

# 野村日経225インデックスファンド (確定拠出年金向け)

## 運用報告書(全体版)

第19期(決算日2023年11月7日)

作成対象期間(2022年11月8日~2023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。

|        |   |  |
|--------|---|--|
| 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5月30日以降、無期限とします。   |  |
| 運用方針   | ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、日経平均株価(日経225)にできる限り連動する投資成果をあげることによって、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標とします。なお、直接株式等に投資する場合があります。 |  |
| 主な投資対象 | 野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け)   | 親投資信託であるミリオン・インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。           |
|        | ミリオン・インデックスマザーファンド  | 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 | 野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け)   | 株式への実質投資割合には制限を設けません。                                |
|        | ミリオン・インデックスマザーファンド  | 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せん。              |  |

## 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             | 基準価額   |               |          | ベンチマーク            |          | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額   |
|-----------------|--------|---------------|----------|-------------------|----------|--------|--------|--------|
|                 | (分配落)  | 税込<br>分配<br>金 | 期騰<br>落率 | 日経平均株価<br>(日経225) | 期騰<br>落率 |        |        |        |
|                 | 円      | 円             | %        | 円                 | %        | %      | %      | 百万円    |
| 15期(2019年11月7日) | 25,740 | 5             | 7.7      | 23,330            | 5.6      | 97.2   | 2.8    | 4,236  |
| 16期(2020年11月9日) | 27,873 | 5             | 8.3      | 24,840            | 6.5      | 97.4   | 2.5    | 5,694  |
| 17期(2021年11月8日) | 33,491 | 5             | 20.2     | 29,507            | 18.8     | 97.8   | 2.1    | 7,920  |
| 18期(2022年11月7日) | 31,804 | 5             | △ 5.0    | 27,528            | △ 6.7    | 97.1   | 2.9    | 9,733  |
| 19期(2023年11月7日) | 37,989 | 5             | 19.5     | 32,272            | 17.2     | 97.8   | 2.2    | 13,307 |

\*基準価額の騰落率は分配金込み。

\*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。

## ○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         | 日経平均株価<br>(日経225) | 騰落率         | 騰落率       |           |          |
| (期首)<br>2022年11月7日 | 円<br>31,804 | %<br>-            | 円<br>27,528 | %<br>-    | %<br>97.1 | %<br>2.9 |
| 11月末               | 32,316      | 1.6               | 27,969      | 1.6       | 96.3      | 3.6      |
| 12月末               | 30,192      | △ 5.1             | 26,095      | △ 5.2     | 96.1      | 3.9      |
| 2023年1月末           | 31,607      | △ 0.6             | 27,327      | △ 0.7     | 98.5      | 1.5      |
| 2月末                | 31,755      | △ 0.2             | 27,446      | △ 0.3     | 97.0      | 3.0      |
| 3月末                | 32,741      | 2.9               | 28,041      | 1.9       | 98.1      | 1.8      |
| 4月末                | 33,688      | 5.9               | 28,856      | 4.8       | 97.8      | 2.1      |
| 5月末                | 36,065      | 13.4              | 30,888      | 12.2      | 98.0      | 1.9      |
| 6月末                | 38,791      | 22.0              | 33,189      | 20.6      | 97.6      | 2.4      |
| 7月末                | 38,771      | 21.9              | 33,172      | 20.5      | 97.2      | 2.8      |
| 8月末                | 38,148      | 19.9              | 32,619      | 18.5      | 98.4      | 1.5      |
| 9月末                | 37,514      | 18.0              | 31,858      | 15.7      | 96.2      | 3.7      |
| 10月末               | 36,332      | 14.2              | 30,859      | 12.1      | 96.0      | 3.9      |
| (期末)<br>2023年11月7日 | 円<br>37,994 | %<br>19.5         | 円<br>32,272 | %<br>17.2 | %<br>97.8 | %<br>2.2 |

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

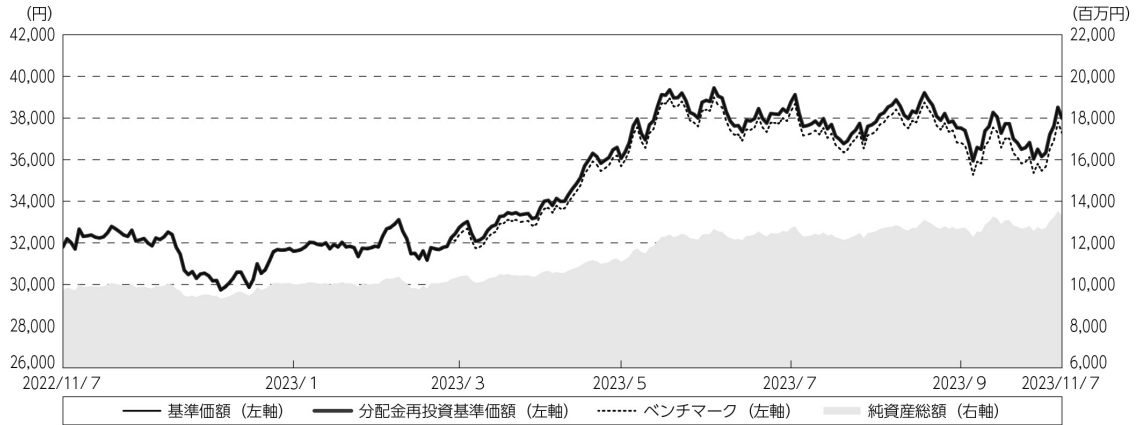
\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- 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「野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）」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「野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）」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



期 首：31,804円

期 末：37,989円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：19.5%（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（2022年11月7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（2022年11月7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、期首より、中国において新型コロナウイルス新規感染者数が過去最多を更新し、同国における行動制限を通じた企業活動への悪影響が懸念されたことなどから下落しました。2023年1月中旬以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ停止の可能性が高まったとの見方から米ハイテク株が上昇したことなどから、国内株式市場も堅調に推移しました。

3月以降は、東証（東京証券取引所）による低PBR（株価純資産倍率）企業への改善策開示などを求める方針を受けて日本企業の資本効率の底上げへの期待が高まったこと、政府による新型コロナウイルスの感染症法上の分類見直しを受けて国内経済の回復期待が高まったことや米連邦政府の債務上限引き上げ法案の成立が好感されたことなどから上昇しました。

6月中旬以降は、米ドル円の動きや米国の追加利上げの行方を巡り、一進一退となりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）]

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、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（日経225）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+19.5%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+17.2%を2.3ポイント上回りました。

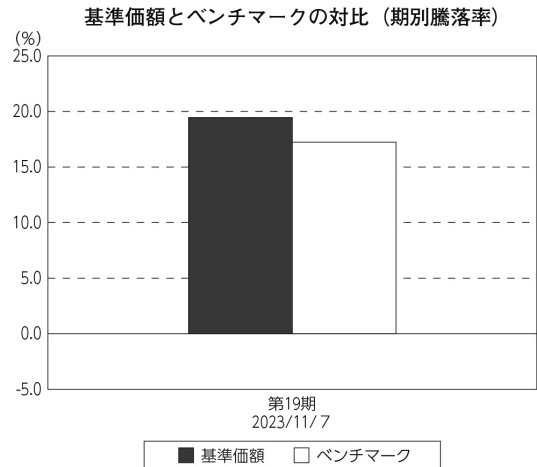
主な差異要因は以下の通りです。

### （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



(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、基準価額水準などを勘案して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ないます。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目       | 第19期                      |
|-----------|---------------------------|
|           | 2022年11月8日～<br>2023年11月7日 |
| 当期分配金     | 5                         |
| （対基準価額比率） | 0.013%                    |
| 当期の収益     | 5                         |
| 当期の収益以外   | —                         |
| 翌期繰越分配対象額 | 30,678                    |

(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

### [野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）]

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み入れ、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

(2022年11月8日～2023年11月7日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要  |
|-----------------------|---------|------------|--|
|                       | 金 額     | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>54 | %<br>0.154 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率   |
| （ 投 信 会 社 ）           | (23)    | (0.066)    | 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 ）           | (23)    | (0.066)    | 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 ）           | ( 8 )   | (0.022)    | 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     | 1       | 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<br>※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 ）   | ( 1 )   | (0.003)    |  |
| (c) そ の 他 費 用         | 1       | 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 ）           | ( 1 )   | (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                   | 56      | 0.160      |  |
| 期中の平均基準価額は、34,826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。

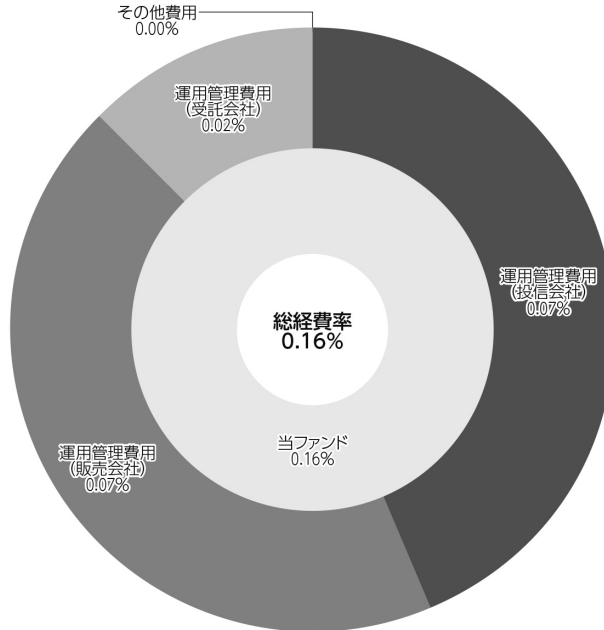
\* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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。

（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0.16%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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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

(2022年11月8日～2023年11月7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 | 1,352,930<br>千口 | 2,729,240<br>千円 | 587,355<br>千口 | 1,141,839<br>千円 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2022年11月8日～2023年11月7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       | 83,153,228千円       |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 111,155,737千円      |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.74               |

\* (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

(2022年11月8日～2023年11月7日)

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;ミリオン・インデックスマザーファンド&gt;

| 種類 | 買付額       | 売付額       | 当期末保有額    |
|----|-----------|-----------|-----------|
| 株式 | 百万円<br>24 | 百万円<br>24 | 百万円<br>78 |

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

(2023年11月7日現在)

## 親投資信託残高

| 銘 柄                | 期首(前期末)         | 当 期 末           |                  |
|--------------------|-----------------|-----------------|------------------|
|                    | 口 数             | 口 数             | 評 価 額            |
| ミリオン・インデックスマザーファンド | 千口<br>5,404,339 | 千口<br>6,169,915 | 千円<br>13,306,038 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2023年11月7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<br>13,306,038 | %<br>99.2 |
| コール・ローン等、その他       | 112,332          | 0.8       |
| 投資信託財産総額           | 13,418,370       | 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（2023年11月7日現在）

| 項 目                         | 当 期 末          |
|-----------------------------|----------------|
|                             | 円              |
| (A) 資産                      | 13,418,370,887 |
| コール・ローン等                    | 59,312,805     |
| ミリオン・インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 13,306,038,865 |
| 未収入金                        | 53,019,217     |
| (B) 負債                      | 110,984,337    |
| 未払収益分配金                     | 1,751,491      |
| 未払解約金                       | 96,278,132     |
| 未払信託報酬                      | 12,751,275     |
| 未払利息                        | 24             |
| その他未払費用                     | 203,415        |
| (C) 純資産総額(A-B)              | 13,307,386,550 |
| 元本                          | 3,502,983,093  |
| 次期繰越損益金                     | 9,804,403,457  |
| (D) 受益権総口数                  | 3,502,983,093口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)             | 37,989円        |

(注) 期首元本額は3,060,356,853円、期中追加設定元本額は1,510,222,252円、期中一部解約元本額は1,067,596,012円、1口当たり純資産額は3,7989円です。

## ○損益の状況（2022年11月8日～2023年11月7日）

| 項 目                      | 当 期                               |
|--------------------------|-----------------------------------|
|                          | 円                                 |
| (A) 配当等収益                | △ 11,065                          |
| 受取利息                     | 17                                |
| 支払利息                     | △ 11,082                          |
| (B) 有価証券売買損益             | 1,670,645,459                     |
| 売買益                      | 1,995,477,978                     |
| 売買損                      | △ 324,832,519                     |
| (C) 信託報酬等                | △ 26,836,353                      |
| (D) 当期繰越損益金(A+B+C)       | 1,643,798,041                     |
| (E) 前期繰越損益金              | 652,207,070                       |
| (F) 追加信託差損益金<br>(配当等相当額) | 7,510,149,837<br>( 8,442,716,309) |
| (売買損益相当額)                | (△ 932,566,472)                   |
| (G) 計(D+E+F)             | 9,806,154,948                     |
| (H) 収益分配金                | △ 1,751,491                       |
| 次期繰越損益金(G+H)             | 9,804,403,457                     |
| 追加信託差損益金<br>(配当等相当額)     | 7,510,149,837<br>( 8,452,258,397) |
| (売買損益相当額)                | (△ 942,108,560)                   |
| 分配準備積立金                  | 2,294,253,620                     |

\*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（2022年11月8日～2023年11月7日）は以下の通りです。

| 項 目                          | 当 期                       |
|------------------------------|---------------------------|
|                              | 2022年11月8日～<br>2023年11月7日 |
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 226,152,813円              |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 1,112,987,304円            |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 8,452,258,397円            |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 956,864,994円              |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)           | 10,748,263,508円           |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 30,683円                   |
| g. 分配金                       | 1,751,491円                |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 5円                        |

## ○分配金のお知らせ

---

|                 |    |
|-----------------|----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|-----------------|----|

## ○お知らせ

---

信託報酬率について、年0.275%（税抜年0.25%）から年0.154%（税抜年0.14%）へ引き下げる所要の約款変更を行ないました。  
<変更適用日：2023年7月31日>

# ミリオン・インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第36期（決算日2023年11月7日）

作成対象期間（2022年11月8日～2023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せん。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せん。資金の流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せん。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**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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     |
| 32期(2019年11月7日) | 14,446 | 8.0  | 23,330 | 5.6  | 97.2  | 2.8   | 67,958  |
| 33期(2020年11月9日) | 15,690 | 8.6  | 24,840 | 6.5  | 97.5  | 2.5   | 73,512  |
| 34期(2021年11月8日) | 18,908 | 20.5 | 29,507 | 18.8 | 97.9  | 2.1   | 97,537  |
| 35期(2022年11月7日) | 18,008 | △4.8 | 27,528 | △6.7 | 97.1  | 2.9   | 106,015 |
| 36期(2023年11月7日) | 21,566 | 19.8 | 32,272 | 17.2 | 97.8  | 2.2   | 126,882 |

\* 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)       | 円      | %    | 円      | %    | %     | %     |
| 2022年11月7日 | 18,008 | —    | 27,528 | —    | 97.1  | 2.9   |
| 11月末       | 18,301 | 1.6  | 27,969 | 1.6  | 96.3  | 3.6   |
| 12月末       | 17,102 | △5.0 | 26,095 | △5.2 | 96.1  | 3.9   |
| 2023年1月末   | 17,908 | △0.6 | 27,327 | △0.7 | 98.5  | 1.5   |
| 2月末        | 17,996 | △0.1 | 27,446 | △0.3 | 97.0  | 3.0   |
| 3月末        | 18,559 | 3.1  | 28,041 | 1.9  | 98.2  | 1.8   |
| 4月末        | 19,100 | 6.1  | 28,856 | 4.8  | 97.8  | 2.1   |
| 5月末        | 20,453 | 13.6 | 30,888 | 12.2 | 98.0  | 1.9   |
| 6月末        | 22,004 | 22.2 | 33,189 | 20.6 | 97.6  | 2.4   |
| 7月末        | 21,998 | 22.2 | 33,172 | 20.5 | 97.2  | 2.8   |
| 8月末        | 21,647 | 20.2 | 32,619 | 18.5 | 98.4  | 1.5   |
| 9月末        | 21,290 | 18.2 | 31,858 | 15.7 | 96.3  | 3.7   |
| 10月末       | 20,622 | 14.5 | 30,859 | 12.1 | 96.0  | 3.9   |
| (期末)       |        |      |        |      |       |       |
| 2023年11月7日 | 21,566 | 19.8 | 32,272 | 17.2 | 97.8  | 2.2   |

\* 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

国内株式の株価の変動

### ○投資環境

国内株式市場は、期首より、中国において新型コロナウイルス新規感染者数が過去最多を更新し、同国における行動制限を通じた企業活動への悪影響が懸念されたことなどから下落しました。2023年1月中旬以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ停止の可能性が高まったとの見方から米ハイテク株が上昇したことなどから、国内株式市場も堅調に推移しました。

3月以降は、東証（東京証券取引所）による低PBR（株価純資産倍率）企業への改善策開示などを求める方針を受けて日本企業の資本効率の底上げへの期待が高まったこと、政府による新型コロナウイルスの感染症法上の分類見直しを受けて国内経済の回復期待が高まったことや米連邦政府の債務上限引き上げ法案の成立が好感されたことなどから上昇しました。

6月中旬以降は、米ドル円の動きや米国の追加利上げの行方を巡り、一進一退となりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

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、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（日経225）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。

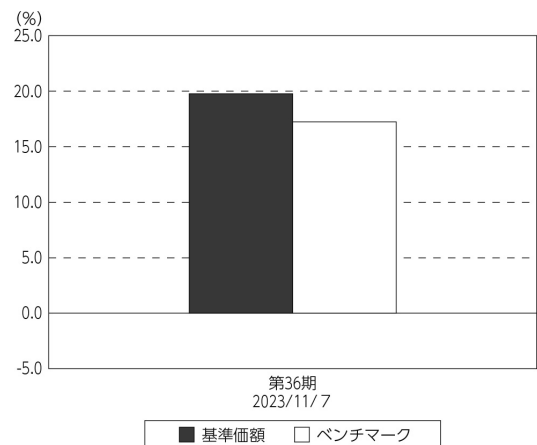
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+19.8%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+17.2%を2.6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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（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（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

(2022年11月8日～2023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     | 円<br>1 | %<br>0.003 | (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<br>※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)            | (1)    | (0.003)    |  |
| 合 計                   | 1      | 0.003      |  |
| 期中の平均基準価額は、19,748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

(2022年11月8日～2023年11月7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 |    | 10,070  | 43,056,720 | 9,561 | 40,096,507 |
|   |    | (4,893) | ( )        |       |            |

\*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     |        | 110,407 | 111,199 | —     | —     |

\*単位未満は切り捨て。

(2022年11月8日～2023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       | 83,153,228千円  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 111,155,737千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.74          |

\* (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

(2022年11月8日～2023年11月7日)

## 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<br>24 | 百万円<br>24 | 百万円<br>78   |

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。

(2023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 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |           |
| ニッスイ                 | 128     | 128   | 88,921    |
| <b>鉱業 (0.1%)</b>     |         |       |           |
| I N P E X            | 51.2    | 51.2  | 109,030   |
| <b>建設業 (1.8%)</b>    |         |       |           |
| コムシスホールディングス         | 128     | 128   | 388,864   |
| 大成建設                 | 25.6    | 25.6  | 133,043   |
| 大林組                  | 128     | 128   | 165,120   |
| 清水建設                 | 128     | 128   | 127,680   |
| 長谷工コーポレーション          | 25.6    | 25.6  | 47,065    |
| 鹿島建設                 | 64      | 64    | 159,872   |
| 大和ハウス工業              | 128     | 128   | 537,984   |
| 積水ハウス                | 128     | 128   | 381,120   |
| 日揮ホールディングス           | 128     | 128   | 236,544   |
| <b>食料品 (3.7%)</b>    |         |       |           |
| 日清製粉グループ本社           | 128     | 128   | 281,472   |
| 明治ホールディングス           | 25.6    | 51.2  | 188,313   |
| 日本ハム                 | 64      | 64    | 277,056   |
| サッポロホールディングス         | 25.6    | 25.6  | 138,675   |
| アサヒグループホールディングス      | 128     | 128   | 718,208   |
| キリンホールディングス          | 128     | 128   | 279,616   |
| 宝ホールディングス            | 128     | 128   | 161,280   |
| キッコーマン               | 128     | 128   | 1,220,992 |
| 味の素                  | 128     | 128   | 687,488   |
| ニチレイ                 | 64      | 64    | 205,504   |
| 日本たばこ産業              | 128     | 128   | 470,400   |
| <b>繊維製品 (0.1%)</b>   |         |       |           |
| 東洋紡                  | 12.8    | —     | —         |
| 帝人                   | 25.6    | 25.6  | 34,137    |
| 東レ                   | 128     | 128   | 98,841    |
| <b>パルプ・紙 (0.1%)</b>  |         |       |           |
| 王子ホールディングス           | 128     | 128   | 78,118    |
| 日本製紙                 | 12.8    | 12.8  | 16,128    |
| <b>化学 (6.8%)</b>     |         |       |           |
| クラレ                  | 128     | 128   | 213,888   |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|------------------------|---------|-------|-----------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                        | 千株      | 千株    | 千円        |
| 旭化成                    | 128     | 128   | 127,308   |
| レゾナック・ホールディングス         | 12.8    | 12.8  | 31,788    |
| 住友化学                   | 128     | 128   | 49,945    |
| 日産化学                   | 128     | 128   | 804,224   |
| 東ソー                    | 64      | 64    | 123,488   |
| トクヤマ                   | 25.6    | 25.6  | 58,905    |
| デンカ                    | 25.6    | 25.6  | 69,875    |
| 信越化学工業                 | 128     | 640   | 3,104,640 |
| 三井化学                   | 25.6    | 25.6  | 99,865    |
| 三菱ケミカルグループ             | 64      | 64    | 61,702    |
| UBE                    | 12.8    | 12.8  | 30,054    |
| 花王                     | 128     | 128   | 695,680   |
| D I C                  | 12.8    | 12.8  | 30,636    |
| 富士フイルムホールディングス         | 128     | 128   | 1,088,512 |
| 資生堂                    | 128     | 128   | 620,416   |
| 日東電工                   | 128     | 128   | 1,284,480 |
| <b>医薬品 (6.4%)</b>      |         |       |           |
| 協和キリン                  | 128     | 128   | 312,640   |
| 武田薬品工業                 | 128     | 128   | 531,712   |
| アステラス製薬                | 640     | 640   | 1,141,120 |
| 住友ファーマ                 | 128     | 128   | 55,680    |
| 塩野義製薬                  | 128     | 128   | 904,960   |
| 中外製薬                   | 384     | 384   | 1,786,368 |
| エーザイ                   | 128     | 128   | 991,872   |
| 第一三共                   | 384     | 384   | 1,549,056 |
| 大塚ホールディングス             | 128     | 128   | 680,320   |
| <b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>  |         |       |           |
| 出光興産                   | 51.2    | 51.2  | 173,977   |
| E N E O Sホールディングス      | 128     | 128   | 72,460    |
| <b>ゴム製品 (0.8%)</b>     |         |       |           |
| 横浜ゴム                   | 64      | 64    | 184,160   |
| ブリヂストン                 | 128     | 128   | 750,336   |
| <b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b> |         |       |           |
| A G C                  | 25.6    | 25.6  | 132,838   |
| 日本板硝子                  | 12.8    | —     | —         |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| 日本電気硝子             | 38.4    | 38.4  | 116,467   |
| 住友大阪セメント           | 12.8    | 12.8  | 47,462    |
| 太平洋セメント            | 12.8    | 12.8  | 33,689    |
| 東海カーボン             | 128     | 128   | 150,144   |
| TOTO               | 64      | 64    | 245,120   |
| 日本碍子               | 128     | 128   | 243,328   |
| <b>鉄鋼 (0.1%)</b>   |         |       |           |
| 日本製鉄               | 12.8    | 12.8  | 42,048    |
| 神戸製鋼所              | 12.8    | 12.8  | 23,526    |
| JFEホールディングス        | 12.8    | 12.8  | 27,180    |
| 大太平洋金属             | 12.8    | 12.8  | 17,292    |
| <b>非鉄金属 (0.7%)</b> |         |       |           |
| 日本軽金属ホールディングス      | 12.8    | —     | —         |
| 三井金属鉱業             | 12.8    | 12.8  | 49,932    |
| 東邦亜鉛               | 12.8    | —     | —         |
| 三菱マテリアル            | 12.8    | 12.8  | 31,462    |
| 住友金属鉱山             | 64      | 64    | 277,568   |
| DOWAホールディングス       | 25.6    | 25.6  | 125,312   |
| 古河電気工業             | 12.8    | 12.8  | 29,939    |
| 住友電気工業             | 128     | 128   | 233,472   |
| フジクラ               | 128     | 128   | 149,184   |
| <b>金属製品 (0.0%)</b> |         |       |           |
| SUMCO              | 12.8    | 12.8  | 26,150    |
| <b>機械 (5.0%)</b>   |         |       |           |
| 日本製鋼所              | 25.6    | 25.6  | 63,296    |
| オークマ               | 25.6    | 25.6  | 157,670   |
| アマダ                | 128     | 128   | 190,144   |
| SMC                | 12.8    | 12.8  | 971,392   |
| 小松製作所              | 128     | 128   | 460,672   |
| 住友重機械工業            | 25.6    | 25.6  | 89,420    |
| 日立建機               | 128     | 128   | 503,936   |
| クボタ                | 128     | 128   | 267,904   |
| 荏原製作所              | 25.6    | 25.6  | 179,635   |
| ダイキン工業             | 128     | 128   | 2,901,120 |
| 日本精工               | 128     | 128   | 103,116   |
| NTN                | 128     | 128   | 37,132    |
| ジェイテクト             | 128     | 128   | 164,608   |
| 三井E&S              | 12.8    | —     | —         |
| 日立造船               | 25.6    | 25.6  | 21,964    |
| 三菱重工業              | 12.8    | 12.8  | 106,470   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| I H I               | 12.8    | 12.8  | 38,329    |
| <b>電気機器 (25.0%)</b> |         |       |           |
| コニカミノルタ             | 128     | 128   | 58,867    |
| ミネベアミツミ             | 128     | 128   | 338,816   |
| 日立製作所               | 25.6    | 25.6  | 245,990   |
| 三菱電機                | 128     | 128   | 242,176   |
| 富士電機                | 25.6    | 25.6  | 156,825   |
| 安川電機                | 128     | 128   | 687,360   |
| ニデック                | 102.4   | 102.4 | 585,523   |
| オムロン                | 128     | 128   | 739,840   |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション   | 25.6    | 25.6  | 63,910    |
| 日本電気                | 12.8    | 12.8  | 93,273    |
| 富士通                 | 12.8    | 12.8  | 247,488   |
| ルネサスエレクトロニクス        | —       | 128   | 287,808   |
| セイコーエプソン            | 256     | 256   | 545,792   |
| パナソニック ホールディングス     | 128     | 128   | 178,624   |
| シャープ                | 128     | 128   | 127,641   |
| ソニーグループ             | 128     | 128   | 1,683,840 |
| TDK                 | 384     | 384   | 2,284,032 |
| アルプスアルパイン           | 128     | 128   | 155,648   |
| 横河電機                | 128     | 128   | 354,496   |
| アドバンテスト             | 256     | 1,024 | 4,293,632 |
| キーエンス               | 12.8    | 12.8  | 774,400   |
| レーザーテック             | —       | 51.2  | 1,412,096 |
| カシオ計算機              | 128     | 128   | 155,456   |
| ファナック               | 128     | 640   | 2,521,600 |
| 京セラ                 | 256     | 256   | 2,004,992 |
| 太陽誘電                | 128     | 128   | 472,960   |
| 村田製作所               | 102.4   | 307.2 | 876,288   |
| SCREENホールディングス      | 25.6    | 51.2  | 435,302   |
| キャノン                | 192     | 192   | 703,680   |
| リコー                 | 128     | 128   | 159,936   |
| 東京エレクトロン            | 128     | 384   | 8,146,560 |
| <b>輸送用機器 (5.0%)</b> |         |       |           |
| デンソー                | 128     | 512   | 1,197,568 |
| 川崎重工業               | 12.8    | 12.8  | 44,006    |
| 日産自動車               | 128     | 128   | 78,246    |
| いすゞ自動車              | 64      | 64    | 110,560   |
| トヨタ自動車              | 640     | 640   | 1,812,480 |
| 日野自動車               | 128     | 128   | 60,979    |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| 三菱自動車工業              | 12.8    | 12.8  | 6,329     |
| マツダ                  | 25.6    | 25.6  | 38,566    |
| 本田技研工業               | 256     | 768   | 1,239,552 |
| スズキ                  | 128     | 128   | 770,688   |
| SUBARU               | 128     | 128   | 349,760   |
| ヤマハ発動機               | 128     | 128   | 494,592   |
| <b>精密機器 (3.6%)</b>   |         |       |           |
| テルモ                  | 512     | 512   | 2,142,720 |
| ニコン                  | 128     | 128   | 192,640   |
| オリンパス                | 512     | 512   | 1,056,000 |
| HOYA                 | 64      | 64    | 980,160   |
| シチズン時計               | 128     | 128   | 114,560   |
| <b>その他製品 (2.4%)</b>  |         |       |           |
| バンダイナムコホールディングス      | 128     | 384   | 1,238,016 |
| TOPPANホールディングス       | 64      | 64    | 216,384   |
| 大日本印刷                | 64      | 64    | 255,040   |
| ヤマハ                  | 128     | 128   | 465,792   |
| 任天堂                  | 128     | 128   | 817,280   |
| <b>電気・ガス業 (0.2%)</b> |         |       |           |
| 東京電力ホールディングス         | 12.8    | 12.8  | 8,495     |
| 中部電力                 | 12.8    | 12.8  | 23,411    |
| 関西電力                 | 12.8    | 12.8  | 24,460    |
| 東京瓦斯                 | 25.6    | 25.6  | 87,296    |
| 大阪瓦斯                 | 25.6    | 25.6  | 72,435    |
| <b>陸運業 (1.3%)</b>    |         |       |           |
| 東武鉄道                 | 25.6    | 25.6  | 98,073    |
| 東急                   | 64      | 64    | 108,736   |
| 小田急電鉄                | 64      | 64    | 143,264   |
| 京王電鉄                 | 25.6    | 25.6  | 112,153   |
| 京成電鉄                 | 64      | 64    | 397,952   |
| 東日本旅客鉄道              | 12.8    | 12.8  | 100,940   |
| 西日本旅客鉄道              | 12.8    | 12.8  | 75,225    |
| 東海旅客鉄道               | 12.8    | 64    | 217,728   |
| ヤマトホールディングス          | 128     | 128   | 321,472   |
| NIPPON EXPRESSホールディン | 12.8    | 12.8  | 96,460    |
| <b>海運業 (0.4%)</b>    |         |       |           |
| 日本郵船                 | 38.4    | 38.4  | 135,552   |
| 商船三井                 | 38.4    | 38.4  | 146,649   |
| 川崎汽船                 | 38.4    | 38.4  | 177,292   |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |            |
|------------------------|---------|-------|------------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額      |
|                        | 千株      | 千株    | 千円         |
| <b>空運業 (0.3%)</b>      |         |       |            |
| 日本航空                   | —       | 128   | 351,744    |
| ANAホールディングス            | 12.8    | 12.8  | 38,182     |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |            |
| 三菱倉庫                   | 64      | 64    | 271,360    |
| <b>情報・通信業 (10.5%)</b>  |         |       |            |
| ネクソン                   | 256     | 256   | 735,360    |
| メルカリ                   | —       | 128   | 414,592    |
| LINEヤフー                | 51.2    | 51.2  | 20,899     |
| トレンドマイクロ               | 128     | 128   | 744,192    |
| 日本電信電話                 | 51.2    | 1,280 | 223,872    |
| KDDI                   | 768     | 768   | 3,521,280  |
| ソフトバンク                 | 128     | 128   | 216,704    |
| 東宝                     | 12.8    | 12.8  | 66,803     |
| NTTデータグループ             | 640     | 640   | 1,141,120  |
| コナミグループ                | 128     | 128   | 1,001,984  |
| ソフトバンクグループ             | 768     | 768   | 4,935,936  |
| <b>卸売業 (3.4%)</b>      |         |       |            |
| 双日                     | 12.8    | 12.8  | 40,358     |
| 伊藤忠商事                  | 128     | 128   | 742,272    |
| 丸紅                     | 128     | 128   | 296,512    |
| 豊田通商                   | 128     | 128   | 1,127,168  |
| 三井物産                   | 128     | 128   | 726,016    |
| 住友商事                   | 128     | 128   | 410,496    |
| 三菱商事                   | 128     | 128   | 891,776    |
| <b>小売業 (12.7%)</b>     |         |       |            |
| J. フロント リテイリング         | 64      | 64    | 91,392     |
| 三越伊勢丹ホールディングス          | 128     | 128   | 213,888    |
| セブン&アイ・ホールディングス        | 128     | 128   | 719,360    |
| 高島屋                    | 64      | 64    | 129,216    |
| 丸井グループ                 | 128     | 128   | 306,944    |
| イオン                    | 128     | 128   | 406,400    |
| ニトリホールディングス            | —       | 38.4  | 623,232    |
| ファーストリテイリング            | 128     | 384   | 13,209,600 |
| <b>銀行業 (0.7%)</b>      |         |       |            |
| しずおかフィナンシャルグループ        | 128     | 128   | 159,872    |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ    | 128     | 128   | 88,000     |
| あおぞら銀行                 | 12.8    | 12.8  | 38,412     |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ      | 128     | 128   | 161,280    |
| りそなホールディングス            | 12.8    | 12.8  | 10,151     |

| 銘柄                       | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------------|---------|-------|---------|
|                          | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                          | 千株      | 千株    | 千円      |
| 三井住友トラスト・ホールディングス        | 12.8    | 12.8  | 71,411  |
| 三井住友フィナンシャルグループ          | 12.8    | 12.8  | 93,286  |
| 千葉銀行                     | 128     | 128   | 140,224 |
| ふくおかフィナンシャルグループ          | 25.6    | 25.6  | 99,353  |
| みずほフィナンシャルグループ           | 12.8    | 12.8  | 32,294  |
| <b>証券、商品先物取引業 (0.2%)</b> |         |       |         |
| 大和証券グループ本社               | 128     | 128   | 120,844 |
| 野村ホールディングス               | 128     | 128   | 78,310  |
| 松井証券                     | 128     | —     | —       |
| <b>保険業 (0.9%)</b>        |         |       |         |
| SOMPOホールディングス            | 25.6    | 25.6  | 167,091 |
| MS&ADインシュアランスグループホール     | 38.4    | 38.4  | 214,425 |
| 第一生命ホールディングス             | 12.8    | 12.8  | 40,179  |
| 東京海上ホールディングス             | 192     | 192   | 655,488 |
| T&Dホールディングス              | 25.6    | 25.6  | 67,264  |
| <b>その他金融業 (0.8%)</b>     |         |       |         |
| クレディセゾン                  | 128     | 128   | 294,592 |
| オリックス                    | 128     | 128   | 337,664 |
| 日本取引所グループ                | 128     | 128   | 396,160 |

| 銘柄                  | 期首(前期末)    | 当 期 末  |           |             |
|---------------------|------------|--------|-----------|-------------|
|                     | 株 数        | 株 数    | 評 価 額     |             |
|                     | 千株         | 千株     | 千円        |             |
| <b>不動産業 (1.2%)</b>  |            |        |           |             |
| 東急不動産ホールディングス       | 128        | 128    | 116,876   |             |
| 三井不動産               | 128        | 128    | 433,024   |             |
| 三菱地所                | 128        | 128    | 251,712   |             |
| 東京建物                | 64         | 64     | 130,048   |             |
| 住友不動産               | 128        | 128    | 499,456   |             |
| <b>サービス業 (4.5%)</b> |            |        |           |             |
| エムスリー               | 307.2      | 307.2  | 757,401   |             |
| ディー・エヌ・エー           | 38.4       | 38.4   | 58,022    |             |
| 電通グループ              | 128        | 128    | 573,312   |             |
| オリエンタルランド           | —          | 128    | 652,800   |             |
| サイバーエージェント          | 102.4      | 102.4  | 85,463    |             |
| 楽天グループ              | 128        | 128    | 72,076    |             |
| リクルートホールディングス       | 384        | 384    | 1,860,864 |             |
| 日本郵政                | 128        | 128    | 169,472   |             |
| セコム                 | 128        | 128    | 1,314,560 |             |
| 合 計                 | 株 数 ・ 金 額  | 24,499 | 29,900    | 124,044,907 |
|                     | 銘柄数 < 比率 > | 225    | 225       | < 97.8% >   |

\*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<br>内 | 株式先物取引 | 日経225 | 百万円<br>2,807 | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

### ○投資信託財産の構成

(2023年11月7日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>124,044,907 | %<br>94.2 |
| コール・ローン等、その他 | 7,627,613         | 5.8       |
| 投資信託財産総額     | 131,672,520       | 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 (2023年11月7日現在)

○損益の状況 (2022年11月8日～2023年11月7日)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 131,672,520,328 |
| コール・ローン等        | 1,635,590,148   |
| 株式(評価額)         | 124,044,907,520 |
| 未収入金            | 4,965,025,783   |
| 未収配当金           | 909,722,500     |
| 差入委託証拠金         | 117,274,377     |
| (B) 負債          | 4,790,388,665   |
| 未払金             | 15,717,975      |
| 未払解約金           | 4,774,670,021   |
| 未払利息            | 669             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 126,882,131,663 |
| 元本              | 58,833,499,483  |
| 次期繰越損益金         | 68,048,632,180  |
| (D) 受益権総口数      | 58,833,499,483口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,566円         |

| 項 目              | 当 期             |
|------------------|-----------------|
|                  | 円               |
| (A) 配当等収益        | 2,349,989,808   |
| 受取配当金            | 2,351,185,684   |
| 受取利息             | 663             |
| その他収益金           | 96,322          |
| 支払利息             | △ 1,292,861     |
| (B) 有価証券売買損益     | 18,186,646,369  |
| 売買益              | 21,909,799,837  |
| 売買損              | △ 3,723,153,468 |
| (C) 先物取引等取引損益    | 486,718,221     |
| 取引益              | 1,404,100,902   |
| 取引損              | △ 917,382,681   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 21,023,354,398  |
| (E) 前期繰越損益金      | 47,145,017,199  |
| (F) 追加信託差損益金     | 32,484,043,968  |
| (G) 解約差損益金       | △32,603,783,385 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 68,048,632,180  |
| 次期繰越損益金(H)       | 68,048,632,180  |

(注) 期首元本額は58,870,561,339円、期中追加設定元本額は33,075,698,090円、期中一部解約元本額は33,112,759,946円、1口当たり純資産額は2,1566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 32,735,625,693円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 9,924,570,267円
- ・野村つみたて日本株投信 7,534,814,647円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 6,169,915,082円
- ・野村日経225インデックス(野村SMA・EW向け) 1,528,021,928円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 530,063,217円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 317,312,719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) 56,807,049円
- ・はじめてのNISA・日本株式インデックス(日経225) 36,368,881円

\*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(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。

\*損益の状況の中で(G)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

該当事項はございません。