

北陸・北海道インデックス ファンド

(愛称:ほくほくインデックス ファンド)

運用報告書(全体版)

第11期 (決算日2016年10月6日)

作成対象期間 (2015年10月7日～2016年10月6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	2005年10月11日から2020年10月6日(当初、2015年10月6日)までです。
運用方針	野村證券株式会社の金融工学等研究部門の発表する野村日本株地域別インデックスの北陸・北海道インデックスに連動する投資成果を目指すことで、信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。 株式の組入比率は、高位を基本とします。非株式割合(株式以外の資産への投資割合)は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。
主な投資対象	わが国の株式のうち、北陸3県(富山県、石川県、福井県)及び北海道で重要な活動を行っている企業の株式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	毎決算時に、原則として配当等収益等を中心に分配を行うことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。 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。

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 (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 込 分 配	み 金	期 騰 落 率	北 陸 ・ 北 海 道 インデックス	期 騰 落 率			
7期(2012年10月9日)	円 5,655	円 55	% △ 2.2	67.08	% △ 3.9	% 97.5	% —	百万円 701	
8期(2013年10月7日)	8,711	80	55.5	104.24	55.4	97.8	—	950	
9期(2014年10月6日)	10,135	100	17.5	121.91	17.0	97.9	—	818	
10期(2015年10月6日)	11,808	110	17.6	142.39	16.8	97.8	—	600	
11期(2016年10月6日)	10,929	100	△ 6.6	131.42	△ 7.7	97.2	—	494	

*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 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
			北 陸 ・ 北 海 道 インデックス	騰 落 率		
(期 首) 2015年10月6日	円 11,808	% —	142.39	% —	% 97.8	% —
10月末	12,238	3.6	147.69	3.7	97.6	—
11月末	12,488	5.8	150.79	5.9	97.5	—
12月末	12,295	4.1	148.33	4.2	97.8	—
2016年1月末	11,361	△ 3.8	136.98	△ 3.8	97.5	—
2月末	10,317	△12.6	124.10	△12.8	96.8	—
3月末	10,891	△ 7.8	130.37	△ 8.4	96.8	—
4月末	10,802	△ 8.5	129.35	△ 9.2	97.0	—
5月末	11,168	△ 5.4	133.92	△ 5.9	97.0	—
6月末	10,400	△11.9	124.42	△12.6	97.1	—
7月末	10,858	△ 8.0	130.03	△ 8.7	97.7	—
8月末	10,578	△10.4	126.64	△11.1	97.5	—
9月末	10,852	△ 8.1	129.21	△ 9.3	97.2	—
(期 末) 2016年10月6日	11,029	△ 6.6	131.42	△ 7.7	97.2	—

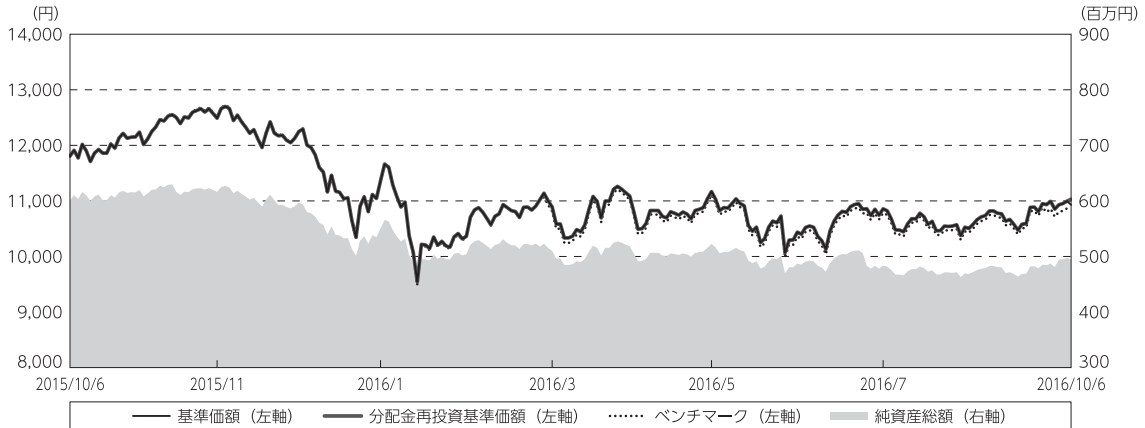
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

※「北陸・北海道インデックス」は、北陸3県（富山県、石川県、福井県）及び北海道を対象とした地域別インデックスで、「野村日本株地域別インデックス」のシリーズの一つです。
「野村日本株地域別インデックス」とは、野村証券株式会社の金融工学等研究部門が作成している株価指数で、日本の株式を本社の所在地及び生産・製造拠点の所在等の重要な活動を行っている地域に従って分類し、特定の都道府県を合せた地域毎に計測する株価指数です。
※野村日本株地域別インデックスの知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (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（2015年10月6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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、北陸・北海道インデックスです。ベンチマークは、作成期首（2015年10月6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11,808円から期末11,029円（分配金込み）に779円の値下がりとなりました。

原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことや円高の進行により企業業績への影響が懸念されたことなどから、基準価額は下落しました。

○投資環境

株式市場は、期首から2015年11月下旬まで、中国経済への懸念が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）総裁の追加金融緩和を示唆する発言など世界的な金融緩和継続の流れ、国内企業の決算への期待などを背景に上昇しました。

12月以降は、中国経済や米国経済への先行き懸念が高まったこと、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したこと、円高の進行により企業業績への影響が懸念されたこと、日銀によるマイナス金利導入の影響により金融機関の利益減少懸念が高まったことなどから下落しました。

その後は、日銀による追加金融緩和期待や、消費増税延期や大型補正予算などへの政策期待、円高の進行が継続したこと、英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票への見方などを巡り、一進一退の展開となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式組入比率は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

北陸・北海道インデックスの動きに連動した投資成果を目指すため、北陸・北海道インデックスに採用されている銘柄に幅広く分散投資し、随時銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を行いました。

○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-6.6%となり、ベンチマークである北陸・北海道インデックスの-7.7%を1.1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

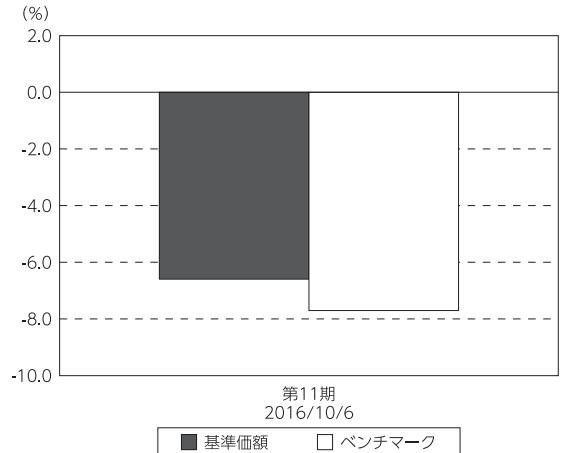
(マイナス要因)

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

(その他、差異を生じた要因)

株式の組入比率が100%でないこと（市況の上昇時にはマイナスに、下落時にはプラスに作用）

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、北陸・北海道インデックスです。

◎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11期
	2015年10月7日～ 2016年10月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	100 0.907%
当期の収益	100
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,824

(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。

◎今後の運用方針

今後も、北陸・北海道インデックスに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。

今後とも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

(2015年10月7日～2016年10月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	円 97 (45) (45) (6)	% 0.864 (0.405) (0.405) (0.054)	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 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 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 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 (株 式)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 (監 査 費 用)	0 (0)	0.003 (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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	97	0.867	
期中の平均基準価額は、11,187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

(2015年10月7日～2016年10月6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		10 (△61)	19,581 (-)	62	85,115

* 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。

○株式売買比率

(2015年10月7日～2016年10月6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	104,697千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	514,154千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

* (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

(2015年10月7日～2016年10月6日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
預金	百万円 384	百万円 384	% 100.0	百万円 384	百万円 384	% 100.0

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
株式	百万円 -	百万円 0.22454	百万円 1

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年10月6日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
ホクリョウ	—	0.4	318
鉱業 (0.4%)			
国際石油開発帝石	2	1.8	1,710
建設業 (2.1%)			
コムシスホールディングス	0.2	—	—
大成建設	1	1	750
大林組	1	0.7	687
清水建設	1	1	893
長谷工コーポレーション	0.3	0.3	285
鹿島建設	1	1	694
土屋ホールディングス	1.3	0.6	108
大東建託	0.1	0.1	1,592
住友林業	0.2	—	—
日成ビルド工業	4	3	1,494
大和ハウス工業	0.7	0.6	1,626
積水ハウス	0.7	0.7	1,179
北陸電気工事	0.6	0.6	418
きんでん	—	0.2	238
食料品 (4.1%)			
日清製粉グループ本社	0.2	0.1	154
山崎製パン	—	0.2	497
カルビー	0.2	0.1	379
ヤクルト本社	0.1	0.1	463
明治ホールディングス	0.1	0.1	1,008
アサヒグループホールディングス	0.5	0.5	1,860
キリンホールディングス	1.1	1	1,682
北海道コカ・コーラボトリング	1	1	626
味の素	1	0.7	1,598
東洋水産	0.1	0.1	442
日清食品ホールディングス	0.1	0.1	614
日本たばこ産業	2.7	2.5	10,215
北の達人コーポレーション	0.5	0.5	232

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
繊維製品 (1.4%)			
帝人	2	0.3	592
東レ	1	1	951
サカイオーベックス	3	0.3	606
北日本紡績	1	1	87
セーレン	1.6	2.9	3,575
小松精練	1.1	1	656
パルプ・紙 (0.5%)			
王子ホールディングス	1	1	406
日本製紙	0.1	0.1	184
中越パルプ工業	7	6	1,368
朝日印刷	0.3	0.2	476
化学 (3.2%)			
旭化成	1	1	821
昭和電工	1	0.1	136
日産化学工業	0.3	0.3	937
東ソー	1	—	—
デンカ	1	1	457
信越化学工業	0.6	0.5	3,748
田中化学研究所	0.7	0.7	707
エア・ウォーター	—	0.3	567
大陽日酸	0.3	—	—
三菱瓦斯化学	—	0.2	300
三井化学	1	1	505
三菱ケミカルホールディングス	2.2	2	1,332
積水化学工業	0.2	0.2	298
宇部興産	2	2	404
日華化学	0.4	0.4	391
D I C	1	0.1	323
富士フィルムホールディングス	0.6	0.6	2,277
小林製薬	0.1	0.1	535
日東電工	0.2	0.2	1,344
三光合成	1	1	302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
医薬品 (5.0%)			
協和発酵キリン	1	0.9	1,409
塩野義製薬	0.7	0.6	3,134
田辺三菱製薬	1	0.4	862
小野薬品工業	0.4	1.6	4,945
参天製薬	1.7	1.5	2,280
ツムラ	0.3	—	—
日医工	3	2.7	5,297
ダイト	0.6	0.6	1,409
大塚ホールディングス	0.8	0.7	3,192
大正製薬ホールディングス	0.1	0.1	1,022
ジーンテクノサイエンス	0.1	0.4	574
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	0.2	0.2	192
出光興産	0.4	—	—
JXホールディングス	4	3.6	1,468
ゴム製品 (0.5%)			
東洋ゴム工業	0.2	0.2	301
ブリヂストン	0.6	0.6	2,299
ガラス・土石製品 (1.3%)			
旭硝子	2	2	1,334
日本電気硝子	2	2	1,056
太平洋セメント	2	2	580
三谷セキサン	0.6	0.6	1,497
日本碍子	1	0.8	1,695
鉄鋼 (0.7%)			
新日鐵住金	1.2	1.1	2,350
ジェイ エフ イー ホールディングス	0.7	0.6	921
非鉄金属 (0.4%)			
三菱マテリアル	1	0.1	273
住友金属鉱山	1	—	—
CKサンエツ	0.2	0.2	239
住友電気工業	0.9	0.8	1,188
金属製品 (1.2%)			
SUMCO	—	0.5	467
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,378
東洋製織グループホールディングス	0.1	0.1	180
三協立山	1.6	1.4	2,156

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
LIXILグループ	0.3	0.3	682
リンナイ	0.1	0.1	937
機械 (5.1%)			
タケダ機械	1	—	—
高松機械工業	0.3	0.2	121
エイチアンドエフ	0.5	0.4	563
石川製作所	3	0.3	198
津田駒工業	3	3	498
小松製作所	2.4	2.2	5,189
日立建機	0.3	0.3	619
クボタ	1	1.3	2,031
澁谷工業	1.4	1.3	2,622
荏原製作所	1	0.1	313
ダイキン工業	0.5	0.4	3,845
栗田工業	0.2	0.2	484
大同工業	2	2	462
オリエンタルチェン工業	1	1	94
日本精工	0.6	0.5	548
NTN	1	1	371
不二越	12	11	4,048
三菱重工業	4	4	1,740
IHI	4	3	885
電気機器 (7.8%)			
日立製作所	3	3	1,541
東芝	4	4	1,385
三菱電機	1	1.2	1,599
富士電機	1	1	494
日本電産	0.5	0.4	3,741
オムロン	0.2	0.2	748
日本電気	4	3	798
富士通	3	2	1,137
セイコーエプソン	0.7	0.6	1,180
EIZO	1.1	1	2,818
ジャパンディスプレイ	1.5	—	—
パナソニック	2	1.8	1,876
横河電機	0.8	0.7	959
コーセル	0.9	0.8	1,033
アイ・オー・データ機器	0.7	0.7	724

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ファンック	0.4	0.3	5,407
京セラ	0.4	0.3	1,489
日本抵抗器製作所	1	1	112
村田製作所	0.8	0.7	9,369
北陸電気工業	5	4	496
リコー	0.7	0.6	551
輸送用機器 (14.2%)			
デンソー	0.7	0.6	2,509
三井造船	1	—	—
川崎重工業	2	2	576
日産自動車	5.6	4.9	4,978
いすゞ自動車	2.6	2.4	2,949
トヨタ自動車	6	5.3	31,969
日野自動車	1	0.9	980
三菱自動車工業	1.7	1.6	772
アイシン精機	0.8	0.8	3,840
マツダ	1.5	1.3	2,152
本田技研工業	3	2.7	8,294
スズキ	2.3	1.8	6,280
ヤマハ発動機	1.4	1.3	2,801
精密機器 (0.0%)			
シチズン時計	0.4	0.4	219
その他製品 (1.4%)			
前田工織	1.6	1.4	1,601
ウイルコホールディングス	1	1	146
凸版印刷	1	1	940
大日本印刷	1	1	1,012
アシックス	0.5	0.4	856
コマンシー	0.2	—	—
小松ウオール工業	0.5	0.5	847
ヤマハ	0.5	0.4	1,378
電気・ガス業 (4.5%)			
関西電力	2.3	2.1	1,937
北陸電力	9.8	8.8	10,656
北海道電力	10.6	9.6	8,102
電源開発	0.2	0.2	488
北海道瓦斯	2	2	554

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (1.0%)			
西日本旅客鉄道	0.4	0.4	2,539
西武ホールディングス	—	0.2	347
日本通運	1	1	485
ヤマトホールディングス	0.4	0.4	943
トナミホールディングス	2	2	522
海運業 (0.2%)			
日本郵船	2	2	394
商船三井	1	1	244
川崎汽船	1	1	265
空運業 (0.4%)			
日本航空	0.4	0.3	904
ANAホールディングス	4	3	831
情報・通信業 (8.0%)			
T I S	—	0.1	268
ネクソン	—	0.4	644
野村総合研究所	0.32	0.2	719
CEホールディングス	0.2	0.2	206
オービック	0.1	0.1	526
ヤフー	6	5.4	2,203
トレンドマイクロ	0.1	0.1	361
日本オラクル	0.1	—	—
大塚商会	0.1	0.1	502
日本電信電話	2.4	2	9,340
KDD I	2.8	2.5	7,717
NTTドコモ	2.1	1.9	4,770
東宝	0.2	0.2	646
エヌ・ティ・ティ・データ	0.3	0.3	1,548
S C S K	—	0.1	396
福井コンピュータホールディングス	0.6	0.5	1,227
ソフトバンクグループ	1.3	1.1	7,289
卸売業 (3.0%)			
双日	1.3	1.2	322
アルフレッサ ホールディングス	0.2	0.2	428
黒谷	0.2	0.2	88
メディアバルホールディングス	0.3	0.2	353
伊藤忠商事	1.7	1.6	2,061
丸紅	1.8	1.6	848

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
豊田通商	0.4	0.3	717
三井物産	1.9	1.7	2,377
住友商事	1.3	1.2	1,392
三菱商事	1.7	1.5	3,476
三谷商事	0.8	0.7	2,117
三谷産業	1.4	1.2	382
小売業 (21.7%)			
ローソン	0.1	0.1	802
エービーシー・マート	0.1	0.1	650
日本マクドナルドホールディングス	0.1	—	—
ゲンキョー	0.3	0.3	1,225
サッポロドラッグストア	0.2	—	—
J. フロント リテイリング	0.2	0.2	282
マツモトキヨシホールディングス	—	0.1	538
スタートトゥデイ	—	0.3	549
三越伊勢丹ホールディングス	0.2	0.2	214
セブン&アイ・ホールディングス	0.9	0.8	3,861
ツルハホールディングス	1.8	1.6	18,096
クスリのアオキ	1.6	1.4	6,741
丸千代山岡家	—	0.1	123
サツドラホールディングス	—	0.2	392
メディカルシステムネットワーク	1.5	1.3	625
マックスバリュ北海道	0.2	0.2	640
アルビス	0.2	0.2	434
イオン北海道	2.6	2.4	1,288
ドンキホーテホールディングス	0.2	0.2	783
P L A N T	0.4	0.4	469
ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.1	0.1	665
青山商事	—	0.1	352
大和	1	1	118
イオン	0.9	0.8	1,197
アインホールディングス	1.6	1.4	9,310
ヤマダ電機	1	0.9	461
ニトリホールディングス	4.4	3.9	47,307
アークス	2.8	1.3	3,270
ハチパン	—	0.1	303
ファーストリテイリング	0.1	0.1	3,404

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銀行業 (3.4%)			
福井銀行	6	5	1,365
北國銀行	8	7	2,282
富山銀行	—	0.1	398
ほくほくフィナンシャルグループ	67	6	8,592
セブン銀行	1.3	1.1	350
北洋銀行	19.7	8.9	3,284
証券、商品先物取引業 (0.7%)			
今村証券	0.1	0.1	86
S B I ホールディングス	0.2	0.2	244
大和証券グループ本社	2	2	1,192
野村ホールディングス	4	3.6	1,707
保険業 (1.8%)			
S O M P O ホールディングス	0.4	0.4	1,300
MS&ADインシュアランスグループホール	0.7	0.6	1,732
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.5	0.4	565
第一生命ホールディングス	1.3	1.1	1,598
東京海上ホールディングス	0.8	0.7	2,820
T & D ホールディングス	0.7	0.6	712
その他金融業 (0.8%)			
クレディセゾン	0.2	0.2	344
イオンフィナンシャルサービス	0.2	0.2	361
アコム	—	1.5	711
オリックス	1.4	1.3	1,906
三菱UFJリース	0.9	0.8	382
不動産業 (1.4%)			
ヒューリック	0.7	0.6	598
野村不動産ホールディングス	0.2	0.2	324
東急不動産ホールディングス	0.7	0.6	320
飯田グループホールディングス	0.3	0.3	588
パーク24	0.2	0.1	328
三井不動産	1	1	2,134
三菱地所	1	1	1,882
東京建物	0.2	0.2	245
住友不動産	1	—	—
レオパレス21	0.3	—	—
イオンモール	0.2	0.1	148
日本空港ビルデング	0.1	0.1	379

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サービス業 (3.4%)			
ミクシィ	0.1	—	—
テンブホールディングス	—	0.2	355
総合警備保障	—	0.1	536
カカココム	0.2	0.2	361
エムスリー	0.3	0.3	1,033
ディー・エヌ・エー	0.2	0.1	351
博報堂DYホールディングス	0.4	0.4	482
電通	0.3	0.3	1,572
みらかホールディングス	0.1	0.1	509
S Dエンターテイメント	0.2	0.2	129
リゾートトラスト	0.1	0.1	203
ユー・エス・エス	0.3	0.3	526

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サイバーエージェント	0.1	0.1	303
楽天	1.5	1.4	1,834
リクルートホールディングス	—	0.5	2,090
カナモト	1.8	1.6	4,033
セコム	0.2	0.2	1,525
進学会	0.5	0.4	201
札幌臨床検査センター	0.1	0.1	106
ベネッセホールディングス	0.1	0.1	269
合 計	株 数・金 額	409	296
	銘柄数<比率>	260	264 <97.2%>

*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。

○投資信託財産の構成

(2016年10月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 480,152	% 95.9
コール・ローン等、その他	20,678	4.1
投資信託財産総額	500,830	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 (2016年10月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	500,830,631
コール・ローン等	17,383,505
株式(評価額)	480,152,440
未収配当金	3,294,686
(B) 負債	6,649,640
未払収益分配金	4,521,900
未払信託報酬	2,119,840
未払利息	17
その他未払費用	7,883
(C) 純資産総額(A-B)	494,180,991
元本	452,190,049
次期繰越損益金	41,990,942
(D) 受益権総口数	452,190,049口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,929円

(注) 期首元本額は508,785,745円、期中追加設定元本額は32,125,362円、期中一部解約元本額は88,721,058円、1口当たり純資産額は1.0929円です。

○損益の状況 (2015年10月7日～2016年10月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	9,629,173
受取配当金	9,615,577
受取利息	3,105
その他収益金	13,748
支払利息	△ 3,257
(B) 有価証券売買損益	△38,439,521
売買益	37,122,687
売買損	△75,562,208
(C) 信託報酬等	△ 4,578,794
(D) 当期損益金(A+B+C)	△33,389,142
(E) 前期繰越損益金	61,434,326
(F) 追加信託差損益金	18,467,658
(配当等相当額)	(20,553,961)
(売買損益相当額)	(△ 2,086,303)
(G) 計(D+E+F)	46,512,842
(H) 収益分配金	△ 4,521,900
次期繰越損益金(G+H)	41,990,942
追加信託差損益金	18,467,658
(配当等相当額)	(20,553,961)
(売買損益相当額)	(△ 2,086,303)
分配準備積立金	61,962,805
繰越損益金	△38,439,521

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買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(C)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(F)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(2015年10月7日～2016年10月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年10月7日～ 2016年10月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	5,050,379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	20,553,961円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	61,434,326円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	87,038,666円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,924円
g. 分配金	4,521,900円
h. 分配金(1万口当たり)	100円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	100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。