

野村つみたて日本株投信

運用報告書(全体版)

第1期(決算日2018年5月14日)

作成対象期間(2017年10月2日～2018年5月14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	2017年10月2日以降、無期限とします。	
運用方針	ミリオンのインデックスマザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券を主要投資対象とし、わが国の株式市場全体の長期的成長をとらえることを目標に、日経平均株価(日経225)と連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主な投資対象	野村つみたて日本株投信 マザーファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式に直接投資する場合があります。 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	野村つみたて日本株投信 マザーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。 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、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。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/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	中期	日経平均株価 (日経225)	中期			
(設定日)	円	円	%	円	%	%	%	百万円
2017年10月2日	10,000	—	—	20,356	—	—	—	1
1期(2018年5月14日)	11,340	0	13.4	22,866	12.3	97.5	2.5	437

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日経平均株価（日経225）に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

○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
		騰落率	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(設定日)	円	%	%	円	%	%	%
2017年10月2日	10,000	—	—	20,356	—	—	—
10月末	10,812	8.1	8.1	22,012	8.1	96.9	3.0
11月末	11,171	11.7	11.6	22,725	11.6	96.9	3.0
12月末	11,205	12.1	11.8	22,765	11.8	98.1	1.9
2018年1月末	11,370	13.7	13.5	23,098	13.5	97.9	2.0
2月末	10,864	8.6	8.4	22,068	8.4	97.9	2.1
3月末	10,639	6.4	5.4	21,454	5.4	97.0	3.0
4月末	11,144	11.4	10.4	22,468	10.4	98.3	1.7
(期末)							
2018年5月14日	11,340	13.4	12.3	22,866	12.3	97.5	2.5

*騰落率は設定日比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：11,340円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 13.4% (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。
- (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、設定時を10,000として計算しております。
- (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、設定時10,000円から期末11,340円に1,340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や、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、米国の経済指標が堅調だったことや、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、外国為替市場で円高ドル安が進行したことや、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながるなどの懸念などから下落しました。3月下旬以降は、米中貿易摩擦懸念が薄れたこと、円高ドル安が一服したことなどから上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村つみたて日本株投信]

主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド」受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。

[ミリオン・インデックスマザーファンド]

・株式組入比率

実質の株式組入比率（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（日経225）の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価（日経225）に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価（日経225）採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

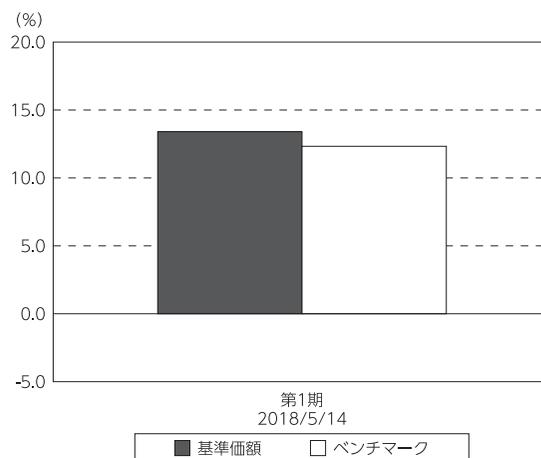
○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+13.4%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+12.3%を1.1ポイント上回りました。

(主な差異要因)

- ・保有銘柄が配当権利落ちし、ファンドには未収配当金が計上されたこと
- ・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、基準価額水準等を勘案し見送ら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 1 期
	2017年10月2日～ 2018年5月14日
当期分配金	—
(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	1,340

(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

[野村つみたて日本株投信]

主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド」受益証券を高位に組入れ、引き続き、日経平均株価（日経225）の動きに連動する投資成果を目指します。

[ミリオン・インデックスマザーファンド]

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、日経平均株価（日経225）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

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

(2017年10月2日～2018年5月14日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 12	% 0.113	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(6)	(0.050)	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)	(6)	(0.050)	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)	(1)	(0.013)	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	0.002	(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)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(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)	(0.002)	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	12	0.117	
期中の平均基準価額は、11,029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。

* 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、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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10月2日～2018年5月14日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 319,762	千円 424,244	千口 992	千円 1,330

* 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年10月2日～2018年5月14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	
	ミリオン・インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	58,123,062千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	56,417,498千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.03	

* (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10月2日～2018年5月14日)

利害関係人との取引状況

<野村つみたて日本株投信>

該当事項はございません。

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

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 33,860	百万円 138	% 0.4	百万円 24,262	百万円 -	% -

平均保有割合 0.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 37	百万円 26	百万円 60

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)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.0%

* 売買委託手数料総額は、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、当ファンドに対応するものです。

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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2017年10月2日～2018年5月14日)

設定時残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2018年5月14日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
ミリオン・インデックスマザーファンド		千口 318,770	千円 437,353

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年5月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ミリオン・インデックスマザーファンド	千円 437,353	% 99.9
コール・ローン等、その他	423	0.1
投資信託財産総額	437,776	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5月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	437,776,219
コール・ローン等	329,654
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	437,353,367
未収入金	93,198
(B) 負債	379,426
未払解約金	254,049
未払信託報酬	123,188
その他未払費用	2,189
(C) 純資産総額(A-B)	437,396,793
元本	385,706,916
次期繰越損益金	51,689,877
(D) 受益権総口数	385,706,916口
1万円当たり基準価額(C/D)	11,340円

(注) 期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は387,052,759円、期中一部解約元本額は2,345,843円、1口当たり純資産額は1.1340円です。

○損益の状況 (2017年10月2日～2018年5月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2
支払利息	△ 2
(B) 有価証券売買損益	14,385,015
売買益	14,458,062
売買損	△ 73,047
(C) 信託報酬等	△ 125,377
(D) 当期損益金(A+B+C)	14,259,636
(E) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	(37,430,241)
(F) 計(D+E)	51,689,877
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	51,689,877
追加信託差損益金 (配当等相当額)	(790,667)
(売買損益相当額)	(36,639,574)
分配準備積立金	14,259,636

*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(E)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10月2日～2018年5月14日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年10月2日～ 2018年5月14日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,684,719円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	12,574,917円
c. 信託約款に定める収益調整金	37,430,241円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	51,689,877円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,340円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	0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。

(2018年5月14日現在)

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

下記は、ミリオン・インデックスマザーファンド全体(45,139,896千口)の内容です。

国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)		
日本水産	98	57,330
マルハニチロ	9.8	40,131
鉱業 (0.1%)		
国際石油開発帝石	39.2	53,429
建設業 (2.9%)		
コムシスホールディングス	98	303,310
大成建設	19.6	120,344
大林組	98	120,932
清水建設	98	110,740
長谷工コーポレーション	19.6	33,751
鹿島建設	98	102,802
大和ハウス工業	98	418,264
積水ハウス	98	197,764
日揮	98	249,508
千代田化工建設	98	103,292
食料品 (4.7%)		
日清製粉グループ本社	98	241,374
明治ホールディングス	19.6	175,224
日本ハム	49	222,705
サッポロホールディングス	19.6	57,565
アサヒグループホールディングス	98	579,474
キリンホールディングス	98	288,365
宝ホールディングス	98	140,042
キッコーマン	98	498,820
味の素	98	202,664
ニチレイ	49	147,245
日本たばこ産業	98	297,724
繊維製品 (0.3%)		
東洋紡	9.8	19,178
ユニチカ	9.8	6,585
帝人	19.6	42,590
東レ	98	90,934

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
パルプ・紙 (0.1%)		
王子ホールディングス	98	72,324
日本製紙	9.8	20,197
化学 (9.0%)		
クラレ	98	177,086
旭化成	98	145,530
昭和電工	9.8	41,846
住友化学	98	62,230
日産化学工業	98	481,670
東ソー	49	98,196
トクヤマ	19.6	76,734
デンカ	19.6	86,436
信越化学工業	98	1,127,490
三井化学	19.6	62,818
三菱ケミカルホールディングス	49	48,960
宇部興産	9.8	33,222
日本化薬	98	126,910
花王	98	759,206
富士フイルムホールディングス	98	422,184
資生堂	98	816,340
日東電工	98	840,840
医薬品 (7.4%)		
協和発酵キリン	98	217,854
武田薬品工業	98	470,204
アステラス製薬	490	822,220
大日本住友製薬	98	175,028
塩野義製薬	98	561,246
中外製薬	98	575,260
エーザイ	98	723,730
第一三共	98	381,514
大塚ホールディングス	98	520,968
石油・石炭製品 (0.4%)		
昭和シェル石油	98	158,858

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
JXTGホールディングス	98	70,011
ゴム製品 (0.9%)		
横浜ゴム	49	125,636
ブリヂストン	98	440,216
ガラス・土石製品 (1.6%)		
旭硝子	19.6	94,668
日本板硝子	9.8	10,613
日本電気硝子	29.4	94,815
住友大阪セメント	98	48,902
太平洋セメント	9.8	39,249
東海カーボン	98	170,716
TOTO	49	287,140
日本碍子	98	202,958
鉄鋼 (0.2%)		
新日鐵住金	9.8	24,509
神戸製鋼所	9.8	11,642
ジェイ エフ イー ホールディングス	9.8	23,534
日新製鋼	9.8	14,690
大太平洋金属	9.8	35,721
非鉄金属 (1.3%)		
日本軽金属ホールディングス	98	29,302
三井金属鉱業	9.8	48,853
東邦亜鉛	9.8	45,619
三菱マテリアル	9.8	31,458
住友金属鉱山	49	229,908
DOWAホールディングス	19.6	73,598
古河機械金属	9.8	17,640
古河電気工業	9.8	47,383
住友電気工業	98	171,990
フジクラ	98	79,086
金属製品 (0.3%)		
SUMCO	9.8	27,704
東洋製織グループホールディングス	98	165,718
機械 (5.3%)		
日本製鋼所	19.6	69,090
オークマ	19.6	136,416
アマダホールディングス	98	130,438
小松製作所	98	359,072
住友重機械工業	19.6	81,928
日立建機	98	399,840

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
クボタ	98	185,710
荏原製作所	19.6	85,064
ダイキン工業	98	1,310,750
日本精工	98	140,728
NTN	98	47,726
ジェイテクト	98	169,540
日立造船	19.6	11,387
三菱重工業	9.8	41,199
I H I	9.8	39,004
電気機器 (19.2%)		
日清紡ホールディングス	98	144,648
コニカミノルタ	98	95,256
ミネベアミツミ	98	221,186
日立製作所	98	85,211
三菱電機	98	162,337
富士電機	98	77,518
安川電機	98	455,210
ジーエス・ユアサ コーポレーション	98	55,174
日本電気	9.8	30,233
富士通	98	66,101
沖電気工業	9.8	12,916
セイコーエプソン	196	410,032
パナソニック	98	160,083
ソニー	98	518,322
TDK	98	1,015,280
アルプス電気	98	272,048
パイオニア	98	17,444
横河電機	98	204,232
アドバンテス	196	539,392
カシオ計算機	98	167,972
ファナック	98	2,353,960
京セラ	196	1,329,272
太陽誘電	98	235,690
S C R E E Nホールディングス	19.6	193,648
キヤノン	147	559,041
リコー	98	102,116
東京エレクトロン	98	2,125,620
輸送用機器 (6.1%)		
デンソー	98	560,266
三井E&Sホールディングス	9.8	16,709

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
川崎重工業	9.8	34,741
日産自動車	98	109,368
いすゞ自動車	49	82,344
トヨタ自動車	98	740,880
日野自動車	98	127,890
三菱自動車工業	9.8	8,526
マツダ	19.6	28,439
本田技研工業	196	718,144
スズキ	98	600,740
S U B A R U	98	349,664
ヤマハ発動機	98	326,830
精密機器 (3.1%)		
テルモ	196	1,228,920
ニコン	98	178,850
オリンパス	98	382,690
シチズン時計	98	78,302
その他製品 (1.3%)		
凸版印刷	98	87,612
大日本印刷	49	117,698
ヤマハ	98	574,280
電気・ガス業 (0.2%)		
東京電力ホールディングス	9.8	5,752
中部電力	9.8	16,998
関西電力	9.8	15,910
東京瓦斯	19.6	57,712
大阪瓦斯	19.6	47,089
陸運業 (2.2%)		
東武鉄道	19.6	66,542
東京急行電鉄	49	91,630
小田急電鉄	49	115,542
京王電鉄	19.6	96,138
京成電鉄	49	178,605
東日本旅客鉄道	9.8	105,889
西日本旅客鉄道	9.8	78,478
東海旅客鉄道	9.8	212,954
日本通運	9.8	80,948
ヤマトホールディングス	98	289,884
海運業 (0.1%)		
日本郵船	9.8	24,333
商船三井	9.8	32,340

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
川崎汽船	9.8	24,157
空運業 (0.1%)		
ANAホールディングス	9.8	41,385
倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
三菱倉庫	49	123,872
情報・通信業 (10.3%)		
ヤフー	39.2	15,836
トレンドマイクロ	98	620,340
スカパーJ S A Tホールディングス	9.8	5,047
日本電信電話	19.6	105,683
K D D I	588	1,737,540
NTTドコモ	9.8	27,655
東宝	9.8	37,681
エス・ティ・ティ・データ	490	578,690
コナミホールディングス	98	536,060
ソフトバンクグループ	294	2,536,632
卸売業 (2.3%)		
双日	9.8	4,116
伊藤忠商事	98	199,038
丸紅	98	85,093
豊田通商	98	401,310
三井物産	98	193,011
住友商事	98	188,405
三菱商事	98	309,680
小売業 (11.7%)		
J. フロント リテイリング	49	88,347
三越伊勢丹ホールディングス	98	131,124
セブン&アイ・ホールディングス	98	474,222
ユニー・ファミリーマートホールディングス	98	1,108,380
高島屋	98	91,532
丸井グループ	98	226,478
イオン	98	214,914
ファーストリテイリング	98	4,761,820
銀行業 (0.9%)		
コンソルディア・フィナンシャルグループ	98	61,152
新生銀行	9.8	17,698
あおぞら銀行	9.8	43,659
三菱UFJフィナンシャル・グループ	98	71,020
りそなホールディングス	9.8	6,100
三井住友トラスト・ホールディングス	9.8	46,912

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	9.8	44,619
千葉銀行	98	84,182
ふくおかフィナンシャルグループ	98	57,722
静岡銀行	98	109,858
みずほフィナンシャルグループ	98	19,570
証券、商品先物取引業 (0.4%)		
大和証券グループ本社	98	65,983
野村ホールディングス	98	60,485
松井証券	98	105,742
保険業 (1.0%)		
S O M P Oホールディングス	24.5	116,105
MS&ADインシュアランスグループホール	29.4	110,544
ソニーフィナンシャルホールディングス	19.6	40,376
第一生命ホールディングス	9.8	21,050
東京海上ホールディングス	49	259,945
T & Dホールディングス	19.6	35,819
その他金融業 (0.3%)		
クレディセゾン	98	192,276

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
不動産業 (1.8%)		
東急不動産ホールディングス	98	82,320
三井不動産	98	300,272
三菱地所	98	208,348
東京建物	49	79,478
住友不動産	98	433,356
サービス業 (4.1%)		
ディー・エヌ・エー	29.4	62,710
電通	98	510,580
楽天	98	77,086
リクルートホールディングス	294	827,610
日本郵政	98	129,262
東京ドーム	49	52,087
セコム	98	809,088
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	16,998 60,391,020 225 <97.5%>

*各銘柄の業種分類は、期末の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、このファンドが組み入れているマザーファンドの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 1,531	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

ミリオン・インデックス マザーファンド

運用報告書

第30期（決算日2017年11月7日）

作成対象期間（2016年11月8日～2017年11月7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。

運用方針	わが国の株式市場全体の長期的成長をとらえることを目標に、日経平均株価と連動する投資成果を目指して運用を行います。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行います。資金の流出入に伴う売買に当たっては、原則として買付の場合は高株価の銘柄から順に、売却の場合は低株価の銘柄から順に行います。株式の組入比率は高位を保ちます。
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。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	率	日経平均株価	騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
26期(2013年11月7日)	7,892	61.3	14,228	58.6	98.0	2.0	28,491
27期(2014年11月7日)	9,508	20.5	16,880	18.6	96.2	3.8	34,867
28期(2015年11月9日)	11,242	18.2	19,643	16.4	97.3	2.6	50,424
29期(2016年11月7日)	10,018	△10.9	17,177	△12.6	97.3	2.7	54,313
30期(2017年11月7日)	13,626	36.0	22,938	33.5	96.7	3.3	49,871

*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		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	日経平均株価	騰落率		
(期首) 2016年11月7日	円	%	円	%	%	%
	10,018	-	17,177	-	97.3	2.7
11月末	10,676	6.6	18,308	6.6	97.3	2.7
12月末	11,160	11.4	19,114	11.3	97.5	2.5
2017年1月末	11,118	11.0	19,041	10.9	98.2	1.8
2月末	11,172	11.5	19,119	11.3	96.3	3.7
3月末	11,131	11.1	18,909	10.1	97.0	3.0
4月末	11,302	12.8	19,197	11.8	97.7	2.2
5月末	11,575	15.5	19,651	14.4	96.8	3.2
6月末	11,815	17.9	20,033	16.6	97.9	2.0
7月末	11,752	17.3	19,925	16.0	95.7	4.3
8月末	11,595	15.7	19,646	14.4	98.2	1.8
9月末	12,085	20.6	20,356	18.5	96.3	3.6
10月末	13,069	30.5	22,012	28.1	97.0	3.0
(期末) 2017年11月7日	円	%	円	%	%	%
	13,626	36.0	22,938	33.5	96.7	3.3

*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」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」自体及び「日経平均」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」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「ミリオン・インデックスマザーファンド」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「ミリオン・インデックスマザーファンド」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」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」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」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



(注) ベンチマークは、日経平均株価です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,018円から期末13,626円に3,608円の値上がりとなりました。

外国為替市場で円安が進んだことや、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

株式市場は、米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による業績改善期待、世界的に株式市場が好調だったことなどを受けて、上昇しました。

2017年に入り、米国新政権への期待と不安により一進一退の展開となりました。4月に入り、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しましたが、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。

9月以降は、外国為替市場で円安が進んだことや、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。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質の株式組入比率（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

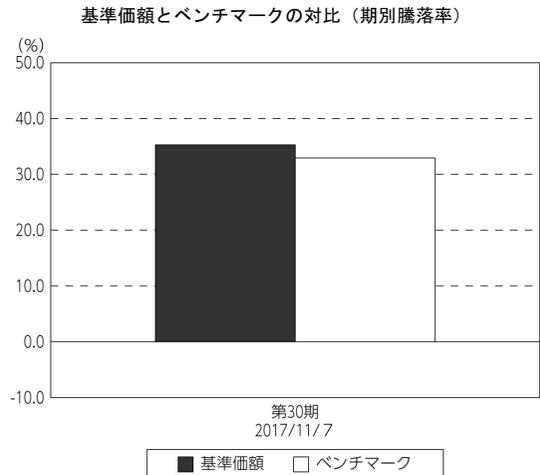
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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+36.0%となり、ベンチマークである日経平均株価の+33.5%を2.5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未収配当金が計上されたこと



(注) ベンチマークは、日経平均株価です。

◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

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

(2016年11月8日～2017年11月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 1 (0) (1)	% 0.007 (0.000) (0.007)	(a) 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	1	0.007	
期中の平均基準価額は、11,537円です。			

*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

(2016年11月8日～2017年11月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 14,636 (△ 2,183)	千円 39,460,079 ()	千株 22,278	千円 59,103,852

*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 70,055	百万円 70,465	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

(2016年11月8日～2017年11月7日)

○株式売買比率

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	98,563,932千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,194,019千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.04

* (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

(2016年11月8日～2017年11月7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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 39,460	百万円 755	% 1.9	百万円 59,103	百万円 21	% 0.0

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 48	百万円 76	百万円 52

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)	3,631千円
うち利害関係人への支払額 (B)	152千円
(B) / (A)	4.2%

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。

(2017年11月7日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.2%)					日本製紙	11.8	7.8	18,345	
日本水産	118	78	50,310		北越紀州製紙	118	—	—	
マルハニチロ	11.8	7.8	25,116		化学 (9.1%)				
鉱業 (0.1%)					クラレ	118	78	183,612	
国際石油開発帝石	47.2	31.2	41,168		旭化成	118	78	109,785	
建設業 (2.9%)					昭和電工	11.8	7.8	30,732	
コムシスホールディングス	118	78	235,170		住友化学	118	78	64,038	
大成建設	118	15.6	103,116		日産化学工業	118	78	350,610	
大林組	118	78	121,758		東ソー	118	39	100,035	
清水建設	118	78	108,342		トクヤマ	118	15.6	54,210	
長谷工コーポレーション	23.6	15.6	26,270		デンカ	118	15.6	60,762	
鹿島建設	118	78	98,280		信越化学工業	118	78	975,780	
大和ハウス工業	118	78	333,372		三井化学	118	15.6	53,352	
積水ハウス	118	78	169,923		三菱ケミカルホールディングス	59	39	47,326	
日揮	118	78	158,496		宇部興産	118	7.8	26,325	
千代田化工建設	118	78	58,110		日本化薬	118	78	141,414	
食料品 (4.6%)					花王	118	78	547,794	
日清製粉グループ本社	118	78	162,630		富士フイルムホールディングス	118	78	360,672	
明治ホールディングス	23.6	15.6	146,484		資生堂	118	78	368,238	
日本ハム	118	78	226,278		日東電工	118	78	911,430	
サッポロホールディングス	23.6	15.6	53,196		医薬品 (7.1%)				
アサヒグループホールディングス	118	78	415,740		協和発酵キリン	118	78	171,132	
キリンホールディングス	118	78	207,051		武田薬品工業	118	78	501,774	
宝ホールディングス	118	78	89,154		アステラス製薬	590	390	589,680	
キッコーマン	118	78	316,290		大日本住友製薬	118	78	131,118	
味の素	118	78	180,063		塩野義製薬	118	78	488,592	
ニチレイ	59	39	119,925		中外製薬	118	78	439,140	
日本たばこ産業	118	78	299,520		エーザイ	118	78	507,936	
繊維製品 (0.3%)					第一三共	118	78	210,951	
東洋紡	118	7.8	17,175		大塚ホールディングス	—	78	376,428	
ユニチカ	118	7.8	7,792		石油・石炭製品 (0.3%)				
帝人	23.6	15.6	38,594		昭和シェル石油	118	78	112,320	
東レ	118	78	92,664		J X T Gホールディングス	118	78	49,186	
パルプ・紙 (0.1%)					ゴム製品 (1.1%)				
王子ホールディングス	118	78	52,884		横浜ゴム	59	39	100,659	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	118	78	436,098
ガラス・土石製品 (1.6%)			
旭硝子	118	15.6	75,582
日本板硝子	11.8	7.8	8,073
日本電気硝子	177	23.4	110,799
住友大阪セメント	118	78	38,610
太平洋セメント	118	7.8	35,841
東海カーボン	118	78	94,068
TOTO	59	39	224,640
日本碍子	118	78	170,586
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	11.8	7.8	20,962
神戸製鋼所	11.8	7.8	8,439
ジェイ エフ イー ホールディングス	11.8	7.8	20,229
日新製鋼	11.8	7.8	12,893
大太平洋金属	118	7.8	25,974
非鉄金属 (1.5%)			
日本軽金属ホールディングス	118	78	25,662
三井金属鉱業	118	7.8	47,424
東邦亜鉛	118	7.8	47,268
三菱マテリアル	11.8	7.8	34,944
住友金属鉱山	118	39	190,710
DOWAホールディングス	118	15.6	77,454
古河機械金属	118	7.8	16,551
古河電気工業	11.8	7.8	46,878
住友電気工業	118	78	150,891
フジクラ	118	78	77,688
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	11.8	7.8	20,178
東洋製罐グループホールディングス	118	78	151,554
機械 (5.5%)			
日本製鋼所	23.6	15.6	52,728
オークマ	118	15.6	112,788
アマダホールディングス	118	78	113,568
小松製作所	118	78	298,896
住友重機械工業	118	15.6	79,560
日立建機	118	78	315,900
クボタ	118	78	169,728
荏原製作所	23.6	15.6	67,080
ダイキン工業	118	78	1,031,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	118	78	131,898
NTN	118	78	44,148
ジェイテクト	118	78	159,510
日立造船	23.6	15.6	9,781
三菱重工業	118	7.8	34,702
I H I	118	7.8	28,821
電気機器 (20.7%)			
日清紡ホールディングス	118	78	108,108
コニカミノルタ	118	78	84,630
ミネベアミツミ	118	78	169,806
日立製作所	118	78	70,184
東芝	118	—	—
三菱電機	118	78	151,047
富士電機	118	78	66,612
安川電機	118	78	335,790
明電舎	118	—	—
ジーエス・ユアサ コーポレーション	118	78	45,240
日本電気	118	7.8	23,595
富士通	118	78	67,321
沖電気工業	11.8	7.8	12,394
セイコーエプソン	—	156	425,724
パナソニック	118	78	134,901
ソニー	118	78	410,358
T D K	118	78	710,580
ミツミ電機	118	—	—
アルプス電気	118	78	288,990
パイオニア	118	78	17,940
横河電機	118	78	169,104
アドバンテスト	236	156	406,068
カシオ計算機	118	78	132,210
ファナック	118	78	2,197,260
京セラ	236	156	1,270,464
太陽誘電	118	78	157,248
S C R E E Nホールディングス	23.6	15.6	170,820
キヤノン	177	117	509,652
リコー	118	78	79,794
東京エレクトロン	118	78	1,754,220
輸送用機器 (6.4%)			
デンソー	118	78	504,972
三井造船	118	7.8	12,573

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎重工業	118	7.8	31,044
日産自動車	118	78	86,658
いすゞ自動車	59	39	69,088
トヨタ自動車	118	78	560,274
日野自動車	118	78	108,186
三菱自動車工業	11.8	7.8	7,059
マツダ	23.6	15.6	24,733
本田技研工業	236	156	598,572
スズキ	118	78	492,960
S U B A R U	118	78	294,684
ヤマハ発動機	118	78	276,120
精密機器 (2.8%)			
テルモ	236	156	760,500
ニコン	118	78	174,798
オリンパス	118	78	340,860
シチズン時計	118	78	66,144
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	118	78	91,728
大日本印刷	118	39	111,111
ヤマハ	118	78	322,140
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	11.8	7.8	3,689
中部電力	11.8	7.8	11,766
関西電力	11.8	7.8	12,148
東京瓦斯	118	15.6	43,680
大阪瓦斯	118	15.6	34,795
陸運業 (2.0%)			
東武鉄道	118	15.6	53,664
東京急行電鉄	118	39	68,913
小田急電鉄	59	39	90,051
京王電鉄	118	15.6	77,922
京成電鉄	59	39	132,600
東日本旅客鉄道	11.8	7.8	87,711
西日本旅客鉄道	11.8	7.8	65,067
東海旅客鉄道	11.8	7.8	163,878
日本通運	118	7.8	54,522
ヤマトホールディングス	118	78	179,322
海運業 (0.1%)			
日本郵船	118	7.8	21,606
商船三井	118	7.8	29,211

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	118	7.8	23,306
空運業 (0.1%)			
A N Aホールディングス	118	7.8	34,647
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	118	39	120,120
情報・通信業 (11.4%)			
ヤフー	47.2	31.2	15,849
トレンドマイクロ	118	78	479,700
スカパー J S A Tホールディングス	11.8	7.8	4,056
日本電信電話	23.6	15.6	89,700
K D D I	708	468	1,470,456
N T T ドコモ	11.8	7.8	21,894
東宝	11.8	7.8	29,289
エヌ・ティ・ティ・データ	118	390	529,620
コナミホールディングス	118	78	484,380
ソフトバンクグループ	354	234	2,354,040
卸売業 (2.2%)			
双日	11.8	7.8	2,620
伊藤忠商事	118	78	157,404
丸紅	118	78	61,549
豊田通商	118	78	338,910
三井物産	118	78	135,876
住友商事	118	78	137,358
三菱商事	118	78	225,888
小売業 (9.4%)			
J . フロント リテイリング	59	39	68,406
三越伊勢丹ホールディングス	118	78	96,876
セブン&アイ・ホールディングス	118	78	362,622
ユニー・ファミリーマートホールディングス	118	78	522,600
高島屋	118	78	83,460
丸井グループ	118	78	138,216
イオン	118	78	137,748
ファーストリテイリング	118	78	3,112,980
銀行業 (0.9%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	118	78	46,488
新生銀行	118	7.8	14,203
あおぞら銀行	118	7.8	34,983
三菱UF J フィナンシャル・グループ	118	78	59,865
りそなホールディングス	11.8	7.8	4,814
三井住友トラスト・ホールディングス	11.8	7.8	34,897

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	11.8	7.8	35,451
千葉銀行	118	78	66,144
ふくおかフィナンシャルグループ	118	78	45,318
静岡銀行	118	78	85,566
みずほフィナンシャルグループ	118	78	16,091
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	118	78	56,877
野村ホールディングス	118	78	52,338
松井証券	118	78	77,844
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	29.5	19.5	89,836
MS&ADインシュアランスグループホール	35.4	23.4	89,809
ソニーフィナンシャルホールディングス	23.6	15.6	28,704
第一生命ホールディングス	11.8	7.8	16,875
東京海上ホールディングス	59	39	190,554
T&Dホールディングス	23.6	15.6	27,729
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	118	78	180,492

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 (1.7%)				
東急不動産ホールディングス	118	78	60,840	
三井不動産	118	78	214,500	
三菱地所	118	78	166,686	
東京建物	59	39	62,946	
住友不動産	118	78	302,640	
サービス業 (4.2%)				
ディー・エヌ・エー	35.4	23.4	61,074	
電通	118	78	382,200	
楽天	118	78	92,781	
リクルートホールディングス	—	234	641,862	
日本郵政	—	78	102,024	
東京ドーム	59	39	43,134	
セコム	118	78	697,866	
合 計	株 数 ・ 金 額	23,393	13,568	48,217,121
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 96.7% >

*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	1,632	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	48,217,121	94.2
コール・ローン等、その他	2,959,328	5.8
投資信託財産総額	51,176,449	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 (2017年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,176,449,672
コール・ローン等	2,531,995,782
株式(評価額)	48,217,121,940
未収入金	98,504,950
未取配当金	328,827,000
(B) 負債	1,305,260,747
未払金	1,225,774,000
未払解約金	77,953,880
未払利息	2,867
前受金	1,530,000
(C) 純資産総額(A-B)	49,871,188,925
元本	36,598,712,762
次期繰越損益金	13,272,476,163
(D) 受益権総口数	36,598,712,762口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,626円

(注) 期首元本額は54,217,735,144円、期中追加設定元本額は44,322,828,193円、期中一部解約元本額は61,941,850,575円、1口当たり純資産額は1,3626円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・野村インデックスファンド・日経225 16,909,433,434円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 16,212,097,351円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 1,389,479,129円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 1,382,845,288円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 567,929,930円
- ・野村FoFs用・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 134,790,356円
- ・野村つみたて日本株投信 1,274,308円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 862,966円

○損益の状況 (2016年11月8日～2017年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	847,159,355
受取配当金	847,993,908
受取利息	48
その他収益金	80,305
支払利息	△ 914,906
(B) 有価証券売買損益	15,035,546,036
売買益	15,550,727,130
売買損	△ 515,181,094
(C) 先物取引等取引損益	560,375,411
取引益	826,423,019
取引損	△ 266,047,608
(D) 保管費用等	△ 36,927
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	16,443,043,875
(F) 前期繰越損益金	95,858,024
(G) 追加信託差損益金	7,310,898,049
(H) 解約差損益金	△10,577,323,785
(I) 計(E+F+G+H)	13,272,476,163
次期繰越損益金(I)	13,272,476,163

* 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(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。

* 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

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>