	－	3	4,824
ギフトィ	－	2	12,460
フォーカスシステムズ	1	4	4,011
クレスコ	1	4	5,959
フジ・メディア・ホールディングス	26	64	85,668
オービック	9	19	381,195
ジャストシステム	4	8	62,033
TDCソフト	2	5	5,219
Zホールディングス	382	859	567,997
トレンドマイクロ	12	33	188,376
IDホールディングス	1	3	4,141
日本オラクル	5	12	151,511
アルファシステムズ	0.900	1	6,120
フューチャー	3	7	14,250

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
CACHoldings	1	4	5,891
S Bテクノロジー	1	2	6,600
トーセ	1	5	4,232
オーピックビジネスコンサルタント	2	6	40,576
伊藤忠テクノソリューションズ	12	28	97,897
アイティフォー	3	8	7,076
東計電算	0.400	1	4,285
エックスネット	1	-	-
大塚商会	15	33	173,732
サイボウズ	3	7	18,228
電通国際情報サービス	1	7	29,491
ACCESS	-	5	4,926
デジタルガレージ	5	10	45,783
イーエムシステムズ	3	10	8,816
ウェザーニューズ	0.900	1	10,070
C I J	2	4	4,098
ビジネスエンジニアリング	0.500	1	4,199
日本エンタープライズ	6	17	4,386
WOWOW	1	3	8,616
スカラ	2	5	4,048
IMAGI CAGROUP	3	10	5,489
ネットワンシステムズ	10	25	84,150
システムソフト	18	44	6,007
アルゴグラフィックス	2	4	14,945
マーベラス	4	9	9,375
エイベックス	4	10	16,124
日本ユニシス	8	21	70,416
兼松エレクトロニクス	1	3	12,427
都築電気	-	2	3,840
TBSホールディングス	17	41	85,199
日本テレビホールディングス	23	52	73,967
朝日放送グループホールディングス	2	6	4,482
テレビ朝日ホールディングス	7	19	41,765
スカパーJ SATホールディングス	18	41	18,952
テレビ東京ホールディングス	2	4	11,417
日本BS放送	1	3	4,204
ビジョン	2	7	7,714
USEN-NEXTHOLDINGS	1	2	4,684
コネクシオ	1	3	4,886
日本通信	21	55	14,267
日本電信電話	372	731	2,062,014

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
KDDI	207	501	1,700,925
ソフトバンク	253	568	823,188
光通信	2	7	156,880
NTTドコモ	206	-	-
エムティーアイ	2	6	5,239
GMOインターネット	11	22	81,648
ファイバーゲート	-	2	4,264
アйдママーケティングコミュニケーション	-	9	4,656
KADOKAWA	7	16	70,224
学研ホールディングス	0.900	8	13,314
ゼンリン	5	11	15,311
インプレスホールディングス	10	22	4,452
アイネット	1	3	4,825
松竹	1	4	64,083
東宝	16	36	156,087
東映	1	2	42,600
エヌ・ティ・ティ・データ	74	166	269,230
ピー・シー・エー	-	0.900	3,807
ビジネスブレイン太田昭和	0.600	2	4,272
DT S	6	13	31,278
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11	26	173,817
シーイーシー	3	6	9,815
カプコン	13	26	179,560
アイ・エス・ビー	0.900	3	3,840
ジャステック	1	4	5,008
S C S K	6	14	94,464
日本システムウエア	0.900	2	4,311
アイネス	2	6	8,521
T K C	2	5	35,298
富士ソフト	3	6	37,654
NSD	9	20	38,471
コナミホールディングス	10	22	169,342
福井コンピュータホールディングス	1	2	10,512
J B C Cホールディングス	1	4	6,127
ミロク情報サービス	2	6	13,925
ソフトバンクグループ	221	496	5,226,039
卸売業(4.6%)			
高千穂交易	1	-	-
オルパルスケアホールディングス	-	2	4,212
伊藤忠食品	0.700	1	7,905
エレマテック	2	5	4,940

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
JALUX	0.800	—	—
あらた	2	5	23,175
トーメンデバイス	0.500	1	4,367
東京エレクトロデバイス	1	2	8,221
フィールズ	3	—	—
双日	154	346	97,450
アルフレッサホールディングス	31	65	141,332
横浜冷凍	7	16	14,776
ラサ商事	2	4	4,199
アルコニックス	3	6	10,941
神戸物産	9	43	126,609
あいホールディングス	4	9	18,369
ディーブイエックス	1	4	4,280
ダイワボウホールディングス	2	5	46,341
マクニカ・富士エレホールディングス	6	15	31,665
ラクト・ジャパン	1	2	7,136
グリムス	—	1	2,452
バイタルケーエスケーホールディングス	5	10	8,611
八洲電機	2	4	4,564
メディアスホールディングス	—	5	4,373
レスターホールディングス	2	6	13,357
ジュテックホールディングス	1	4	4,333
OCHIホールディングス	1	3	4,310
TOKAIホールディングス	14	30	29,062
黒谷	3	—	—
Cominix	2	5	4,246
三洋貿易	2	6	6,791
ビューティガレージ	0.900	1	4,302
ウイン・パートナーズ	2	4	5,242
シップヘルスケアホールディングス	4	11	65,268
明治電機工業	1	2	3,815
コメダホールディングス	6	13	26,550
アセンテック	—	2	3,715
富士興産	2	—	—
協栄産業	1	3	4,296
小野建	2	5	7,408
佐烏電機	2	5	4,277
伯東	1	3	4,871
コンドーテック	2	4	5,233
中山福	—	7	3,929
ナガイレーベン	4	8	23,115

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱食品	3	6	20,437
松田産業	2	4	8,928
第一興商	4	9	38,269
メディパルホールディングス	30	62	140,644
SPK	0.700	3	4,184
萩原電気ホールディングス	1	2	5,945
アズワン	1	4	66,420
スズデン	1	3	4,311
シモジマ	1	3	5,316
ドウシシャ	2	5	10,808
小津産業	1	2	4,221
高速	1	3	5,095
丸文	2	7	3,967
ハピネット	2	5	7,982
橋本総業ホールディングス	—	1	4,155
日本ライフライン	8	20	26,796
マルカ	1	2	4,437
IDOM	7	21	13,440
進和	1	3	7,943
ダイトロン	1	2	4,074
シークス	3	8	14,048
田中商事	2	6	4,212
オーハシテクニカ	1	3	4,624
白銅	1	3	4,179
ダイコー通産	—	2	3,946
伊藤忠商事	195	439	1,427,075
丸紅	291	619	486,984
高島	0.900	2	4,282
長瀬産業	15	35	61,422
蝶理	1	4	6,324
豊田通商	31	63	290,575
三共生興	4	9	4,740
兼松	10	25	34,838
三井物産	246	509	1,128,952
日本紙パルプ商事	1	3	12,094
日立ハイテク	9	—	—
カメイ	3	8	9,782
東都水産	0.600	—	—
OUGホールディングス	0.700	1	4,231
スターゼン	1	2	9,913
山善	10	24	24,745

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
椿本興業	0.500	1	4,536
住友商事	176	396	620,251
内田洋行	1	2	11,387
三菱商事	196	382	1,140,209
第一実業	1	2	12,020
キャノンマーケティングジャパン	8	15	37,237
西華産業	1	3	4,613
佐藤商事	2	5	5,194
菱洋エレクトロ	2	4	13,588
東京産業	3	6	4,643
ユアサ商事	2	6	19,712
神鋼商事	0.700	2	4,413
阪和興業	5	12	35,998
正栄食品工業	1	4	16,031
カナデン	2	5	6,456
菱電商事	2	4	7,078
フルサト工業	1	3	4,362
岩谷産業	6	15	96,036
昭光通商	2	6	4,888
イワキ	3	8	5,084
三愛石油	6	15	16,693
稲畑産業	6	15	23,133
明和産業	—	9	4,342
ヤマエ久野	—	4	4,889
ワキタ	6	12	12,623
東邦ホールディングス	9	20	39,576
サンゲツ	7	16	27,107
ミツロコグループホールディングス	4	9	11,643
シナネンホールディングス	1	2	7,429
伊藤忠エネクス	6	13	14,358
サンリオ	7	17	30,307
サンワテクノス	2	4	4,292
リョーサン	3	6	15,690
新光商事	4	8	6,604
トーホー	1	2	5,124
三信電気	1	3	6,898
東陽テクニカ	3	6	7,577
モスフードサービス	3	8	27,768
加賀電子	2	5	13,611
ソーダニッカ	2	7	4,273
立花エレテック	2	4	7,240

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フォーバル	—	5	4,383
PALTAC	4	10	57,469
三谷産業	5	9	4,233
西本Wismettacホールディングス	0.500	—	—
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.800	—	—
国際紙パルプ商事	6	17	4,318
ヤマタネ	1	3	4,470
丸紅建材リース	1	2	4,488
日鉄物産	2	4	17,707
泉州電業	0.900	1	6,615
トラスコ中山	5	14	38,404
オートバックスセブン	10	23	33,342
モリト	2	6	4,236
加藤産業	4	9	33,624
イノテック	1	3	4,350
イエローハット	5	11	20,765
J Kホールディングス	2	5	4,634
日伝	2	5	11,434
北沢産業	6	15	4,158
杉本商事	1	3	7,756
因幡電機産業	8	16	42,585
東テク	0.900	2	5,840
ミスミグループ本社	35	78	271,908
タキヒヨー	1	2	4,155
蔵王産業	1	3	4,309
スズケン	11	26	113,449
ジェコス	1	4	4,224
小売業(4.7%)			
ローソン	7	15	81,885
サンエー	2	4	19,834
カワチ薬品	2	4	13,085
エービーシー・マート	4	9	60,074
ハードオフコーポレーション	2	5	4,444
アスクル	2	5	20,542
ゲオホールディングス	5	8	9,844
アダストリア	3	8	17,887
ジーフット	2	10	4,231
くら寿司	1	3	28,268
キャンドウ	1	3	5,745
バルグループホールディングス	1	5	9,020
エディオン	12	26	28,621

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
サーラコーポレーション	5	12	7,416
ハローズ	1	2	7,200
フジオフードグループ本社	2	5	6,868
あみやき亭	0.600	1	4,401
ひらまつ	6	-	-
大黒天物産	0.700	1	9,255
ハニーズホールディングス	2	5	5,165
アルペン	2	4	11,136
クオールホールディングス	4	8	12,282
ジンズホールディングス	1	3	24,156
ビックカメラ	16	37	44,044
DCMホールディングス	15	38	42,608
ペッパーフードサービス	2	-	-
Monotaro	19	44	305,956
東京一番フーズ	3	7	4,291
DDホールディングス	1	-	-
きちりホールディングス	2	7	4,377
アークランドサービスホールディングス	2	5	11,159
J. フロントリテイリング	33	75	75,900
ドトール・日レスホールディングス	4	9	16,384
マツモトキヨシホールディングス	11	26	111,280
ブロンコビリー	1	3	7,652
ZOZO	19	37	132,830
トレジャー・ファクトリー	-	5	4,605
物語コーポレーション	0.700	1	20,910
ココカラファイン	2	5	41,664
三越伊勢丹ホールディングス	48	109	80,373
Hamee	0.600	2	3,845
ウエルシアホールディングス	8	33	120,018
クリエイトSDホールディングス	4	9	31,573
丸善CHIホールディングス	5	11	4,206
ミサワ	2	5	3,801
ティーライフ	2	3	4,402
チムニー	0.900	3	4,760
シュッピン	1	4	4,853
オイシックス・ラ・大地	-	6	18,110
ネクステージ	4	10	18,414
ジョイフル本田	8	18	26,036
鳥貴族ホールディングス	0.900	2	4,925
キリン堂ホールディングス	1	-	-
ホットランド	1	4	5,766

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
すかいらーくホールディングス	31	70	115,315
SFPホールディングス	1	2	3,036
綿半ホールディングス	1	4	5,931
コイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8	18	20,511
ゴルフダイジェスト・オンライン	2	4	6,067
BEENOS	1	2	7,577
あさひ	2	4	7,115
日本調剤	0.800	3	6,061
コスモス薬品	1	6	99,918
オンリー	2	9	4,287
セブン&アイ・ホールディングス	109	245	1,032,011
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7	33	28,308
ツルハホールディングス	6	13	193,307
サンマルクホールディングス	2	5	8,130
フェリシモ	1	3	4,197
トリドールホールディングス	3	15	23,327
TOKYOBASE	3	9	6,498
JMホールディングス	1	4	9,624
サツドラホールディングス	1	-	-
アレンザホールディングス	-	3	4,953
パロックジャパンリミテッド	1	5	4,575
クスリのアオキホールディングス	2	6	54,808
スシローグローバルホールディングス	3	34	147,487
LIXILビバ	2	-	-
メディカルシステムネットワーク	3	7	5,197
ノジマ	5	11	32,603
カッパ・クリエイト	3	8	13,296
ライトオン	3	6	4,311
良品計画	37	83	209,751
アドヴァン	4	6	7,161
アルビス	1	2	4,912
コナカ	4	13	5,023
G-7ホールディングス	1	3	8,565
イオン北海道	2	8	9,578
コジマ	4	10	6,966
ヒマラヤ	2	4	4,086
コーナン商事	4	8	26,833
エコス	1	2	4,496
ワタミ	3	8	8,358
マルシェ	2	8	4,377
パ・ロフィック・インターナショナルホールディングス	61	125	320,025

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
西松屋チェーン	6	13	21,279
ゼンショーホールディングス	13	33	97,224
幸楽苑ホールディングス	1	4	7,196
サイゼリヤ	4	9	20,413
V Tホールディングス	11	23	10,006
ユナイテッドアローズ	2	7	14,630
ハイデイ日高	4	9	16,398
京都きもの友禅	5	19	4,819
コロワイド	9	20	41,674
ピーシーデポコーポレーション	3	7	3,936
壱番屋	2	4	21,956
P L A N T	3	-	-
スギホールディングス	5	12	93,125
薬王堂ホールディングス	1	2	7,333
ヴィア・ホールディングス	3	-	-
スクロール	5	9	11,259
ヨンドシーホールディングス	2	5	11,350
ファミリーマート	22	-	-
木曽路	3	8	20,122
S R Sホールディングス	3	7	6,786
千趣会	5	-	-
リテールパートナーズ	-	7	11,270
ケーヨー	5	11	8,769
上新電機	3	7	22,940
日本瓦斯	4	10	51,706
ロイヤルホールディングス	4	11	20,735
東天紅	1	4	4,418
いなげや	3	7	11,795
島忠	5	4	23,016
チヨダ	2	6	6,606
ライフコーポレーション	2	4	15,888
リンガーハット	3	7	18,518
MrMaxHD	3	8	6,604
テンアライド	4	12	4,412
AOKIホールディングス	5	12	8,227
オークワ	4	9	11,711
コメリ	4	9	28,605
青山商事	5	14	10,892
しまむら	3	7	83,439
はせがわ	4	14	4,219
高島屋	20	45	48,076

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松屋	5	13	13,206
エイチ・ツー・オーリテイリング	13	29	25,007
近鉄百貨店	1	2	8,100
丸井グループ	25	53	109,492
アクシアルリテイリング	2	5	24,908
イオン	107	241	857,680
イズミ	5	12	50,048
平和堂	5	11	23,884
フジ	3	7	15,078
ヤオコー	3	7	47,357
ゼビオホールディングス	3	7	7,075
ケーズホールディングス	27	55	85,135
GenkyDrugStores	1	2	10,066
総合メディカルホールディングス	2	-	-
ブックオフグループホールディングス	1	4	4,341
アインホールディングス	3	9	64,974
元氣寿司	0.700	1	4,528
ヤマダホールディングス	85	210	114,036
アークランドサカモト	4	9	15,807
ニトリホールディングス	12	24	515,056
グルメ杵屋	2	4	4,432
愛眼	7	18	4,232
吉野家ホールディングス	9	20	45,423
松屋フーズホールディングス	1	3	11,025
サガミホールディングス	3	8	9,919
関西スーパーマーケット	2	4	5,381
王将フードサービス	2	4	23,985
プレナス	3	7	13,461
ミニストップ	2	4	6,716
アークス	5	12	28,848
パローホールディングス	6	12	30,041
ベルク	1	3	17,701
大庄	1	4	4,450
ファーストリテイリング	3	8	881,160
サンドラッグ	10	23	95,816
サックスパーホールディングス	2	7	4,728
やまや	0.800	1	4,265
ベルーナ	6	13	13,999
銀行業(4.9%)			
島根銀行	2	6	4,209
じもとホールディングス	18	5	4,144

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	
めぶきフィナンシャルグループ	145	326	76,447	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3	7	9,724	
九州フィナンシャルグループ	46	128	57,908	
ゆうちょ銀行	79	178	179,168	
富山第一銀行	6	15	4,455	
コンコディア・フィナンシャルグループ	164	383	163,158	
西日本フィナンシャルホールディングス	19	41	29,678	
関西みらいフィナンシャルグループ	16	29	18,024	
三十三フィナンシャルグループ	2	5	7,392	
第四北越フィナンシャルグループ	4	10	23,806	
ひろぎんホールディングス	–	92	60,255	
新生銀行	20	51	79,053	
あおぞら銀行	16	37	86,287	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,929	4,301	2,422,753	
りそなホールディングス	307	683	298,298	
三井住友トラスト・ホールディングス	53	118	429,224	
三井住友フィナンシャルグループ	193	435	1,637,657	
千葉銀行	96	209	149,167	
群馬銀行	55	129	45,031	
武蔵野銀行	4	9	15,124	
千葉興業銀行	7	17	4,732	
筑波銀行	11	26	4,880	
七十七銀行	9	19	28,407	
青森銀行	2	4	12,063	
秋田銀行	1	3	5,445	
山形銀行	3	7	7,916	
岩手銀行	1	4	8,782	
東邦銀行	25	56	11,970	
みちのく銀行	1	4	4,370	
ふくおかフィナンシャルグループ	23	56	114,987	
静岡銀行	69	153	122,173	
十六銀行	3	7	15,800	
スルガ銀行	28	55	19,891	
八十二銀行	67	141	51,825	
山梨中央銀行	3	7	6,613	
大垣共立銀行	5	12	25,962	
福井銀行	2	5	10,470	
北國銀行	2	5	15,602	
清水銀行	1	2	4,308	
富山銀行	0.800	1	4,414	
滋賀銀行	5	12	25,905	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
南都銀行	4	9	16,891	
百五銀行	25	56	17,602	
京都銀行	10	22	148,725	
紀陽銀行	9	22	32,245	
ほくほくフィナンシャルグループ	18	41	40,894	
広島銀行	41	–	–	
山陰合同銀行	16	39	19,681	
中国銀行	24	54	47,067	
鳥取銀行	1	3	4,282	
伊予銀行	40	83	53,395	
百十四銀行	3	6	10,713	
四国銀行	4	8	6,550	
阿波銀行	4	9	22,051	
大分銀行	1	3	7,758	
宮崎銀行	1	3	8,927	
佐賀銀行	1	3	5,097	
沖縄銀行	2	5	16,350	
琉球銀行	6	13	10,809	
セブン銀行	93	210	51,054	
みずほフィナンシャルグループ	3,808	854	1,357,214	
山口フィナンシャルグループ	35	78	52,830	
長野銀行	1	3	4,313	
名古屋銀行	2	5	14,494	
北洋銀行	42	94	22,467	
愛知銀行	1	2	6,159	
中京銀行	1	2	4,105	
大光銀行	1	3	4,550	
愛媛銀行	4	8	8,808	
京葉銀行	11	26	11,684	
栃木銀行	13	30	5,472	
北日本銀行	0.900	2	4,250	
東和銀行	4	11	7,645	
トモニホールディングス	21	48	15,163	
フィデアホールディングス	27	61	7,625	
池田泉州ホールディングス	32	72	11,784	
証券、商品先物取引業(0.8%)				
F P G	8	19	11,911	
ジャパンインベストメントアドバイザー	–	3	4,858	
S B Iホールディングス	31	77	240,552	
ジャフコグループ	4	9	66,542	
大和証券グループ本社	224	470	249,106	

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
野村ホールディングス	493	960	606,816	
岡三証券グループ	23	53	22,404	
丸三証券	8	18	11,687	
東洋証券	12	27	5,067	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	32	67	25,996	
光世証券	3	6	4,639	
水戸証券	8	16	5,124	
いちよし証券	5	12	8,026	
松井証券	16	30	28,520	
だいがう証券ビジネス	2	-	-	
マネックスグループ	21	56	54,933	
極東証券	3	8	6,980	
岩井コスモホールディングス	2	6	10,220	
藍澤證券	5	11	9,944	
スパークス・グループ	9	29	9,773	
保険業(1.9%)				
かんぽ生命保険	9	77	169,198	
SOMPOホールディングス	52	110	456,939	
アニコムホールディングス	2	17	19,080	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	73	152	478,409	
ソニーフィナンシャルホールディングス	23	-	-	
第一生命ホールディングス	158	332	631,844	
東京海上ホールディングス	100	208	1,115,148	
T & Dホールディングス	83	187	275,649	
アドバンスクリエイト	0.700	1	2,545	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	7	16	84,624	
イントラスト	-	5	3,677	
日本モーゲージサービス	0.800	-	-	
アルヒ	4	9	15,261	
プレミアグループ	1	2	7,052	
クレディセゾン	19	36	48,554	
芙蓉総合リース	2	6	47,454	
みずほリース	4	9	32,737	
東京センチュリー	5	14	107,310	
日本証券金融	12	26	16,252	
アイフル	42	105	29,434	
リコーリース	2	4	16,170	
イオンフィナンシャルサービス	17	38	53,784	
アコム	56	126	59,787	
ジャックス	3	6	14,372	

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
オリエントコーポレーション	75	170	26,195	
日立キャピタル	6	14	42,979	
アプラスフィナンシャル	21	-	-	
オリックス	175	390	695,938	
三菱UFJリース	71	141	81,251	
九州リースサービス	3	6	4,372	
日本取引所グループ	80	169	408,694	
イー・ギャランティ	3	7	15,638	
アサックス	2	5	4,212	
NECキャピタルソリューション	1	2	5,200	
不動産業(1.9%)				
いちご	35	70	23,660	
日本駐車場開発	30	62	8,818	
スター・マイカ・ホールディングス	1	3	4,417	
ADワークスグループ	-	26	4,207	
ヒューリック	59	133	159,946	
三栄建築設計	1	2	4,482	
野村不動産ホールディングス	17	38	92,253	
三重交通グループホールディングス	5	12	6,184	
サムティ	4	8	15,761	
ディア・ライフ	3	9	4,066	
コーセーアールイー	2	6	3,788	
日本商業開発	1	4	6,600	
プレサンスコーポレーション	4	10	15,480	
ユニゾホールディングス	4	-	-	
THEグローバル社	3	-	-	
日本管理センター	1	3	4,399	
サンセイランディック	2	5	4,377	
エストラスト	2	5	4,194	
フージャースホールディングス	5	10	7,127	
オープンハウス	8	19	81,180	
東急不動産ホールディングス	76	171	115,938	
飯田グループホールディングス	23	52	128,327	
イーグランド	2	5	4,416	
ムゲンエステート	2	9	4,489	
ハウスドゥ	1	3	4,212	
ケイアイスター不動産	-	2	7,350	
アグレ都市デザイン	3	-	-	
グッドコムアセット	-	3	4,653	
ジェイ・エス・ビー	0.300	-	-	
テンポイノベーション	1	-	-	

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
パーク24	15	33	75,285
三井不動産	138	286	686,407
三菱地所	196	413	764,028
平和不動産	5	10	38,610
東京建物	30	62	96,876
ダイビル	7	16	21,124
京阪神ビルディング	4	10	16,578
住友不動産	63	141	519,277
テーオーシー	5	12	9,594
東京楽天地	0.500	1	4,430
レオパレス21	36	52	6,786
スターツコーポレーション	3	7	21,720
フジ住宅	3	7	4,774
空港施設	3	8	4,506
明和地所	2	-	-
ワールドフレスト	2	5	9,798
エスリード	1	1	2,550
日神グループホールディングス	4	10	4,410
日本エスコン	5	11	8,766
タカラレーベン	12	26	9,205
AVANTIA	1	4	4,356
イオンモール	14	31	58,684
毎日コムネット	1	6	4,209
ファースト住建	1	3	4,329
カチタス	3	15	47,190
トーセイ	3	8	8,934
穴吹興産	1	2	4,485
サンフロンティア不動産	3	7	7,145
エフ・ジェー・ネクスト	2	6	6,981
グランディハウス	3	10	4,661
日本空港ビルデング	8	20	105,123
サービス業(5.7%)			
日本工営	1	3	10,985
LIFULL	9	21	8,988
ミクシィ	-	11	31,865
ジェイエイシーリクルートメント	1	4	6,826
日本M&Aセンター	20	49	303,891
メンバーズ	1	1	5,013
UTグループ	3	8	28,908
アイティメディア	-	2	3,816
タケエイ	2	6	8,649

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビーネックスグループ	3	7	10,693
コシダカホールディングス	6	14	8,099
アルトナー	-	4	3,854
パソナグループ	2	6	12,691
CDS	1	3	4,167
リンクアンドモチベーション	6	11	5,947
GCA	3	8	6,368
エス・エム・エス	8	20	76,590
サニーサイドアップグループ	1	6	4,910
パーソルホールディングス	27	60	132,092
リニカル	1	5	4,197
クックパッド	9	19	5,940
アイ・ケイ・ケイ	2	6	4,209
学情	1	3	4,531
スタジオアリス	1	3	6,630
シミックホールディングス	1	3	5,151
NJS	1	2	3,954
総合警備保障	10	24	120,274
カカコム	20	45	158,850
アイロムグループ	-	2	4,443
セントケア・ホールディング	3	4	4,136
ルネサンス	1	4	5,283
ディップ	3	9	28,737
デジタルホールディングス	1	4	8,278
新日本科学	2	7	4,810
ツクイホールディングス	6	14	13,213
ベネフィット・ワン	7	22	65,068
エムスリー	59	107	946,000
ツカダ・グローバルホールディング	3	15	5,380
アウトソーシング	15	34	51,756
ウエルネット	2	8	4,549
ワールドホールディングス	1	2	5,176
ディー・エヌ・エー	13	25	58,127
博報堂DYホールディングス	37	84	154,166
ぐるなび	4	10	6,688
タカミヤ	2	7	3,876
ジャパンベストレスキューシステム	2	5	4,430
ファンコミュニケーションズ	7	16	6,780
ライク	0.900	2	3,932
ビジネス・ブレイクスルー	4	9	4,002
エスプール	5	15	15,880

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
WDBホールディングス	1	2	7,560
アドウェイズ	-	7	7,141
バリューコマース	1	4	12,628
インフォマート	29	61	64,556
J Pホールディングス	8	17	5,098
E P Sホールディングス	4	8	9,848
レッグス	-	2	4,212
プレステージ・インターナショナル	10	22	17,419
アミューズ	1	3	8,302
ドリームインキュベータ	-	3	4,009
クイック	1	3	4,537
T A C	8	16	4,471
ケネディクス	25	17	13,072
電通グループ	28	68	251,395
びあ	0.800	1	5,652
イオンファンタジー	1	2	5,648
シーティーエス	3	6	6,072
ネクシィーズグループ	1	4	4,945
H. U. グループホールディングス	7	17	55,930
アルプス技研	2	5	10,945
日本空調サービス	2	6	4,710
オリエンタルランド	28	64	1,168,992
ダスキン	7	14	39,508
明光ネットワークジャパン	3	7	4,381
ファルコホールディングス	1	2	4,686
秀英予備校	4	9	4,184
ラウンドワン	7	20	23,088
リゾートトラスト	12	27	48,741
ビー・エム・エル	3	7	28,470
りらいあコミュニケーションズ	4	9	12,982
リソー教育	12	30	10,320
早稲田アカデミー	-	4	4,287
ユー・エス・エス	30	68	143,220
東京個別指導学院	1	6	4,050
サイバーエージェント	15	37	262,125
楽天	126	283	325,065
クリーク・アンド・リバー社	1	3	4,529
テー・オー・ダブリュー	2	15	4,590
山田コンサルティンググループ	1	4	4,317
セントラルスポーツ	1	2	5,586
フルキャストホールディングス	2	5	10,494
エン・ジャパン	4	10	36,396
リソルホールディングス	0.400	-	-
テクノプロ・ホールディングス	5	12	98,820
インターワークス	3	11	4,343

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイ・アールジャパンホールディングス	1	2	34,950
Keeper 技研	1	3	7,620
三機サービス	1	4	4,141
Gunosy	1	5	4,363
イー・ガーディアン	1	2	8,667
リブセンス	6	17	4,071
ジャパンマテリアル	8	18	27,376
ベクトル	3	7	9,104
ウチヤマホールディングス	3	12	4,453
チャーム・ケア・コーポレーション	2	4	6,421
キャリアリンク	3	2	5,534
I B J	1	5	5,120
アサンテ	1	2	4,505
N・フィールド	3	5	5,985
バリューHR	0.600	2	4,788
M&Aキャピタルパートナーズ	1	5	24,450
ライドオンエクスプレスホールディングス	1	2	3,958
E R Iホールディングス	2	6	4,140
アビスト	0.700	1	4,160
シグマクシス	1	3	5,874
ウィルグループ	1	4	4,414
エスコロー・エージェント・ジャパン	8	-	-
メドピア	-	2	17,835
リクルートホールディングス	194	436	2,389,290
エラン	1	8	11,760
日本郵政	222	460	414,810
ベルシステム24ホールディングス	4	10	18,839
鎌倉新書	2	6	5,508
S M N	-	5	3,835
一蔵	2	12	4,779
L I T A L I C O	0.900	2	9,562
エアトリ	1	3	6,583
アトラエ	0.700	1	6,213
ストライク	1	2	10,844
ソラスト	7	14	22,275
セラク	1	2	4,098
インソース	1	5	11,469
バイカレント・コンサルティング	1	4	85,080
M S - J a p a n	1	3	3,896
グレイステクノロジー	1	3	17,856
ジャパンエパーターサービスホールディングス	2	17	39,217
フルテック	1	-	-
グリーンズ	-	9	5,214
ミダック	-	1	5,824
日総工産	2	5	4,352

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
キュービーネットホールディングス	1	3	5,202
RPAホールディングス	1	7	4,473
スプリックス	1	5	4,362
マネジメントソリューションズ	—	3	5,970
プロレド・パートナーズ	—	1	3,872
andfactory	—	5	4,647
カーブスホールディングス	—	16	16,232
ダイレクトマーケティングミックス	—	2	7,956
リログループ	14	33	85,647
東祥	1	3	7,562
エイチ・アイ・エス	4	8	20,706
ラックランド	0.800	1	4,022
共立メンテナンス	4	10	39,289
イチネンホールディングス	3	6	8,379
建設技術研究所	1	3	9,297
スペース	1	5	4,679
燦ホールディングス	1	3	4,035
東京テアトル	1	3	4,306
タナベ経営	—	3	4,185
ナガワ	0.900	1	19,912
よみうりランド	0.600	—	—
東京都競馬	1	4	19,240
常磐興産	1	—	—
カナモト	4	10	25,658
東京ドーム	11	24	32,060
西尾レントオール	2	5	15,142
トランス・コスモス	2	5	16,077
乃村工藝社	11	26	21,454
藤田観光	1	—	—
KNT-CTホールディングス	1	—	—
日本管財	2	6	13,825
トーカイ	2	5	13,168

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
白洋舎	0.700	—	—
セコム	28	60	580,620
セントラル警備保障	1	2	9,961
丹青社	5	11	9,464
メイテック	3	7	43,725
応用地質	2	7	8,995
船井総研ホールディングス	5	12	28,737
進学会ホールディングス	3	8	4,153
学究社	1	3	4,252
ベネッセホールディングス	9	22	47,922
イオンディライト	3	7	23,512
ナック	1	4	4,503
ニチイ学館	3	—	—
ダイセキ	4	10	35,343
ステップ	1	2	4,063
合計	株数・金額	33,485	66,696 169,111,924
	銘柄数<比率>	1,860	1,853 <99.3%>

(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
国内	百万円	百万円
TOPIX	1,260	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	169,111,924	99.1
コール・ローン等、その他	1,568,664	0.9
投資信託財産総額	170,680,588	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

(2021年2月22日現在)

項目	当期末
(A)資産	170,586,553,890円
コール・ローン等	1,185,077,080
株式(評価額)	169,111,924,060
未収入金	100,174,250
未収配当金	221,013,500
差入委託証拠金	△ 31,635,000
(B)負債	292,677,385
未払解約金	292,673,611
その他未払費用	3,774
(C)純資産総額(A-B)	170,293,876,505
元本	79,813,755,893
次期繰越損益金	90,480,120,612
(D)受益権総口数	79,813,755,893口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,336円

(注1) 期首元本額 37,895,533,054円
 期中追加設定元本額 61,502,961,494円
 期中一部解約元本額 19,584,738,655円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ニッセイTOPIXオープン	5,791,943,526円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,838,721,766円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,845,110円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,824,833,310円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,083,058,971円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	4,223,461,711円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,505,216円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	21,672,934円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	28,960,592円
DCニッセイ国内株式インデックス	492,190,490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	17,275,669,670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)	1,180,490,320円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	152,517,938円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	143,266,411円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	153,665,546円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	328,688,648円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	57,347,460円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	56,221,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,193,882円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	6,520,617円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,793,965円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	4,798,597円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,125,276円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	51,866,593円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	34,906,904円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	112,843,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	140,615,947円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	37,763,633,451円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/スケット)	10,242,693円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型)	50,342円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型)	102,941円

損益の状況

当期 (2020年2月21日~2021年2月22日)

項目	当期
(A)配当等収益	3,131,929,084円
受取配当金	3,133,530,037
受取利息	126,579
その他収益	663,999
支払利息	△ 2,391,531
(B)有価証券売買損益	37,204,153,206
売買損益	39,236,306,637
売買損	△ 2,032,153,431
(C)先物取引等損益	1,598,109,850
取引損益	2,005,074,250
取引損	△ 406,964,400
(D)信託報酬等	△ 155,561
(E)当期損益金(A+B+C+D)	41,934,036,579
(F)前期繰越損益金	30,329,774,311
(G)追加信託差損益金	33,262,730,980
(H)解約差損益金	△ 15,046,421,258
(I)合計(E+F+G+H)	90,480,120,612
次期繰越損益金(I)	90,480,120,612

- (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。

指数に関して

■ファンドのベンチマーク等について

- ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）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・ノウハウおよびT O P I Xの商標または標章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。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。