

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第31期 (決算日2018年2月19日)

作成対象期間 (2017年2月18日～2018年2月19日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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 (1987年2月18日設定)
運用方針	日経平均株価と連動する投資成果を目標として運用します。原則として日経平均株価に採用されている銘柄のうち200銘柄以上に等株数投資を行い、株式の組入比率は高位に保ちます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均株価に採用されている銘柄を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算を行い、原則として利子・配当収入等を中心として分配します。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	分配金	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円	
27期(2014年2月17日)	5,135	45	27.6	14,393	26.2	97.9	2.0	24,345	
28期(2015年2月17日)	6,424	60	26.3	17,987	25.0	97.2	2.7	24,505	
29期(2016年2月17日)	5,672	40	△11.1	15,836	△12.0	96.9	3.1	27,094	
30期(2017年2月17日)	6,906	70	23.0	19,235	21.5	98.6	1.3	26,160	
31期(2018年2月19日)	7,969	75	16.5	22,149	15.2	96.3	3.6	23,547	

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(期首) 2017年2月17日	円	%	円	%	%	%
	6,906	—	19,235	—	98.6	1.3
2月末	6,868	△0.6	19,119	△0.6	96.5	3.4
3月末	6,836	△1.0	18,909	△1.7	97.4	2.5
4月末	6,937	0.4	19,197	△0.2	97.9	2.0
5月末	7,099	2.8	19,651	2.2	97.6	2.3
6月末	7,243	4.9	20,033	4.2	96.3	3.7
7月末	7,200	4.3	19,925	3.6	97.4	2.5
8月末	7,100	2.8	19,646	2.1	97.2	2.7
9月末	7,400	7.2	20,356	5.8	97.1	2.8
10月末	7,998	15.8	22,012	14.4	96.9	3.0
11月末	8,255	19.5	22,725	18.1	97.8	2.2
12月末	8,277	19.9	22,765	18.4	97.8	2.2
2018年1月末	8,394	21.5	23,098	20.1	97.9	2.1
(期末) 2018年2月19日	8,044	16.5	22,149	15.2	96.3	3.6

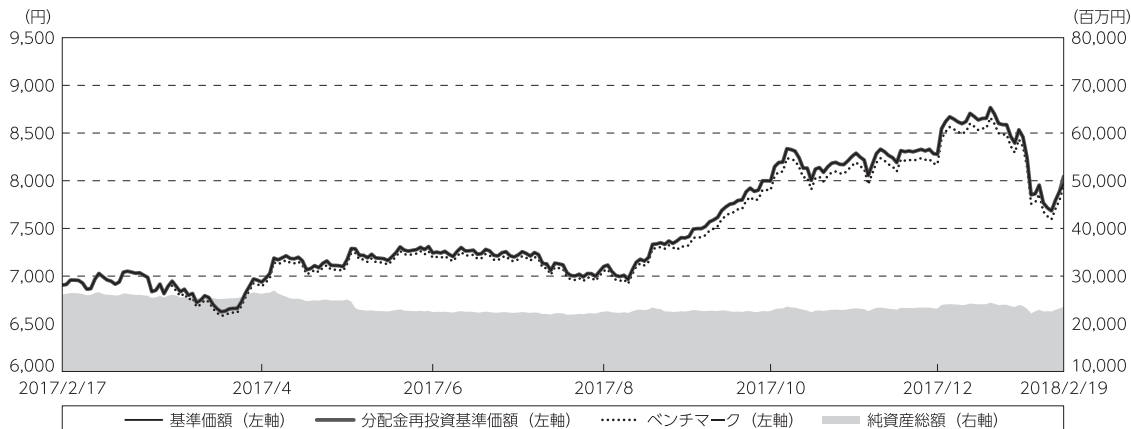
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。
- ②「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③「株式インデックス 225」は、野村アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び「株式インデックス 225」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」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、遅延又は中断に関して、責任を負わない。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：6,906円

期末：7,969円（既払分配金（税込み）：75円）

騰落率：16.5%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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す。作成期首（2017年2月17日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、日経平均株価（日経225）です。ベンチマークは、作成期首（2017年2月17日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首6,906円から期末8,044円（分配金込み）に1,138円の値上がりとなりました。

衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったこと、国内企業の好決算などを背景に、基準価額は上昇しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首から北朝鮮やシリア情勢など地政学リスクが高まったことや、外国為替市場で円高が進んだことなどを背景に下落する場面もありましたが、2017年4月中旬以降は、米国の税制改革案への期待やフランス大統領選の結果に対し安堵感が広がったことなどを背景に上昇しました。

その後も、米国の経済指標が堅調だったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが決定されたことをきっかけに円高ドル安が一服したこと、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったこと、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国の長期金利の上昇などから米国株式市場が下落したことや、外国為替市場で円高ドル安が進行したことなどを背景に下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式の実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資をしております。期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどに応じてポートフォリオの修正を行いました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+16.5%となり、ベンチマークである日経平均株価の+15.2%を1.3ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

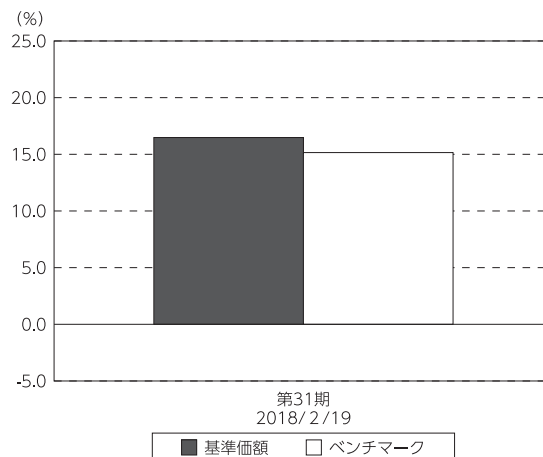
(プラス要因)

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されたこと

(マイナス要因)

ファンドでは信託報酬などのコスト負担が日々生じること

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、日経平均株価 (日経225) です。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の配当等収益から決定させていただきました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第31期
	2017年2月18日～ 2018年2月19日
当期分配金 (対基準価額比率)	75 0.932%
当期の収益	75
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,914

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切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) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても、株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価と連動する投資成果を目指して参ります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年2月18日～2018年2月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.673	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.293)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(24)	(0.326)	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
（ 受 託 会 社 ）	(4)	(0.054)	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
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 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 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.003)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	50	0.679	
期中の平均基準価額は、7,467円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）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あります。

○売買及び取引の状況

(2017年2月18日～2018年2月19日)

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
		1,187 (△1,090)	3,282,017 ()	3,597	9,760,861

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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
		13,502	13,099	—	—

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年2月18日～2018年2月19日)

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
(a) 期中の株式売買金額	13,042,879千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,129,614千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.56

* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2017年2月18日～2018年2月19日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			%	売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	うち利害関係人 との取引状況D		$\frac{D}{C}$		
株式	百万円 3,282	百万円 297	9.0	百万円 9,760	百万円 1,071	11.0	

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	3	12	25

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	693千円
うち利害関係人への支払額 (B)	59千円
(B) / (A)	8.5%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2018年2月19日現在)

国内株式

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			
水産・農林業 (0.2%)						
日本水産	51	38	20,444			
マルハニチロ	5.1	3.8	12,654			
鉱業 (0.1%)						
国際石油開発帝石	20.4	15.2	20,398			
建設業 (2.8%)						
コムシスホールディングス	51	38	106,096			
大成建設	51	7.6	40,736			
大林組	51	38	45,562			
清水建設	51	38	38,456			
長谷工コーポレーション	10.2	7.6	11,878			
鹿島建設	51	38	38,304			
大和ハウス工業	51	38	151,734			
積水ハウス	51	38	73,112			
日揮	51	38	92,150			
千代田化工建設	51	38	39,900			
食料品 (4.6%)						
日清製粉グループ本社	51	38	81,396			
明治ホールディングス	10.2	7.6	62,320			
日本ハム	51	38	91,276			
サッポロホールディングス	10.2	7.6	24,320			
アサヒグループホールディングス	51	38	215,726			
麒麟ホールディングス	51	38	107,160			
宝ホールディングス	51	38	50,920			
キッコーマン	51	38	166,440			
味の素	51	38	75,639			
ニチレイ	25.5	19	51,148			
日本たばこ産業	51	38	121,904			
繊維製品 (0.3%)						
東洋紡	51	3.8	7,881			
ユニチカ	51	3.8	2,671			
帝人	10.2	7.6	16,636			
東レ	51	38	42,161			
パルプ・紙 (0.2%)						
王子ホールディングス	51	38	26,980			
日本製紙	5.1	3.8	8,037			
北越紀州製紙	51	—	—			
化学 (8.8%)						
クラレ	51	38	71,744			
旭化成	51	38	51,737			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭和電工	5.1	3.8	19,722
住友化学	51	38	25,650
日産化学工業	51	38	152,760
東ソー	51	19	43,358
トクヤマ	51	7.6	23,940
デンカ	51	7.6	29,336
信越化学工業	51	38	437,190
三井化学	51	7.6	25,194
三菱ケミカルホールディングス	25.5	19	20,966
宇部興産	51	3.8	13,186
日本化薬	51	38	52,782
花王	51	38	303,886
富士フイルムホールディングス	51	38	167,352
資生堂	51	38	241,566
日東電工	51	38	321,176
医薬品 (7.3%)			
協和発酵キリン	51	38	89,300
武田薬品工業	51	38	227,164
アステラス製薬	255	190	289,560
大日本住友製薬	51	38	64,980
塩野義製薬	51	38	212,990
中外製薬	51	38	212,040
エーザイ	51	38	213,294
第一三共	51	38	147,250
大塚ホールディングス	51	38	193,686
石油・石炭製品 (0.4%)			
昭和シェル石油	51	38	53,960
JXTGホールディングス	51	38	25,391
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	25.5	19	50,198
ブリヂストン	51	38	184,680
ガラス・土石製品 (1.6%)			
旭硝子	51	7.6	34,656
日本板硝子	5.1	3.8	3,393
日本電気硝子	77	11.4	39,387
住友大阪セメント	51	38	18,278
太平洋セメント	51	3.8	15,276
東海カーボン	51	38	70,718
TOTO	25.5	19	109,630
日本碍子	51	38	76,798
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	5.1	3.8	9,843
神戸製鋼所	5.1	3.8	4,541

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジェイ エフ イー ホールディングス	5.1	3.8	9,602
日新製鋼	5.1	3.8	5,871
大平洋金属	51	3.8	12,236
非鉄金属 (1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	51	38	11,134
三井金属鉱業	51	3.8	19,836
東邦亜鉛	51	3.8	23,104
三菱マテリアル	5.1	3.8	12,863
住友金属鉱山	51	19	99,921
DOWAホールディングス	51	7.6	30,666
古河機械金属	51	3.8	8,755
古河電気工業	5.1	3.8	21,660
住友電気工業	51	38	63,859
フジクラ	51	38	29,488
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	5.1	3.8	10,833
東洋製罐グループホールディングス	51	38	59,622
機械 (5.6%)			
日本製鋼所	10.2	7.6	25,802
オークマ	51	7.6	50,388
アマダホールディングス	51	38	54,530
小松製作所	51	38	155,230
住友重機械工業	51	7.6	33,782
日立建機	51	38	173,660
クボタ	51	38	77,463
荏原製作所	10.2	7.6	30,666
ダイキン工業	51	38	489,060
日本精工	51	38	61,484
NTN	51	38	18,164
ジェイテクト	51	38	65,132
日立造船	10.2	7.6	4,278
三菱重工業	51	3.8	16,545
IHI	51	3.8	13,452
電気機器 (20.0%)			
日清紡ホールディングス	51	38	61,142
コニカミノルタ	51	38	37,012
ミネベアミツミ	51	38	93,252
日立製作所	51	38	31,718
東芝	51	—	—
三菱電機	51	38	71,193
富士電機	51	38	31,350
安川電機	51	38	188,100
明電舎	51	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジーエス・ユアサ コーポレーション	51	38	22,534
日本電気	51	3.8	12,141
富士通	51	38	24,996
沖電気工業	5.1	3.8	5,529
セイコーエプソン	—	76	158,688
パナソニック	51	38	62,681
ソニー	51	38	201,590
TDK	51	38	353,400
アルプス電気	51	38	107,274
パイオニア	51	38	7,524
横河電機	51	38	84,778
アドバンテスト	102	76	169,024
カシオ計算機	51	38	57,722
ファナック	51	38	1,070,080
京セラ	102	76	473,100
太陽誘電	51	38	68,780
S C R E E Nホールディングス	10.2	7.6	73,036
キヤノン	76.5	57	227,772
リコー	51	38	45,182
東京エレクトロン	51	38	784,890
輸送用機器 (6.6%)			
デンソー	51	38	241,224
三井造船	51	3.8	7,622
川崎重工業	51	3.8	15,504
日産自動車	51	38	42,826
いすゞ自動車	25.5	19	33,791
トヨタ自動車	51	38	280,402
日野自動車	51	38	55,860
三菱自動車工業	5.1	3.8	3,161
マツダ	10.2	7.6	11,438
本田技研工業	102	76	292,676
スズキ	51	38	229,140
S U B A R U	51	38	143,184
ヤマハ発動機	51	38	134,330
精密機器 (3.1%)			
テルモ	102	76	424,080
ニコン	51	38	81,852
オリンパス	51	38	162,450
シチズン時計	51	38	32,110
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	51	38	35,720
大日本印刷	51	19	43,320
ヤマハ	51	38	178,410

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	5.1	3.8	1,573
中部電力	5.1	3.8	5,350
関西電力	5.1	3.8	4,974
東京瓦斯	51	7.6	20,463
大阪瓦斯	51	7.6	16,552
陸運業 (2.1%)			
東武鉄道	51	7.6	25,650
東京急行電鉄	51	19	33,250
小田急電鉄	25.5	19	42,864
京王電鉄	51	7.6	36,518
京成電鉄	25.5	19	67,355
東日本旅客鉄道	5.1	3.8	39,197
西日本旅客鉄道	5.1	3.8	28,952
東海旅客鉄道	5.1	3.8	75,981
日本通運	51	3.8	27,284
ヤマトホールディングス	51	38	104,500
海運業 (0.1%)			
日本郵船	51	3.8	8,964
商船三井	51	3.8	12,825
川崎汽船	51	3.8	10,142
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	51	3.8	16,514
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	51	19	48,469
情報・通信業 (10.4%)			
ヤフー	20.4	15.2	7,828
トレンドマイクロ	51	38	232,560
スカパーJ S A Tホールディングス	5.1	3.8	1,850
日本電信電話	10.2	7.6	36,533
K D D I	306	228	603,174
N T T ドコモ	5.1	3.8	10,366
東宝	5.1	3.8	13,338
エヌ・ティ・ティ・データ	51	190	212,040
コナミホールディングス	51	38	215,460
ソフトバンクグループ	153	114	1,025,886
卸売業 (2.3%)			
双日	5.1	3.8	1,318
伊藤忠商事	51	38	78,698
丸紅	51	38	30,875
豊田通商	51	38	155,800
三井物産	51	38	74,081
住友商事	51	38	70,186

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱商事	51	38	117,458
小売業 (10.6%)			
J. フロント リテイリング	25.5	19	37,126
三越伊勢丹ホールディングス	51	38	47,994
セブン&アイ・ホールディングス	51	38	169,632
ユニー・ファミリーマートホールディングス	51	38	298,300
高島屋	51	38	42,028
丸井グループ	51	38	76,152
イオン	51	38	71,554
ファーストリテイリング	51	38	1,659,460
銀行業 (1.0%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	51	38	23,902
新生銀行	51	3.8	6,669
あおぞら銀行	51	3.8	17,062
三菱UFJフィナンシャル・グループ	51	38	30,156
りそなホールディングス	5.1	3.8	2,408
三井住友トラスト・ホールディングス	5.1	3.8	16,887
三井住友フィナンシャルグループ	5.1	3.8	18,357
千葉銀行	51	38	35,112
ふくおかフィナンシャルグループ	51	38	22,154
静岡銀行	51	38	42,902
みずほフィナンシャルグループ	51	38	7,706
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	51	38	27,576
野村ホールディングス	51	38	25,323
松井証券	51	38	40,204
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	12.8	9.5	39,615

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
MS&ADインシュアランスグループホール	15.3	11.4	38,737	
ソニーフィナンシャルホールディングス	10.2	7.6	15,306	
第一生命ホールディングス	5.1	3.8	8,396	
東京海上ホールディングス	25.5	19	97,071	
T&Dホールディングス	10.2	7.6	14,048	
その他金融業 (0.3%)				
クレディセゾン	51	38	70,908	
不動産業 (1.7%)				
東急不動産ホールディングス	51	38	30,856	
三井不動産	51	38	100,757	
三菱地所	51	38	72,751	
東京建物	25.5	19	32,965	
住友不動産	51	38	151,582	
サービス業 (4.1%)				
ディー・エヌ・エー	15.3	11.4	22,002	
電通	51	38	188,480	
楽天	51	38	35,644	
リクルートホールディングス	—	114	305,235	
日本郵政	—	38	49,970	
東京ドーム	25.5	19	18,677	
セコム	51	38	301,226	
合 計	株 数・金 額	10,111	6,610	22,683,008
	銘柄数<比率>	225	225	<96.3%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいてい
ます。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

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	株式先物取引	百万円	百万円
	日経225	839	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年2月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	22,683,008	95.1
コール・ローン等、その他	1,177,861	4.9
投資信託財産総額	23,860,869	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年2月19日現在)

○損益の状況 (2017年2月18日～2018年2月19日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	23,860,328,383
コール・ローン等	1,074,929,267
株式(評価額)	22,683,008,260
未収入金	16,203,756
未収配当金	36,927,100
差入委託証拠金	49,260,000
(B) 負債	312,650,502
未払金	1,041,944
未払収益分配金	221,624,419
未払解約金	11,053,821
未払信託報酬	78,548,952
未払利息	1,352
その他未払費用	380,014
(C) 純資産総額(A-B)	23,547,677,881
元本	29,549,922,574
次期繰越損益金	△ 6,002,244,693
(D) 受益権総口数	29,549,922,574口
1万円当たり基準価額(C/D)	7,969円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	326,357,903
受取配当金	326,612,252
受取利息	4
その他収益金	27,660
支払利息	△ 282,013
(B) 有価証券売買損益	2,561,048,540
売買益	3,942,984,671
売買損	△ 1,381,936,131
(C) 先物取引等取引損益	69,188,267
取引益	197,184,669
取引損	△ 127,996,402
(D) 信託報酬等	△ 160,492,422
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,796,102,288
(F) 前期繰越損益金	2,460,822,423
(G) 追加信託差損益金	△11,037,544,985
(配当等相当額)	(21,308,481,943)
(売買損益相当額)	(△32,346,026,928)
(H) 計(E+F+G)	△ 5,780,620,274
(I) 収益分配金	△ 221,624,419
次期繰越損益金(H+I)	△ 6,002,244,693
追加信託差損益金	△11,037,544,985
(配当等相当額)	(21,308,481,943)
(売買損益相当額)	(△32,346,026,928)
分準準備積立金	5,035,300,292

(注) 期首元本額は37,881,400,194円、期中追加設定元本額は10,771,268,875円、期中一部解約元本額は19,102,746,495円、1口当たり純資産額は0.7969円です。

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程 (2017年2月18日～2018年2月19日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年2月18日～ 2018年2月19日
a. 配当等収益(経費控除後)	308,639,540円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	2,487,462,748円
c. 信託約款に定める収益調整金	21,308,481,943円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,460,822,423円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	26,565,406,654円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	8,989円
g. 分配金	221,624,419円
h. 分配金(1万円当たり)	75円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	75円
----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

①スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2017年3月31日>

②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2017年11月8日>