

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第35期 (決算日2022年2月17日)

作成対象期間 (2021年2月18日～2022年2月17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ない、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回決算を行ない、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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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 (分配落)	標準 価 額			ベンチ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落 中 率	日 経 平 均 株 価 (日経225)	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円	
31期(2018年2月19日)	7,969	75	16.5	22,149	15.2	96.3	3.6	23,547	
32期(2019年2月18日)	7,693	70	△ 2.6	21,282	△ 3.9	96.8	3.1	27,909	
33期(2020年2月17日)	8,542	85	12.1	23,523	10.5	97.7	2.2	25,387	
34期(2021年2月17日)	11,032	110	30.4	30,292	28.8	97.7	2.2	28,412	
35期(2022年2月17日)	9,933	80	△ 9.2	27,233	△ 10.1	96.5	3.4	28,815	

*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	騰 落 率	ベンチ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			日 経 平 均 株 価 (日経225)	騰 落 率		
(期 首)	円	%	円	%	%	%
2021年2月17日	11,032	—	30,292	—	97.7	2.2
2月末	10,553	△ 4.3	28,966	△ 4.4	97.2	2.8
3月末	10,686	△ 3.1	29,179	△ 3.7	97.8	2.2
4月末	10,549	△ 4.4	28,813	△ 4.9	97.6	2.4
5月末	10,567	△ 4.2	28,860	△ 4.7	95.9	4.0
6月末	10,544	△ 4.4	28,792	△ 5.0	98.4	1.5
7月末	9,987	△ 9.5	27,284	△ 9.9	96.6	3.4
8月末	10,281	△ 6.8	28,090	△ 7.3	97.7	2.3
9月末	10,839	△ 1.7	29,453	△ 2.8	96.1	3.8
10月末	10,626	△ 3.7	28,893	△ 4.6	97.4	2.5
11月末	10,227	△ 7.3	27,822	△ 8.2	97.3	2.6
12月末	10,596	△ 4.0	28,792	△ 5.0	95.9	4.1
2022年1月末	9,932	△ 10.0	27,002	△ 10.9	95.9	4.0
(期 末)						
2022年2月17日	10,013	△ 9.2	27,233	△ 10.1	96.5	3.4

*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：11,032円

期 末：9,933円 (既払分配金 (税込み) : 80円)

騰落率：△9.2% (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 (2021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 (2021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

国内株式の株価の変動

○投資環境

国内株式市場は、期首から米国長期金利が急上昇したことを受け下落しました。その後も新型コロナウイルス変異株の感染再拡大による景気減速懸念などから軟調に推移しました。9月上旬には菅首相の自民党総裁選出馬見送りが報道され、新首相の下で内閣が一新されることから、内閣支持率の回復期待が浮上したことなどにより上昇しましたが、9月下旬以降は米中景気先行き不安や岸田新政権に対する期待が後退したことなどから下落しました。10月中旬には、原油価格や米長期金利上昇が一服し過度なインフレ懸念が落ち着いたことなどから上昇しましたが、11月下旬には、新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高い

と思われるオミクロン株への懸念が高まったことなどにより下落しました。その後はオミクロン株の重症化リスクについて楽観的な見方が広がったことなどから上昇しました。2022年1月以降は、国内でのオミクロン株による新型コロナウイルス感染の再拡大や、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立などからリスクを避ける動きが強まり下落しました。

○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、個別銘柄の株数の比率がポートフォリオと日経平均株価で同水準になるように投資を行ないました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行ないました。

○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-9.2%となり、ベンチマークである日経平均株価の-10.1%を0.9ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

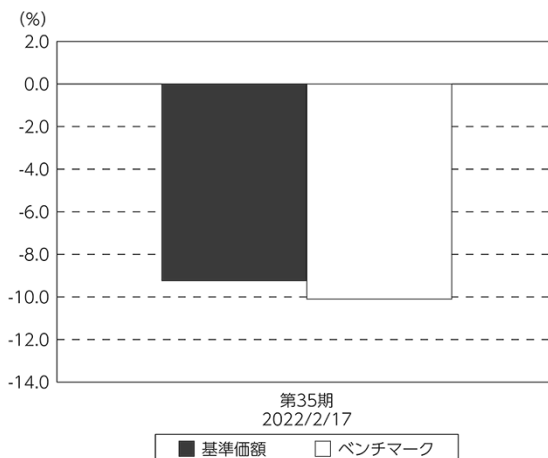
（プラス要因）

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せん。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第35期
	2021年2月18日～ 2022年2月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	80 0.799%
当期の収益	80
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	12,263

(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

(2021年2月18日～2022年2月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 71	% 0.682	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(31)	(0.297)	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 ）	(34)	(0.330)	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 ）	(6)	(0.055)	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	0.001	(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
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(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
合 計	71	0.686	
期中の平均基準価額は、10,448円です。			

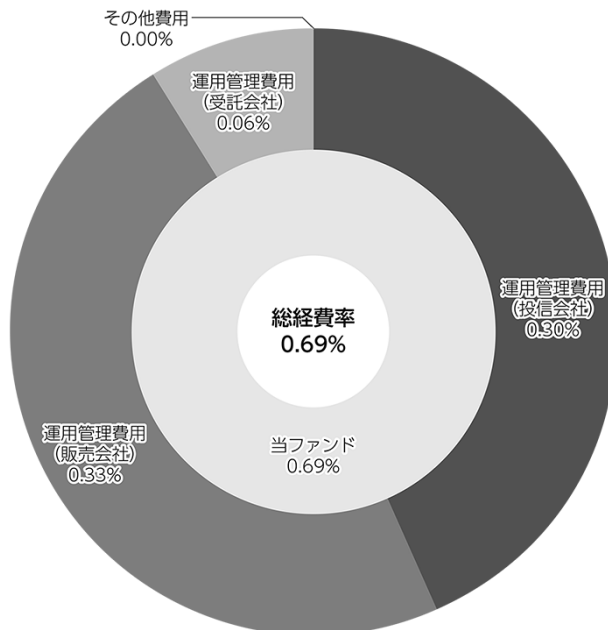
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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。

(参考情報)**○総経費率**

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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0.69%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2021年2月18日～2022年2月17日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		1,138 (221)	5,455,676 (-)	619	2,573,407

*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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		12,322	11,922	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年2月18日～2022年2月17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	8,029,084千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	27,669,245千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

* (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

(2021年2月18日～2022年2月17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 5,455	百万円 683	12.5	百万円 2,573	百万円 75	2.9	

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	1	19

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

(2022年2月17日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)			銘 柄	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
水産・農林業 (0.1%)				繊維製品 (0.1%)			
日本水産	33	36	20,556	東洋紡	3.3	3.6	4,572
マルハニチロ	3.3	3.6	9,529	ユニチカ	3.3	3.6	1,116
鉱業 (0.1%)				帝人	6.6	7.2	10,195
I N P E X	13.2	14.4	16,848	東レ	33	36	24,490
建設業 (1.7%)				パルプ・紙 (0.1%)			
コムシスホールディングス	33	36	100,764	王子ホールディングス	33	36	22,464
大成建設	6.6	7.2	27,648	日本製紙	3.3	3.6	4,194
大林組	33	36	35,064	化学 (7.7%)			
清水建設	33	36	28,080	クラレ	33	36	39,780
長谷工コーポレーション	6.6	7.2	11,030	旭化成	33	36	40,302
鹿島建設	16.5	18	28,566	昭和電工	3.3	3.6	8,377
大和ハウス工業	33	36	120,096	住友化学	33	36	20,268
積水ハウス	33	36	85,536	日産化学	33	36	236,160
日揮ホールディングス	33	36	40,140	東ソー	16.5	18	33,750
食料品 (3.9%)				トクヤマ	6.6	7.2	13,831
日清製粉グループ本社	33	36	60,732	デンカ	6.6	7.2	25,956
明治ホールディングス	6.6	7.2	49,248	信越化学工業	33	36	656,820
日本ハム	16.5	18	79,020	三井化学	6.6	7.2	21,816
サッポロホールディングス	6.6	7.2	17,452	三菱ケミカルホールディングス	16.5	18	15,211
アサヒグループホールディングス	33	36	187,884	宇部興産	3.3	3.6	7,966
キリンホールディングス	33	36	72,126	花王	33	36	188,064
宝ホールディングス	33	36	42,084	D I C	3.3	3.6	9,925
キッコーマン	33	36	319,320	富士フイルムホールディングス	33	36	274,788
味の素	33	36	118,908	資生堂	33	36	242,316
ニチレイ	16.5	18	46,980	日東電工	33	36	309,960
日本たばこ産業	33	36	84,600	医薬品 (7.1%)			
				協和キリン	33	36	109,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
武田薬品工業	33	36	127,548
アステラス製薬	165	180	363,240
大日本住友製薬	33	36	45,792
塩野義製薬	33	36	274,824
中外製薬	99	108	417,744
エーザイ	33	36	212,652
第一三共	99	108	268,218
大塚ホールディングス	33	36	144,036
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	13.2	14.4	44,424
E.N.E.O.Sホールディングス	33	36	16,578
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	16.5	18	31,932
ブリヂストン	33	36	189,468
ガラス・土石製品 (1.1%)			
A.G.C	6.6	7.2	40,392
日本板硝子	3.3	3.6	1,846
日本電気硝子	9.9	10.8	31,298
住友大阪セメント	3.3	3.6	12,870
太平洋セメント	3.3	3.6	8,488
東海カーボン	33	36	41,832
TOTO	16.5	18	88,920
日本碍子	33	36	67,536
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3.3	3.6	7,250
神戸製鋼所	3.3	3.6	2,206
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.3	3.6	6,026
大平洋金属	3.3	3.6	11,934
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	3.3	3.6	6,696
三井金属鉱業	3.3	3.6	12,258
東邦亜鉛	3.3	3.6	9,943
三菱マテリアル	3.3	3.6	7,664
住友金属鉱山	16.5	18	95,850
DOWAホールディングス	6.6	7.2	35,280
古河電気工業	3.3	3.6	8,629
住友電気工業	33	36	57,852
フジクラ	33	36	23,868
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	3.3	3.6	7,560
東洋製罐グループホールディングス	33	—	—
機械 (4.8%)			
日本製鋼所	6.6	7.2	26,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オークマ	6.6	7.2	35,136
アマダ	33	36	38,160
小松製作所	33	36	99,702
住友重機械工業	6.6	7.2	20,923
日立建機	33	36	107,100
クボタ	33	36	76,248
荏原製作所	6.6	7.2	42,048
ダイキン工業	33	36	783,540
日本精工	33	36	27,216
NTN	33	36	8,460
ジェイテクト	33	36	37,728
三井E&Sホールディングス	—	3.6	1,314
日立造船	6.6	7.2	5,652
三菱重工業	3.3	3.6	12,002
I H I	3.3	3.6	9,640
電気機器 (25.7%)			
日清紡ホールディングス	33	—	—
コニカミノルタ	33	36	18,360
ミネベアミツミ	33	36	92,160
日立製作所	6.6	7.2	44,280
三菱電機	33	36	52,038
富士電機	6.6	7.2	44,424
安川電機	33	36	174,780
オムロン	33	36	289,296
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6.6	7.2	17,294
日本電気	3.3	3.6	18,504
富士通	3.3	3.6	59,130
沖電気工業	3.3	3.6	3,301
セイコーエプソン	66	72	131,112
パナソニック	33	36	44,190
シャープ	33	36	47,160
ソニーグループ	33	36	437,760
T D K	33	108	510,840
アルプスアルパイン	33	36	44,136
横河電機	33	36	66,888
アドバンテスト	66	72	702,720
キーエンス	—	3.6	197,568
カシオ計算機	33	36	49,176
ファナック	33	36	820,080
京セラ	66	72	494,064
太陽誘電	33	36	185,400
村田製作所	—	28.8	233,740
S C R E E Nホールディングス	6.6	7.2	86,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キヤノン	49.5	54	152,685
リコー	33	36	38,268
東京エレクトロン	33	36	2,095,920
輸送用機器 (5.1%)			
デンソー	33	36	306,828
三井E&Sホールディングス	3.3	—	—
川崎重工業	3.3	3.6	7,596
日産自動車	33	36	21,906
いすゞ自動車	16.5	18	28,638
トヨタ自動車	33	180	388,890
日野自動車	33	36	39,420
三菱自動車工業	3.3	3.6	1,206
マツダ	6.6	7.2	6,667
本田技研工業	66	72	265,032
スズキ	33	36	171,936
SUBARU	33	36	70,542
ヤマハ発動機	33	36	97,668
精密機器 (3.4%)			
テルモ	132	144	543,024
ニコン	33	36	49,140
オリンパス	132	144	326,664
シチズン時計	33	36	18,396
その他製品 (2.8%)			
パンダイナムコホールディングス	33	36	282,168
凸版印刷	16.5	18	41,742
大日本印刷	16.5	18	53,820
ヤマハ	33	36	195,480
任天堂	—	3.6	211,536
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	3.3	3.6	1,310
中部電力	3.3	3.6	4,089
関西電力	3.3	3.6	4,186
東京瓦斯	6.6	7.2	16,855
大阪瓦斯	6.6	7.2	15,235
陸運業 (1.5%)			
東武鉄道	6.6	7.2	21,708
東急	16.5	18	29,340
小田急電鉄	16.5	18	40,212
京王電鉄	6.6	7.2	39,384
京成電鉄	16.5	18	63,360
東日本旅客鉄道	3.3	3.6	26,200
西日本旅客鉄道	3.3	3.6	18,745
東海旅客鉄道	3.3	3.6	58,860

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本通運	3.3	—	—
ヤマトホールディングス	3.3	36	78,768
NIPPON EXPRESSホールディング	—	3.6	26,892
海運業 (0.3%)			
日本郵船	3.3	3.6	36,000
商船三井	3.3	3.6	32,544
川崎汽船	3.3	3.6	27,144
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	3.3	3.6	9,592
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	16.5	18	50,490
情報・通信業 (11.0%)			
ネクソン	66	72	172,368
Zホールディングス	13.2	14.4	7,866
トレンドマイクロ	33	36	216,000
スカパーJ S A Tホールディングス	3.3	—	—
日本電信電話	13.2	14.4	47,347
KDDI	198	216	816,480
ソフトバンク	33	36	51,948
東宝	3.3	3.6	17,190
エス・ティ・ティ・データ	165	180	378,180
コナミホールディングス	33	36	239,760
ソフトバンクグループ	198	216	1,105,272
卸売業 (2.5%)			
双日	3.3	3.6	7,048
伊藤忠商事	33	36	138,564
丸紅	33	36	44,226
豊田通商	33	36	184,320
三井物産	33	36	111,528
住友商事	33	36	68,832
三菱商事	33	36	148,320
小売業 (9.9%)			
J. フロント リテイリング	16.5	18	19,062
三越伊勢丹ホールディングス	33	36	35,172
セブン&アイ・ホールディングス	33	36	205,524
高島屋	16.5	18	21,240
丸井グループ	33	36	83,592
イオン	33	36	95,112
ファーストリテイリング	33	36	2,293,200
銀行業 (0.6%)			
コソコディア・フィナンシャルグループ	33	36	17,928
新生銀行	3.3	3.6	8,064
あおぞら銀行	3.3	3.6	9,748

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UFJフィナンシャル・グループ	33	36	26,596
りそなホールディングス	3.3	3.6	1,978
三井住友トラスト・ホールディングス	3.3	3.6	15,246
三井住友フィナンシャルグループ	3.3	3.6	15,555
千葉銀行	33	36	28,332
ふくおかフィナンシャルグループ	6.6	7.2	17,582
静岡銀行	33	36	33,012
みずほフィナンシャルグループ	3.3	3.6	5,797
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	33	36	24,944
野村ホールディングス	33	36	19,630
松井証券	33	36	29,556
保険業 (0.8%)			
SOMPOホールディングス	8.3	7.2	38,980
MS&ADインシュアランスグループホール	9.9	10.8	43,189
第一生命ホールディングス	3.3	3.6	9,568
東京海上ホールディングス	16.5	18	127,098
T&Dホールディングス	6.6	7.2	13,010
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	33	36	49,716
日本取引所グループ	33	36	81,144

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
不動産業 (1.2%)				
東急不動産ホールディングス	33	36	23,940	
三井不動産	33	36	93,060	
三菱地所	33	36	64,422	
東京建物	16.5	18	32,634	
住友不動産	33	36	129,888	
サービス業 (5.4%)				
エムスリー	79.2	86.4	349,228	
ディー・エヌ・エー	9.9	10.8	18,867	
電通グループ	33	36	175,860	
サイバーエージェント	6.6	28.8	43,113	
楽天グループ	33	36	34,740	
リクルートホールディングス	99	108	521,424	
日本郵政	33	36	35,366	
セコム	33	36	310,104	
合 計	株 数 ・ 金 額	5,987	6,728	27,816,410
	銘柄数<比率>	225	225	<96.5%>

*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	日経225	
		百万円	百万円
		977	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年2月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	27,816,410	95.3
コール・ローン等、その他	1,364,226	4.7
投資信託財産総額	29,180,636	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 (2022年2月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	29,175,960,471
コール・ローン等	1,258,261,411
株式(評価額)	27,816,410,880
未収入金	1,832,180
未収配当金	42,486,000
差入委託証拠金	56,970,000
(B) 負債	360,848,985
未払金	12,417,080
未払収益分配金	232,066,543
未払解約金	14,954,015
未払信託報酬	100,922,226
未払利息	848
その他未払費用	488,273
(C) 純資産総額(A-B)	28,815,111,486
元本	29,008,317,920
次期繰越損益金	△ 193,206,434
(D) 受益権総口数	29,008,317,920口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,933円

(注) 期首元本額は25,754,179,092円、期中追加設定元本額は9,011,514,264円、期中一部解約元本額は5,757,375,436円、1口当たり純資産額は0.9933円です。

○損益の状況 (2021年2月18日～2022年2月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	429,338,744
受取配当金	427,973,213
受取利息	△ 3
その他収益金	1,604,574
支払利息	△ 239,040
(B) 有価証券売買損益	△ 2,623,877,328
売買益	2,142,421,659
売買損	△ 4,766,298,987
(C) 先物取引等取引損益	△ 56,484,256
取引益	159,585,105
取引損	△ 216,069,361
(D) 信託報酬等	△ 196,930,211
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 2,447,953,051
(F) 前期繰越損益金	7,518,181,862
(G) 追加信託差損益金	△ 5,031,368,702
(配当等相当額)	(28,056,425,566)
(売買損益相当額)	(△33,087,794,268)
(H) 計(E+F+G)	38,860,109
(I) 収益分配金	△ 232,066,543
次期繰越損益金(H+I)	△ 193,206,434
追加信託差損益金	△ 5,031,368,702
(配当等相当額)	(28,056,425,566)
(売買損益相当額)	(△33,087,794,268)
分配準備積立金	7,518,523,852
繰越損益金	△ 2,680,361,584

* 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(2021年2月18日～2022年2月17日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年2月18日～ 2022年2月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	232,408,533円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	28,056,425,566円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,518,181,862円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	35,807,015,961円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,343円
g. 分配金	232,066,543円
h. 分配金(1万口当たり)	80円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	80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

該当事項はございません。