



ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式／リート／債券)

愛称：ファンドパック日本

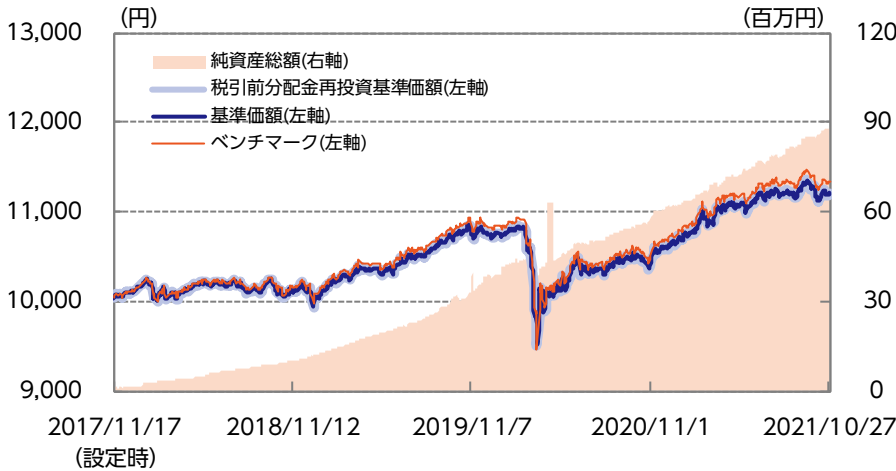
追加型投信／国内／資産複合／インデックス型

マンスリーレポート
2021年10月末現在



運用実績

基準価額・純資産の推移



基準価額および純資産総額

基準価額	11,210円
前月末比	-17円
純資産総額	88百万円
組入マザー純資産総額 合計(参考)	2,725億円

分配の推移(1万口当り、税引前)

第1期	2018年11月	0円
第2期	2019年11月	0円
第3期	2020年11月	0円
第4期	2021年11月	-
第5期	2022年11月	-
第6期	2023年11月	-
第7期	2024年11月	-
直近1年間累計		0円
設定来累計額		0円

基準価額の騰落率(税引前分配金再投資)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	-0.2%	0.1%	1.4%	8.3%	11.2%	12.1%
ベンチマーク	-0.1%	0.2%	1.6%	8.7%	12.2%	13.4%

※上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

※基準価額は信託報酬控除後のものです。税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。なお、信託報酬率は「手続・手数料等」の「ファンドの費用」をご覧ください。

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。分配金は信託財産から支払いますので、基準価額が下がる要因となります。収益分配金には普通分配金に対して所得税および地方税がかかります(個人受益者の場合)。

※ファンド騰落率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しており、実際の投資家利回りと異なります。

※基準価額の前月末比は、決算日到来月に分配金支払実績がある場合、分配金込みで算出しています。

※ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、東証REIT指数(配当込み)をそれぞれ15%、NOMURA-BPI総合を70%組合せ合成したもので、設定日前営業日を起点として指数化しています。

※組入マザー純資産総額合計は、ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの純資産総額の合計値です。

マザーファンドの資産別組入比率と騰落率

	基本投資割合	組入比率	騰落率		
			1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月
国内株式	15.0%	15.3%	-1.4%	6.1%	6.5%
国内リート	15.0%	15.3%	1.2%	-2.2%	3.1%
国内債券	70.0%	69.4%	-0.1%	-0.5%	0.1%

※対組入マザーファンド評価額比

※上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

※ファンド騰落率は実際の投資家利回りと異なります。

マザーファンドの状況

国内株式 (ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド)

組入上位10業種

	業種	比率
1	電気機器	18.7%
2	情報・通信業	8.4%
3	輸送用機器	8.0%
4	化学	7.0%
5	サービス業	6.6%
6	機械	5.4%
7	卸売業	5.1%
8	医薬品	4.9%
9	銀行業	4.7%
10	小売業	4.4%

※対組入株式評価額比

組入上位10銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.7%
2	ソニーグループ	3.0%
3	キーエンス	2.3%
4	リクルートホールディングス	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.4%
6	日本電信電話	1.3%
7	ソフトバンクグループ	1.3%
8	信越化学工業	1.2%
9	東京エレクトロン	1.2%
10	HOYA	1.2%

※対組入株式評価額比

国内リート (ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド)

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.3%
短期金融資産等	1.7%

※対純資産総額比

組入上位10銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.3%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.1%
3	日本プロロジスリート投資法人	5.3%
4	GLP投資法人	5.3%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	4.8%
6	日本都市ファンド投資法人	4.6%
7	大和ハウスリート投資法人	4.3%
8	オリックス不動産投資法人	3.3%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	3.3%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.8%

※対組入投資信託証券評価額比

国内債券 (ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド)

ポートフォリオ情報

平均格付	※1	A A A
平均修正デュレーション	※2	9.44年
平均最終利回り	※3	0.15%
平均クーポン	※4	1.04%
平均直利	※5	0.91%
銘柄数		359

- ※1 格付は、R & I、J C R、ムーディーズ、S & Pのうち、上位の格付を採用しております。
また平均格付とは、マザーファンドが組み入れている債券にかかる格付を加重平均したものであり、当ファンドにかかる格付ではありません。
- ※2「デュレーション」=債券投資におけるリスク度合いを表す指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ (リスクの大きさ) を表し、デュレーションが長いほど債券価格の反応は大きくなります。
- ※3「最終利回り」=満期までの保有を前提とすると、債券の購入日から償還日までに入ってくる受取利息や償還差損益(額面と購入価額の差)等の合計額が投資元本に対して1年当たりどれくらいになるかを表す指標です。
- ※4「クーポン」=額面金額に対する単年の利息の割合を表します。
- ※5「平均直利」=平均クーポン÷平均時価単価

組入上位10銘柄

	銘柄	クーポン	比率
1	第133回 住宅金融支援機構債券	0.828%	1.3%
2	第350回 利付国債(10年)	0.100%	1.0%
3	第127回 利付国債(20年)	1.900%	0.9%
4	第363回 利付国債(10年)	0.100%	0.9%
5	第351回 利付国債(10年)	0.100%	0.8%
6	第334回 利付国債(10年)	0.600%	0.8%
7	第349回 利付国債(10年)	0.100%	0.8%
8	第338回 利付国債(10年)	0.400%	0.8%
9	第352回 利付国債(10年)	0.100%	0.8%
10	第340回 利付国債(10年)	0.400%	0.7%

※対組入債券評価額比

ファンドの特色

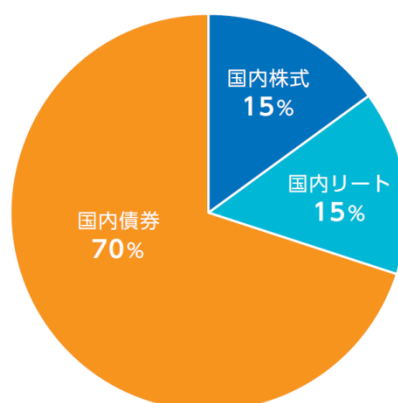
①各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド	マザーファンドの概要
国内株式	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	「TOPIX（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。
国内リート	ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド	「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざします。
国内債券	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざします。

②各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

【基本投資割合】



〈各指数について〉

●TOPIX（東証株価指数）

株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、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TOPIX（東証株価指数）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。

●東証REIT指数

東証REIT指数は、東証市場に上場する不動産投資信託（Real Estate Investment Trust）全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。東証REIT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・ノウハウおよび東証REIT指数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。

●NOMURA-BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、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、一切の責任を負うものではありません。

投資リスク

※ご購入に際しては、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みください。

基準価額の変動要因

- ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマークの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
- ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。**

主な変動要因

株式投資リスク		株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。
債券投資リスク	金利変動リスク	金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。
	信用リスク	債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。
不動産投資信託（リート）投資リスク	保有不動産に関するリスク	リーートの価格は、リートが保有する不動産の価値および賃貸料収入の増減等、また不動産市況や景気動向等の影響を受け変動します。 リートが保有する不動産の賃貸料や稼働率の低下、また自然災害等によって保有する不動産に損害等が生じた場合、リーートの価格が下落することがあります。
	金利変動リスク	リートは、金利が上昇する場合、他の債券の利回り等との比較から売却され、価格が下落することがあります。 また、金融機関等から借入を行うリートは、金利上昇時には金利負担の増加により収益性が悪化し、リーートの価格が下落することがあります。
	信用リスク	リートは一般の法人と同様に倒産のリスクがあり、リーートの経営や財務状況が悪化した場合、リーートの価格が下落することがあります。
	J-REITの税制に関するリスク	一般に、J-REITの発行者には課税の実質免除措置が適用されますが、税法上の一定の要件を満たさない場合、当該措置は適用されず発行者の税負担が増大し、J-REITの価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。
	リートおよび不動産等の法制度に関するリスク	リートおよび不動産等に関する法制度（税制・建築規制等）の変更により不動産の価値および収益性が低下する場合、リーートの価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。
流動性リスク		市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

手続・手数料等

※基準価額は便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

お申込みメモ

購入時	購入単位	販売会社が定める単位とします。
	購入価額	購入申込受付日の基準価額とします。
換金時	換金価額	換金申込受付日の基準価額とします。
	換金代金	換金申込受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。
申込について	申込締切時間	原則として毎営業日の午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。
決算・分配	決算日	11月20日（該当日が休業日の場合は翌営業日）
	収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づき収益分配を行います。
その他	信託期間	無期限（設定日：2017年11月17日）
	繰上償還	委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の手続きを経て、ファンドを繰上償還させることがあります。
	課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。

❗ ご購入に際しては、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みください。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時	購入時手数料	ありません。
換金時	換金時手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

毎日	運用管理費用（信託報酬）	ファンドの純資産総額に 年率0.3102%（税抜0.282%） をかけた額とし、ファンドからご負担いただけます。 ※ファンドが実質的な投資対象とする上場不動産投資信託証券（リート）は、市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託証券の費用は表示しておりません。
	監査費用	ファンドの純資産総額に年率0.011%（税抜0.01%）をかけた額を上限とし、ファンドからご負担いただけます。
随時	その他の費用・手数料	組入有価証券の売買委託手数料、信託事務の諸費用および借入金の利息等はファンドからご負担いただけます。これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を記載することはできません。

❗ 当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

❗ 詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

税金

分配時の普通分配金、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して、所得税および地方税がかかります。詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

委託会社【ファンドの運用の指図を行います】	ニッセイアセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者登録番号 関東財務局長（金商）第369号 加入協会：一般社団法人投資信託協会 一般社団法人日本投資顧問業協会	ファンドに関するお問合せ先
受託会社【ファンドの財産の保管および管理を行います】	三菱UFJ信託銀行株式会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社 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/

ご留意いただきたい事項

- ①投資信託はリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動し、運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなります。投資元本および利回りが保証された商品ではありません。
- ②当資料はニッセイアセットマネジメントが作成したものです。ご購入に際しては、販売会社よりお渡しする投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等（目論見書補完書面を含む）の内容を十分にお読みになり、ご自身でご判断ください。
- ③投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
- ④投資信託のお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。
- ⑤当資料のいかなる内容も将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また、資金動向、市況動向等によっては方針通りの運用ができない場合があります。
- ⑥当資料は、信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。
- ⑦当資料のグラフ・数値等はあくまでも過去の実績であり、将来の投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。また税金・手数料等を考慮しておりませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。
- ⑧当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

取扱販売会社一覧

※販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によっては、新規のお申込みを停止している場合もあります。

詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問合せください。

取扱販売会社名	金融商品 取引業者	登録金融 機関	登録番号	日本証券業 協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 第二種金融 商品取引業 協会
auカブコム証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第61号	○	○	○	
SMB C日興証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第2251号	○	○	○	○
株式会社SBI証券	○		関東財務局長(金商)第44号	○		○	○
光世証券株式会社	○		近畿財務局長(金商)第14号	○			
松井証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第164号	○		○	
マネックス証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○
楽天証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○