

関東・甲信インデックス ファンド

(愛称:八県物語)

償還運用報告書(全体版)

第10期 (償還日2016年9月21日)

作成対象期間 (2015年9月25日～2016年9月21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。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

●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	2006年9月22日から2016年9月21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「関東・甲信インデックス (除く東京都)」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、東京都を除く関東・甲信8県 (茨城県、栃木県、群馬県、埼玉県、千葉県、神奈川県、山梨県、長野県) 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	基準価額 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 産額
		税金 分配	み 金 騰 落	期 騰 落 率	関東・甲信インデックス (除く東京都)	期 騰 落 率			
6期(2012年9月21日)	円 銭 5,570	円	50	% 3.7	関東・甲信インデックス (除く東京都)	% 2.6	% 97.8	% —	百万円 1,431
7期(2013年9月24日)	8,337	80	51.1	104.46	50.8	97.9	—	1,800	
8期(2014年9月22日)	9,317	90	12.8	117.29	12.3	97.9	—	1,707	
9期(2015年9月24日)	9,805	95	6.3	123.57	5.3	97.9	—	1,200	
(償還時) 10期(2016年9月21日)	(償還価額) 9,113.78	—	△ 7.0	116.86	△ 5.4	—	—	970	

*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	基準価額		株式 組入比率	株式 先物比率
		騰落率	関東・甲信インデックス (除く東京都)		
(期首) 2015年9月24日	円 銭 9,805	% —	123.57	% 97.9	% —
9月末	9,816	0.1	122.77	△ 0.6	96.5
10月末	10,792	10.1	135.50	9.7	97.9
11月末	11,081	13.0	139.24	12.7	97.2
12月末	10,838	10.5	136.11	10.2	97.6
2016年1月末	9,994	1.9	125.37	1.5	97.8
2月末	9,199	△ 6.2	115.11	△ 6.8	97.2
3月末	9,644	△ 1.6	119.84	△ 3.0	97.1
4月末	9,517	△ 2.9	118.36	△ 4.2	97.0
5月末	9,802	△ 0.0	122.03	△ 1.2	97.9
6月末	8,860	△ 9.6	110.23	△ 10.8	88.7
7月末	9,229	△ 5.9	115.35	△ 6.7	90.6
8月末	9,148	△ 6.7	114.36	△ 7.4	85.0
(償還時) 2016年9月21日	(償還価額) 9,113.78	△ 7.0	116.86	△ 5.4	—

*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。

※「関東・甲信インデックス (除く東京都)」は、東京都を除く関東・甲信8県(茨城県、栃木県、群馬県、埼玉県、千葉県、神奈川県、山梨県、長野県)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



期 首： 9,805円

期末(償還日)：9,113円78銭(既払分配金(税込み)：-円)

騰 落 率： △7.0%(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(2015年9月24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、関東・甲信インデックス(除く東京都)です。ベンチマークは、作成期首(2015年9月24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9,805円から期末9,113.78円に691.22円の値下がりになりました。

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

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、株式市場は上昇しました。

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

関東・甲信インデックス（除く東京都）の動きに連動した投資成果を目指すため、関東・甲信インデックス（除く東京都）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-7.0%となり、ベンチマークである関東・甲信インデックス（除く東京都）の-5.4%を1.6%ポイント下回りました。

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

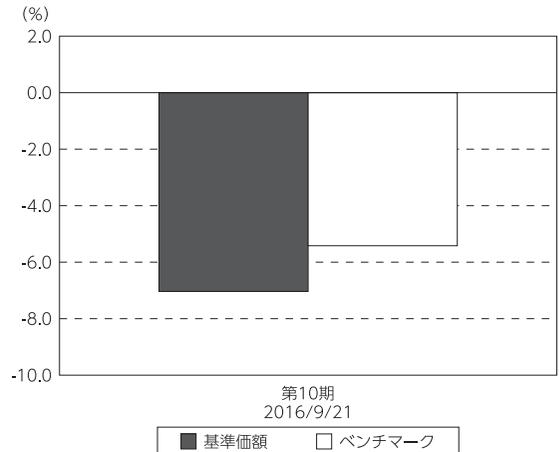
（マイナス要因）

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）ベンチマークは、関東・甲信インデックス（除く東京都）です。

◎分配金

償還のため分配は行いませんでした。

◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円が償還時9,113.78円となりました。設定来お支払した分配金は1万口当たり495円となりました。

第1期（2006年9月22日～2007年9月21日）

原油価格の下落、米国の好調な企業業績、日銀の利上げ見送りなどによる円安の進行や堅調な国内経済指標などにより、株式市場は上昇しました。しかし、中国株式相場の急落や米国のサブプライムローン（信用力の低い個人向け住宅融資）問題などをきっかけに、海外の株式相場が大幅に下落したことや、急速に円高が進行したことを受けて株式市場は下落しました。

第2期（2007年9月22日～2008年9月22日）

日米欧の金融機関の業績下方修正などをきっかけにサブプライムローン問題が再燃し、世界的に株式相場が下落したこと、急激な円高となったことなどから景気や企業業績に対する懸念が強まった結果、株式市場は下落しました。その後、欧米金融機関の相次ぐ資本増強の発表を受け過度な信用不安が後退したことや、円安基調となり株式市場は上昇しましたが、原油高などによる世界的なインフレ懸念や内外景気の減速懸念が強まり、株式市場は再び下落基調に転じました。

第3期（2008年9月23日～2009年9月24日）

米大手証券会社の経営破綻などから米金融危機の様相が強まったこと、投資家の資金引き上げにより急激な円高が進んだことなどを受け株式市場は下落しました。その後、わが国の追加経済対策が具体化したこと、内外経済指標に下げ止まりの兆しが見られたことなどから景気回復への期待感が広がった結果、株式市場は上昇しました。

第4期（2009年9月25日～2010年9月21日）

政府による追加経済対策の決定及び日銀による新たな資金供給策の導入を受け、投資家心理が好転したこと、市場予想を上回る国内外の経済指標や国内主要企業の好決算を背景に今後の景気回復への期待が高まったことから、株式市場は上昇しました。その後、欧州の財政問題の拡大懸念、米経済指標に左右され海外株式市場が不安定な動きを続けたことや円相場が高止まりしたことを受けて、株式市場は下落しました。

第5期（2010年9月22日～2011年9月21日）

米連邦準備制度理事会（FRB）による追加金融緩和策が好感されたことや、予想を上回る米国経済指標発表による米国景気回復期待から輸出関連企業の良い業績が見込まれたこと、中国の景気過熱に対する警戒感が一部緩和されたことなどから、株式市場は上昇しました。しかし、東日本大震災とそれに伴う福島第一原子力発電所の事故などを背景に投資家がリスク資産から資金を引き上げる姿勢を強めたことなどから、株式市場は下落に転じました。その後、為替協調介入による円安の進展や復興需要への期待が高まったこと、ギリシャ議会での財政緊縮策の可決を受け、欧州債務問題への過度な警戒感が後退したことなどから、株式市場は上昇しましたが、欧州の債務問題のユーロ圏内での波及観測や大手格付け機関による米国国債の格下げを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、株式市場は再び下落しました。

第6期（2011年9月22日～2012年9月21日）

ギリシャへの追加支援の合意や債務削減交渉の進展に加え、世界的な金融緩和を背景に投資家のリスク許容度が改善したこと、米国景気回復期待や円安進行に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待が高まったことなどから、株式市場は上昇しました。その後、米雇用統計が予想を下回ったことや、欧州債務問題の再燃や中国経済成長の減速などから世界的に景気回復期待が後退したこと、米国や中国の経済指標が市場予想を下回ったことや、日銀が追加金融緩和を見送ったことで投資家心理が悪化したことなどから、株式市場は下落しました。

第7期（2012年9月22日～2013年9月24日）

自由民主党が衆議院選挙で勝利し、脱デフレーション政策や円安進行から業績回復期待が高まったことに加え、日銀が打ち出した「量的・質的金融緩和」が事前予想を上回る規模だったことを背景に、株式市場は上昇しました。その後、相場過熱への警戒感の高まりや、国内長期金利の上昇による景気悪化懸念が高まったことを背景に、株式市場は一進一退の展開となりました。

第8期（2013年9月25日～2014年9月22日）

米国の経済指標が概ね堅調だったことや、為替が円安に推移したことで国内輸出関連企業を中心に業績上振れ期待が高まったことを背景に株式市場は上昇しました。しかし、アルゼンチンペソ為替相場の急落をきっかけに新興国経済への警戒感が広まったことに加え、予想を下回る米国経済指標発表により米景気減速懸念も浮上したことなどから、株式市場は下落しました。その後、中国の景気指標の改善や米国株式市場の上昇などを好感したことや政府の成長戦略への期待感が広がったことを背景に、株式市場は上昇しました。

第9期（2014年9月23日～2015年9月24日）

世界的な金融緩和が継続したことや、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったこと、国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだことなどから株式市場は上昇しました。その後、中国や新興国への景気減速への懸念が高まったことや為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり、株式市場は下落しました。

第10期（2015年9月25日～2016年9月21日）

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、株式市場は上昇しました。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。

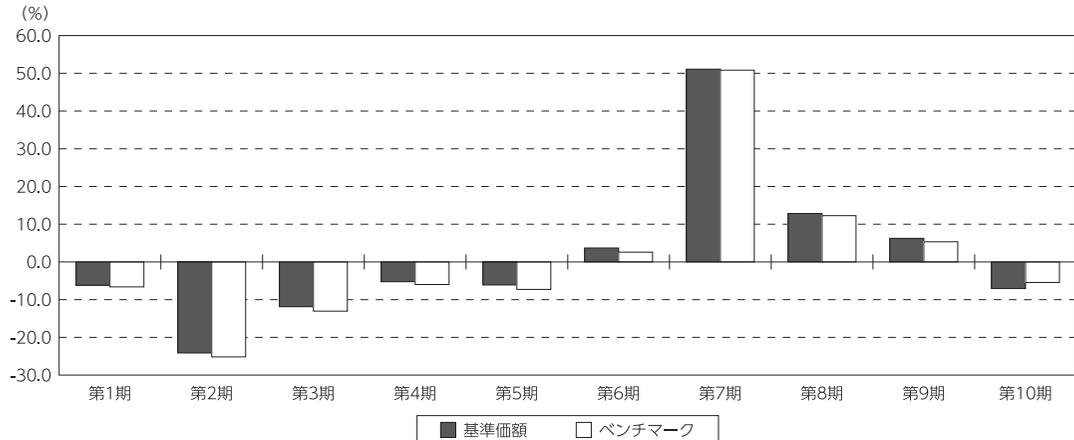
○ベンチマーク（関東・甲信インデックス（除く東京都））との対比

設定来では、ベンチマークが-8.3%となったのに対し、基準価額の騰落率※は-2.6%となりました。

各期におけるベンチマークと基準価額の騰落率は次のようになっております。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

<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、関東・甲信インデックス（除く東京都）です。

(主なプラス要因)

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

(主なマイナス要因)

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）

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年9月25日～2016年9月21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 95 (39) (50) (5)	% 0.964 (0.402) (0.509) (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)	0.002 (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
(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	95	0.969	
期中の平均基準価額は、9,826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。

* 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9月25日～2016年9月21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		44	55,839	955	1,149,056
		(△ 5)	(-)		

* 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9月25日～2016年9月21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	1,204,895千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,075,592千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.12

* (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9月25日～2016年9月21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	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	55	—	—	1,149	76	6.6
預金	706	706	100.0	706	706	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
	百万円	百万円	百万円
株式	0.05135	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証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月21日現在)

2016年9月21日現在、有価証券等の組入れはございません。

国内株式

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株数			株数	
		千株			千株
水産・農林業			食料品		
カネコ種苗	0.1		日清製粉グループ本社	0.6	
サカタのタネ	1.1		フィード・ワン	4.6	
ホクト	0.8		カルビー	0.2	
鉱業			ヤクルト本社	0.2	
国際石油開発帝石	2.8		明治ホールディングス	0.1	
建設業			アサヒグループホールディングス	1	
第一カッター興業	0.1		キリンホールディングス	1.8	
コムシスホールディングス	0.1		サントリー食品インターナショナル	0.8	
富士古河E&C	1		ジャパンフーズ	0.1	
ヤマウラ	0.2		キッコーマン	2	
大成建設	1		味の素	1	
大林組	1		キュービー	0.3	
清水建設	1		エバラ食品工業	0.1	
飛島建設	3.6		東洋水産	0.2	
長谷工コーポレーション	0.3		日清食品ホールディングス	0.2	
鹿島建設	1		日本たばこ産業	3.8	
佐田建設	2		ビックスコーポレーション	0.1	
北野建設	2		篠崎屋	0.3	
大東建託	0.1		繊維製品		
新日本建設	1.4		帝人	1	
住友林業	0.2		東レ	12	
大和ハウス工業	0.7		アツギ	4	
積水ハウス	0.7		パルプ・紙		
日揮	3		王子ホールディングス	1	
ヤマト	0.3		日本製紙	0.1	
東芝プラントシステム	2.3		化学		
東洋エンジニアリング	4		クラレ	0.3	
千代田化工建設	5		旭化成	2	
新興ブランテック	1.1		昭和電工	3	
			住友化学	2	

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
日産化学工業		0.3
東ソー		1
デンカ		1
信越化学工業		1.1
大陽日酸		0.6
川崎化成工業		1
カネカ		1
三菱瓦斯化学		1
三井化学		2
J S R		0.7
東京応化工業		1.1
三菱ケミカルホールディングス		2.1
ダイセル		0.5
積水化学工業		1
日立化成		0.6
群栄化学工業		2
ニックス		0.1
トリケミカル研究所		0.2
花王		1
日本ペイントホールディングス		0.4
関西ペイント		1
D I C		2
富士フイルムホールディングス		1.2
資生堂		0.8
ファンケル		1.5
シーボン		0.1
リプロセル		1.2
大成ラミック		0.1
日東電工		0.1
きもと		1.3
ニフコ		1.2
ユニ・チャーム		0.6
医薬品		
協和発酵キリン		1
武田薬品工業		0.9
アステラス製薬		2.6
田辺三菱製薬		1.4
中外製薬		1.6

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
エーザイ		0.9
小野薬品工業		0.2
久光製薬		0.4
ツムラ		0.1
キッセイ薬品工業		1.3
オンコセラビー・サイエンス		3.4
第一三共		1.5
免疫生物研究所		0.2
ナノキャリア		1
大塚ホールディングス		0.6
大正製薬ホールディングス		0.1
石油・石炭製品		
昭和シェル石油		0.3
東亜石油		3
東燃ゼネラル石油		1
出光興産		0.2
J Xホールディングス		3.1
ゴム製品		
横浜ゴム		0.4
昭和ホールディングス		1.1
日東化工		1
ブリヂストン		0.9
朝日ラバー		0.1
フコク		0.2
ガラス・土石製品		
旭硝子		2
日本電気硝子		1
オハラ		0.6
太平洋セメント		1
デイ・シイ		0.8
T O T O		1
日本特殊陶業		0.3
エーアンドエーマテリアル		2
鉄鋼		
新日鐵住金		6
神戸製鋼所		5
ジェイ エフ イー ホールディングス		1
日立金属		0.6

銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株
新報国製鉄	0.1	0.1
日本鑄造	1	1
日本鑄鉄管	1	1
シンニッタン	0.6	0.6
非鉄金属		
三井金属鉱業	1	1
三菱マテリアル	1	1
住友金属鉱山	1	1
DOWAホールディングス	1	1
東邦チタニウム	1.6	1.6
住友電気工業	0.9	0.9
フジクラ	1	1
沖電線	1	1
金属製品		
アルファC○	0.1	0.1
サンコーテクノ	0.1	0.1
山王	0.1	0.1
東洋製織グループホールディングス	0.2	0.2
LIXILグループ	0.5	0.5
不二サッシ	2.9	2.9
ジーテクト	1	1
バイオラックス	0.3	0.3
エイチワン	0.7	0.7
日本発條	4.9	4.9
三益半導体工業	0.8	0.8
機械		
アマダホールディングス	7.5	7.5
アイダエンジニアリング	1.7	1.7
岡本工作機械製作所	1	1
ソディック	1.2	1.2
日特エンジニアリング	0.4	0.4
ディスコ	0.1	0.1
ヤマシンフィルタ	0.3	0.3
ニューフレアテクノロジ	0.3	0.3
大崎エンジニアリング	0.1	0.1
ナブテスコ	0.1	0.1
レオン自動機	0.7	0.7
SMC	0.2	0.2

銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株
オイレス工業	0.8	0.8
日精エー・エス・ビー機械	0.4	0.4
日精樹脂工業	0.5	0.5
小松製作所	1.7	1.7
住友重機械工業	1	1
日立建機	0.3	0.3
クボタ	2	2
三菱化工機	2	2
アイチ コーポレーション	0.9	0.9
ブラコー	1	1
荏原製作所	1	1
ダイキン工業	0.3	0.3
栗田工業	0.1	0.1
アネスト岩田	1	1
昭和真空	0.1	0.1
油研工業	1	1
キトー	0.6	0.6
SANKYO	0.3	0.3
オーイズミ	0.5	0.5
竹内製作所	1.1	1.1
アマノ	1.8	1.8
サンデンホールディングス	3	3
グローリー	0.2	0.2
日本ピストンリング	2	2
放電精密加工研究所	0.2	0.2
日本精工	1.1	1.1
ジェイテクト	0.5	0.5
THK	0.1	0.1
前澤工業	0.5	0.5
NFKホールディングス	0.7	0.7
キッツ	2.8	2.8
三菱重工業	31	31
IHI	2	2
電気機器		
コニカミノルタ	0.8	0.8
ミネベア	8	8
日立製作所	6	6
東芝	6	6

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
三菱電機		3
富士電機		2
安川電機		0.8
芝浦メカトロニクス		1
マブチモーター		1.6
日本電産		0.6
大泉製作所		0.2
テラプローブ		0.2
JVCケンウッド		3.2
ミマキエンジニアリング		0.7
オムロン		0.3
メディアグローバルリンクス		0.1
オプトエレクトロニクス		0.2
リバーエレテック		0.2
ジーエス・ユアサ コーポレーション		1
テクノメディア		0.2
日本電気		4
富士通		21
沖電気工業		3
サンケン電気		3
明星電気		3
ナカヨ		1
ウインテスト		0.1
エイアンドティー		0.1
セイコーエプソン		7.2
ワコム		3.9
アルバック		1.1
ジャパンディスプレイ		1.4
京三製作所		1
パナソニック		2.8
シャープ		1
アンリツ		3.2
富士通ゼネラル		3
ソニー		2.4
TDK		0.3
帝国通信工業		1
パイオニア		8.6
鈴木		0.3

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
メイコー		0.6
クラリオン		7
東光		2
ヒロセ電機		0.1
精工技研		0.2
横河電機		0.8
アズビル		0.2
日本光電工業		0.3
アドバンテスト		0.6
小野測器		0.1
ミナトホールディングス		1
エヌエフ回路設計ブロック		0.1
日置電機		0.2
シスメックス		0.8
OBARA GROUP		0.5
長野日本無線		1
キョウデン		1.2
ジオマテック		0.2
イリソ電子工業		0.3
菊水電子工業		0.1
レーザーテック		0.5
スタンレー電気		0.3
古河電池		1
図研		0.5
カシオ計算機		0.5
ファナック		3.9
芝浦電子		0.1
エンプラス		0.4
ローム		0.1
浜松ホトニクス		0.5
新光電気工業		3.1
京セラ		0.7
エルナー		1
日本インター		1.5
村田製作所		0.2
双葉電子工業		1.1
KOA		0.9
市光工業		2

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
小糸製作所		0.2
ミツバ		1.1
キヤノン電子		1
キヤノン		2.6
リコー		1
輸送用機器		
鬼怒川ゴム工業		2
ユニプレス		1.1
豊田自動織機		0.5
日鍛バルブ		0.3
デンソー		1.3
三井造船		1
川崎重工業		2
日産自動車		88.6
いすゞ自動車		2.4
日野自動車		1.2
エフテック		0.4
ファルテック		0.2
テイン		0.1
日産車体		1.8
日信工業		1.5
東京ラヂエーター製造		0.3
曙ブレーキ工業		3.1
NOK		0.3
プレス工業		2.6
カルソニックカンセイ		6
河西工業		0.9
アイシン精機		0.1
マツダ		0.7
本田技研工業		3.5
スズキ		0.5
富士重工業		2.7
ショーワ		1.8
盟和産業		1
ヨロズ		0.6
八千代工業		0.3
ティ・エス テック		1.6

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
精密機器		
テルモ		1.1
クリエートメディック		0.1
プレジジョン・システム・サイエンス		0.5
モリテックス		0.3
ナカニシ		0.4
ブイ・テクノロジー		0.1
東京衡機		2
インターアクション		0.2
マニー		0.8
ニコン		1.3
オリンパス		0.5
タムロン		0.6
HOYA		0.8
岡本硝子		0.4
ホロン		0.1
シチズンホールディングス		0.8
リズム時計工業		3
CYBERDYNE		2.9
その他製品		
バンダイナムコホールディングス		0.4
アビックス		0.5
グラフィトデザイン		0.2
タカノ		0.2
凸版印刷		1
大日本印刷		1
ツツミ		0.2
リーガルコーポレーション		1
ビジョン		0.2
岡村製作所		2.6
電気・ガス業		
東京電力ホールディングス		7.2
中部電力		0.7
電源開発		0.2
東京瓦斯		12
陸運業		
東武鉄道		5
相鉄ホールディングス		6

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
東京急行電鉄	4	
京浜急行電鉄	2	
小田急電鉄	2	
京王電鉄	2	
京成電鉄	7	
富士急行	1	
新京成電鉄	1	
東日本旅客鉄道	1.1	
西日本旅客鉄道	0.1	
東海旅客鉄道	0.3	
西武ホールディングス	7.9	
ゼロ	0.2	
アルプス物流	0.2	
日本通運	1	
ヤマトホールディングス	0.4	
丸全昭和運輸	1	
神奈川中央交通	1	
丸和運輸機関	0.2	
海運業		
日本郵船	2	
商船三井	1	
川崎汽船	1	
空運業		
日本航空	0.4	
ANAホールディングス	3	
倉庫・運輸関連業		
日新	1	
宇徳	1	
情報・通信業		
ASJ	0.2	
コーエーテクモホールディングス	2.1	
電算	0.1	
AGS	0.2	
システムインテグレータ	0.1	
サイバーコム	0.2	
カヤック	0.2	
ハイマックス	0.1	
野村総合研究所	0.2	

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
オービック	0.1	
ヤフー	5.6	
トレンドマイクロ	0.1	
日本オラクル	0.1	
アルファシステムズ	0.2	
東計電算	0.1	
大塚商会	0.1	
図研エルミック	0.1	
ACCESS	0.9	
ウェザーニューズ	0.3	
C I J	0.5	
日本電信電話	2.2	
KDDI	2.6	
NTTドコモ	4	
アイネット	0.3	
東宝	0.2	
エヌ・ティ・ティ・データ	0.3	
シーイーシー	0.4	
富士ソフト	0.8	
ソフトバンクグループ	1.2	
卸売業		
東京エレクトロン デバイス	0.2	
双日	1.2	
アルフレッサ ホールディングス	0.2	
横浜冷凍	1.2	
マクニカ・富士エレホールディングス	1.4	
メディカルホールディングス	0.2	
PALTEK	0.3	
伊藤忠商事	1.6	
丸紅	1.7	
ユアサ・フナショク	1	
豊田通商	0.3	
三井物産	1.8	
日立ハイテク ロジーズ	0.3	
住友商事	1.2	
三菱商事	1.6	
すてきなリスグループ	2	
イノテック	0.4	

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
藤井産業		0.1
ミスミグループ本社		0.8
スズケン		0.3
小売業		
ローソン		0.1
カワチ薬品		0.6
オートウェーブ		0.3
エービーシー・マート		0.1
魚喜		0.1
シー・ヴィ・エス・ベイエリア		1
日本マクドナルドホールディングス		0.1
キタムラ		0.2
パナーズ		0.9
ジェーソン		0.3
J. フロント リテイリング		0.3
マツモトキヨシホールディングス		1.3
スタートトゥデイ		2.5
ココカラファイン		0.6
三越伊勢丹ホールディングス		0.7
クリエイトSDホールディングス		0.3
ジョイフル本田		1.2
ブックオフコーポレーション		0.5
メガネスーパー		1.6
トーエル		0.5
セブン&アイ・ホールディングス		0.9
ツルハホールディングス		0.1
新星堂		0.2
ノジマ		1.1
カッパ・クリエイト		1.3
ライトオン		0.7
マツヤ		0.1
コナカ		0.7
コジマ		1.8
ドンキホーテホールディングス		0.2
ワークマン		0.2
サイゼリヤ		1.2
かんなん丸		0.1
ハイデイ日高		0.5

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
コロワイド		1.7
ピーシーデポコーポレーション		0.9
スギホールディングス		0.1
ユニー・ファミリーマートホールディングス		0.1
ケーヨー		0.7
島忠		1.2
さが美		1
AOKIホールディングス		2.1
しまむら		0.7
高島屋		1
エイチ・ツー・オー リテイリング		0.2
丸井グループ		0.7
さいか屋		1
イオン		15.9
ヤオコー		0.5
ケーズホールディングス		1.4
元気寿司		0.2
ヤマダ電機		17.7
ニトリホールディングス		0.1
くろがねや		0.1
ベリテ		1
ミニストップ		0.7
ベルク		0.2
文教堂グループホールディングス		0.3
ファーストリテイリング		0.1
サンドラッグ		0.1
ペルーナ		1.3
銀行業		
足利ホールディングス		7.7
千葉銀行		20
横浜銀行		29
常陽銀行		18
群馬銀行		11
武蔵野銀行		0.8
千葉興業銀行		1.4
筑波銀行		1.9
八十二銀行		12
山梨中央銀行		2

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
	千株	
セブン銀行	1.2	
長野銀行	1	
京葉銀行	3	
栃木銀行	1	
東和銀行	9	
証券、商品先物取引業		
SBIホールディングス	0.2	
大和証券グループ本社	2	
野村ホールディングス	3.8	
保険業		
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	0.4	
MS&ADインシュアランスグループホール	0.6	
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.4	
第一生命保険	1.2	
東京海上ホールディングス	0.7	
T&Dホールディングス	0.7	
その他金融業		
クレディセゾン	0.2	
イオンフィナンシャルサービス	0.2	
オリックス	1.3	
三菱UFJリース	0.9	
不動産業		
ヒューリック	0.7	
野村不動産ホールディングス	0.2	
東急不動産ホールディングス	0.6	
飯田グループホールディングス	0.3	
パーク24	0.1	
三井不動産	1	
三菱地所	1	
東京建物	0.2	
レオパレス21	0.3	
リベレステ	0.3	
イオンモール	4.2	
ランド	8.6	
ASIAN STAR	0.4	

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
	千株	
グランディハウス	0.7	
日本空港ビルデング	0.1	
サービス業		
ミクシィ	0.1	
イナリサーチ	0.1	
平安レイサービス	0.2	
メディネット	2.1	
カカコム	0.2	
DNAチップ研究所	0.1	
ソクイ	0.8	
エムスリー	0.3	
ディー・エヌ・エー	0.1	
博報堂DYホールディングス	0.4	
電通	0.3	
イオンファンタジー	0.5	
シーティーエス	0.3	
山田債権回収管理総合事務所	0.1	
みらかホールディングス	0.1	
アルプス技研	0.3	
エイジス	0.1	
オリエンタルランド	8.4	
リゾートトラスト	0.1	
ユー・エス・エス	0.3	
サイバーエージェント	0.1	
楽天	1.4	
サクセスホールディングス	0.1	
エラン	0.2	
ナガワ	0.2	
セコム	0.2	
ベネッセホールディングス	0.1	
ステップ	0.2	
計	株数	917
計	銘柄数	549

*各銘柄の業種分類は、期首の時点での分類に基づいています。

○投資信託財産の構成

(2016年9月21日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	975,621	100.0
投資信託財産総額	975,621	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2016年9月21日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	975,621,378
コール・ローン等	975,621,378
(B) 負債	5,037,594
未払信託報酬	5,017,762
未払利息	3,164
その他未払費用	16,668
(C) 純資産総額(A-B)	970,583,784
元本	1,064,962,773
償還差損金	△ 94,378,989
(D) 受益権総口数	1,064,962,773口
1万口当たり償還価額(C/D)	9,113円78銭

(注) 期首元本額は1,224,488,814円、期中追加設定元本額は8,091,190円、期中一部解約元本額は167,617,231円、1口当たり純資産額は0.911378円です。

○損益の状況 (2015年9月25日～2016年9月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	19,827,019
受取配当金	19,814,972
受取利息	7,411
その他収益金	30,350
支払利息	△ 25,714
(B) 有価証券売買損益	△ 82,807,840
売買益	53,838,050
売買損	△136,645,890
(C) 信託報酬等	△ 10,816,448
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 73,797,269
(E) 前期繰越損益金	3,194,235
(F) 追加信託差損益金	△ 23,775,955
(配当等相当額)	(826,665)
(売買損益相当額)	(△ 24,602,620)
償還差損金(D+E+F)	△ 94,378,989

*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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2006年9月22日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年9月21日			資産総額	975,621,378円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	5,037,594円	
				純資産総額	970,583,784円	
受益権口数	35,380,479,943口	1,064,962,773口	△34,315,517,170口	受益権口数	1,064,962,773口	
元本額	35,380,479,943円	1,064,962,773円	△34,315,517,170円	1万口当たり償還金	9,113円78銭	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	17,088,750,202円	16,029,815,246円	9,380円	0円	0.00%	
第2期	9,790,029,890	6,907,682,694	7,056	60	0.60	
第3期	6,807,947,488	4,199,471,221	6,168	50	0.50	
第4期	4,668,653,115	2,714,872,813	5,815	30	0.30	
第5期	3,565,564,828	1,932,438,474	5,420	40	0.40	
第6期	2,569,849,855	1,431,354,545	5,570	50	0.50	
第7期	2,159,581,957	1,800,526,497	8,337	80	0.80	
第8期	1,832,392,968	1,707,297,189	9,317	90	0.90	
第9期	1,224,488,814	1,200,575,999	9,805	95	0.95	

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	9,113円78銭
----------------	-----------

○お知らせ

該当事項はございません。