

積立て株式ファンド

愛称：MIP [Monthly Investment Plan]

運用報告書(全体版)

第48期（決算日2016年12月12日）

作成対象期間（2015年12月11日～2016年12月12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	1968年12月25日から無期限です。
運用方針	日経平均株価（日経225）と連動する投資成果を目指します。 株式への投資に当たっては、日経平均株価（日経225）に採用されている銘柄の中から、原則として200銘柄以上に等株数投資を行います。 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
主な投資対象	わが国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、繰越分を含めた利子・配当収入、売買益（評価益を含みます）等から利子・配当収入等は原則として全額分配し、売買益等も可能な範囲で分配します。 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/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	期 騰 落 率	日 経 平 均 株 価 (日 経 2 2 5)	期 騰 落 率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
44期(2012年12月10日)	148	3	11.9	9,533	10.2	98.3	1.6	16,963
45期(2013年12月10日)	242	3	65.5	15,611	63.7	98.4	1.5	24,252
46期(2014年12月10日)	268	4	12.4	17,412	11.5	98.2	1.7	23,484
47期(2015年12月10日)	292	4	10.4	19,047	9.4	97.1	2.8	21,993
48期(2016年12月12日)	294	3	1.7	19,155	0.6	97.6	2.4	20,972

* 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

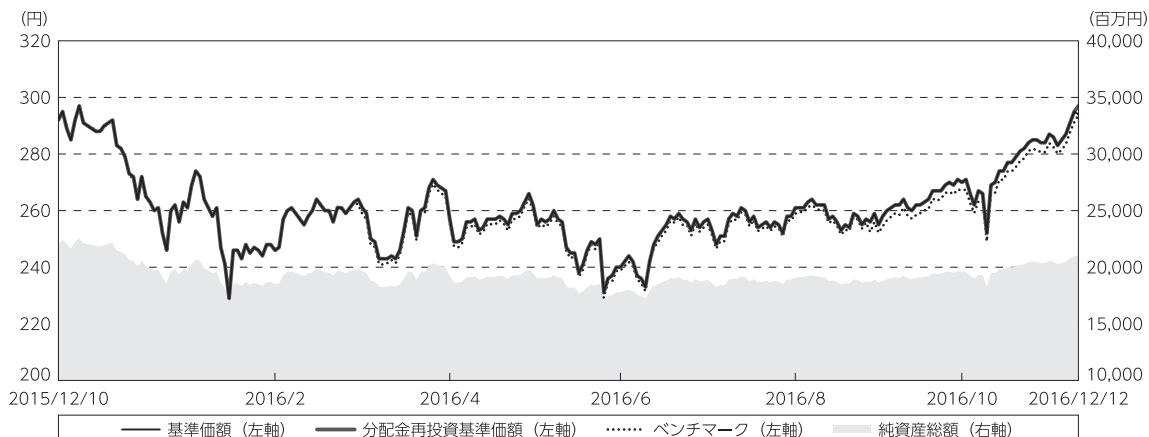
年 月 日	基 準	価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	日 経 平 均 株 価 (日 経 2 2 5)	騰 落 率		
(期 首) 2015年12月10日	円	%	円	%	%	%	%
	292	—	19,047	—	97.1	2.8	
12月末	292	0.0	19,034	△ 0.1	96.4	3.5	
2016年 1 月末	269	△ 7.9	17,518	△ 8.0	96.9	3.0	
2 月末	246	△15.8	16,027	△15.9	97.2	2.8	
3 月末	259	△11.3	16,759	△12.0	96.4	3.5	
4 月末	257	△12.0	16,666	△12.5	97.1	2.8	
5 月末	266	△ 8.9	17,235	△ 9.5	97.7	2.2	
6 月末	240	△17.8	15,576	△18.2	95.9	4.0	
7 月末	256	△12.3	16,569	△13.0	96.6	3.0	
8 月末	261	△10.6	16,887	△11.3	96.6	3.4	
9 月末	255	△12.7	16,450	△13.6	96.4	3.3	
10 月末	270	△ 7.5	17,425	△ 8.5	97.3	2.7	
11 月末	284	△ 2.7	18,308	△ 3.9	96.1	3.9	
(期 末) 2016年12月12日	297	1.7	19,155	0.6	97.6	2.4	

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

- ①「日経平均」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「積立て株式ファンド」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「積立て株式ファンド」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



期 首：292円

期 末：294円（既払分配金（税込み）：3円）

騰落率：1.7%（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12月10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、日経平均株価（日経225）です。ベンチマークは、作成期首（2015年12月10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292円から期末297円（分配金込み）に5円の値上がりとなりました。

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企業業績の改善期待などから、基準価額は上昇しました。

○投資環境

<国内株式市場>

期首から2016年2月中旬まで、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、消費税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。8月以降も、決算発表や米国大統領選挙を控え、株式市場は横ばいの展開となりましたが、11月中旬以降は、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企業業績の改善期待などから、上昇に転じました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式の実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

日経平均株価（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等株数投資をしております。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による除数の変更などに応じてポートフォリオの修正を行いました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○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+1.7%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+0.6%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

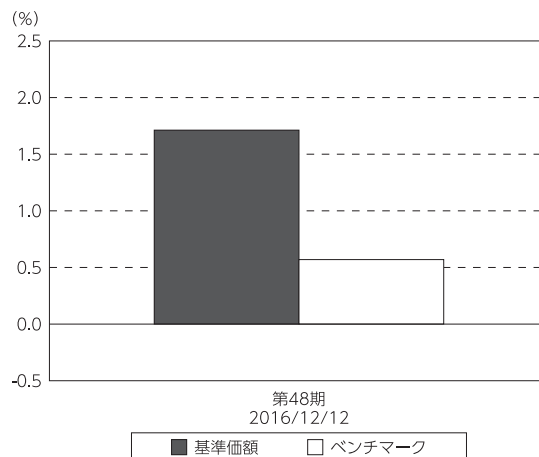
（マイナス要因）

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

（その他の要因）

基準価額の算出の際に1円未満を四捨五入することによる差異が生じること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注）ベンチマークは、日経平均株価（日経225）です。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の配当等収益から決定させていただきました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1千口当たり・税込み)

項 目	第48期
	2015年12月11日～ 2016年12月12日
当期分配金	3
(対基準価額比率)	1.010%
当期の収益	3
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	363

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

◎今後の運用方針

今後も、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 千口当たりの費用明細

(2015年12月11日～2016年12月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 2	% 0.782	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(1)	(0.407)	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)	(1)	(0.217)	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)	(0)	(0.157)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	2	0.786	
期中の平均基準価額は、262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1千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12月11日～2016年12月12日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 172 (△561)	千円 434,818 (ー)	千株 745	千円 1,375,952

* 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 4,180	百万円 4,268	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年12月11日～2016年12月12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	1,810,771千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,837,618千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

*(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12月11日～2016年12月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 434	百万円 12	% 2.8	百万円 1,375	百万円 17	% 1.2

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 1	百万円 30

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)	252千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	1.5%

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

(2016年12月12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 (0.2%)			
日本水産	44	41	21,566
マルハニチロ	4.4	4.1	12,013
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	17.6	16.4	20,623
建設業 (2.9%)			
コムシスホールディングス	44	41	84,542
大成建設	44	41	34,317
大林組	44	41	46,248
清水建設	44	41	44,116
長谷工コーポレーション	8.8	8.2	10,143
鹿島建設	44	41	33,907
大和ハウス工業	44	41	134,275
積水ハウス	44	41	78,494
日揮	44	41	89,093
千代田化工建設	44	41	36,572
食料品 (5.0%)			
日清製粉グループ本社	44	41	69,577
明治ホールディングス	8.8	8.2	72,242
日本ハム	44	41	124,435
サッポロホールディングス	44	8.2	24,485
アサヒグループホールディングス	44	41	150,306
キリンホールディングス	44	41	80,339
宝ホールディングス	44	41	42,353
キッコーマン	44	41	154,365
味の素	44	41	95,735
ニチレイ	44	20.5	46,699
日本たばこ産業	44	41	159,818
繊維製品 (0.3%)			
東洋紡	44	41	7,216
ユニチカ	44	41	3,608
帝人	44	8.2	19,220
東レ	44	41	38,540
パルプ・紙 (0.3%)			
王子ホールディングス	44	41	20,131

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本製紙	4.4	4.1	8,413
北越紀州製紙	44	41	27,634
化学 (8.5%)			
クラレ	44	41	70,356
旭化成	44	41	43,398
昭和電工	44	4.1	6,998
住友化学	44	41	24,149
日産化学工業	44	41	158,055
日本曹達	44	—	—
東ソー	44	41	35,506
トクヤマ	44	41	19,721
デンカ	44	41	21,607
信越化学工業	44	41	372,936
三井化学	44	41	22,591
三菱ケミカルホールディングス	22	20.5	16,039
宇部興産	44	41	10,660
日本化薬	44	41	56,703
花王	44	41	219,473
富士フイルムホールディングス	44	41	180,031
資生堂	44	41	118,941
日東電工	44	41	360,841
医薬品 (6.7%)			
協和発酵キリン	44	41	64,370
武田薬品工業	44	41	194,668
アステラス製薬	220	205	320,107
大日本住友製薬	44	41	75,071
塩野義製薬	44	41	205,164
中外製薬	44	41	130,585
エーザイ	44	41	278,964
第一三共	44	41	99,056
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	44	41	47,478
J Xホールディングス	44	41	21,074
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	22	20.5	43,439

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	44	41	175,603
ガラス・土石製品 (1.5%)			
旭硝子	44	41	33,046
日本板硝子	44	4.1	3,702
日本電気硝子	66	62	40,548
住友大阪セメント	44	41	17,671
太平洋セメント	44	41	15,334
東海カーボン	44	41	16,605
TOTO	22	20.5	91,430
日本碍子	44	41	98,031
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	4.4	4.1	11,152
神戸製鋼所	44	4.1	5,141
ジェイ エフ イー ホールディングス	4.4	4.1	7,861
日新製鋼	4.4	4.1	6,145
大太平洋金属	44	41	16,646
非鉄金属 (1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	44	41	10,742
三井金属鉱業	44	41	13,161
東邦亜鉛	44	41	21,197
三菱マテリアル	44	4.1	16,010
住友金属鉱山	44	41	66,235
DOWAホールディングス	44	41	38,294
古河機械金属	44	41	9,266
古河電気工業	44	4.1	14,493
住友電気工業	44	41	69,167
フジクラ	44	41	26,527
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	4.4	4.1	6,350
東洋製罐グループホールディングス	44	41	88,232
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	44	8.2	17,523
オークマ	44	41	45,797
アマダホールディングス	44	41	53,464
小松製作所	44	41	110,966
住友重機械工業	44	41	29,684
日立建機	44	41	103,771
クボタ	44	41	72,734
荏原製作所	44	8.2	26,199
ダイキン工業	44	41	444,440

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	44	41	56,539
NTN	44	41	20,582
ジェイテクト	44	41	79,376
日立造船	8.8	8.2	5,116
三菱重工業	44	41	22,873
IHI	44	41	14,309
電気機器 (17.0%)			
日清紡ホールディングス	44	41	46,617
コニカミノルタ	44	41	46,576
ミネベア	44	41	48,913
日立製作所	44	41	26,387
東芝	44	41	18,605
三菱電機	44	41	67,814
富士電機	44	41	24,887
安川電機	44	41	75,645
明電舎	44	41	15,990
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44	41	20,254
日本電気	44	41	13,243
富士通	44	41	28,950
沖電気工業	44	4.1	6,937
パナソニック	44	41	52,131
シャープ	44	—	—
ソニー	44	41	138,006
TDK	44	41	341,940
ミツミ電機	44	41	28,659
アルプス電気	44	41	121,032
パイオニア	44	41	10,045
横河電機	44	41	66,256
アドバンテスト	88	82	129,478
カシオ計算機	44	41	68,306
ファナック	44	41	839,065
京セラ	88	82	472,320
太陽誘電	44	41	52,070
SCREENホールディングス	44	8.2	53,136
キヤノン	66	61.5	210,145
リコー	44	41	42,558
東京エレクトロン	44	41	412,460
輸送用機器 (7.0%)			
デンソー	44	41	207,173
三井造船	44	41	7,667

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	44	41	16,195
日産自動車	44	41	46,371
いすゞ自動車	22	20.5	30,862
トヨタ自動車	44	41	287,041
日野自動車	44	41	50,307
三菱自動車工業	4.4	4.1	2,611
マツダ	8.8	8.2	16,281
本田技研工業	88	82	284,212
スズキ	44	41	163,877
富士重工業	44	41	199,547
ヤマハ発動機	—	41	113,939
精密機器 (3.0%)			
テルモ	88	82	338,250
ニコン	44	41	71,955
オリンパス	44	41	172,610
シチズン時計	44	41	29,971
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	44	41	44,936
大日本印刷	44	41	47,150
ヤマハ	44	41	145,755
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	4.4	4.1	2,103
中部電力	4.4	4.1	7,002
関西電力	4.4	4.1	5,286
東京瓦斯	44	41	21,615
大阪瓦斯	44	41	18,351
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	44	41	23,001
東京急行電鉄	44	41	36,121
小田急電鉄	44	20.5	46,186
京王電鉄	44	41	37,843
京成電鉄	44	20.5	55,657
東日本旅客鉄道	4.4	4.1	40,979
西日本旅客鉄道	4.4	4.1	29,237
東海旅客鉄道	4.4	4.1	77,367
日本通運	44	41	24,846
ヤマトホールディングス	44	41	96,821
海運業 (0.2%)			
日本郵船	44	41	9,799
商船三井	44	41	13,817

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	44	41	11,521
空運業 (0.1%)			
A N Aホールディングス	44	41	12,984
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	44	41	66,420
情報・通信業 (11.4%)			
ヤフー	17.6	16.4	7,248
トレンドマイクロ	44	41	169,740
スカパー J S A Tホールディングス	4.4	4.1	2,263
日本電信電話	8.8	8.2	38,581
K D D I	264	246	732,465
N T T ドコモ	4.4	4.1	10,815
東宝	4.4	4.1	13,325
エヌ・ティ・ティ・データ	44	41	232,470
コナミホールディングス	44	41	168,715
ソフトバンクグループ	132	123	957,186
卸売業 (2.2%)			
双日	4.4	4.1	1,225
伊藤忠商事	44	41	67,609
丸紅	44	41	27,937
豊田通商	44	41	125,255
三井物産	44	41	69,372
住友商事	44	41	58,117
三菱商事	44	41	104,550
小売業 (12.3%)			
J . フロント リテイリング	22	20.5	35,567
三越伊勢丹ホールディングス	44	41	55,514
セブン&アイ・ホールディングス	44	41	183,844
ユニー・ファミリーマートホールディングス	—	41	300,120
高島屋	44	41	40,672
丸井グループ	44	41	71,176
イオン	44	41	68,019
ユニーグループ・ホールディングス	44	—	—
ファーストリテイリング	44	41	1,768,330
銀行業 (1.1%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	41	23,550
新生銀行	44	41	8,528
あおぞら銀行	44	41	17,384
三菱UFJフィナンシャル・グループ	44	41	30,856
りそなホールディングス	4.4	4.1	2,514

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	44	4.1	18,220
三井住友フィナンシャルグループ	4.4	4.1	19,200
千葉銀行	44	41	30,504
横浜銀行	44	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	44	41	22,550
静岡銀行	44	41	41,861
みずほフィナンシャルグループ	44	41	9,048
証券・商品先物取引業 (0.5%)			
大和証券グループ本社	44	41	31,078
野村ホールディングス	44	41	30,803
松井証券	44	41	41,574
保険業 (1.1%)			
SOMPOホールディングス	11	10.3	42,775
MS&ADインシュアランスグループホール	13.2	12.3	46,764
ソニーフィナンシャルホールディングス	8.8	8.2	15,178
第一生命ホールディングス	4.4	4.1	8,261
東京海上ホールディングス	22	20.5	110,310
T&Dホールディングス	8.8	8.2	12,771

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	44	41	89,667
不動産業 (2.0%)			
東急不動産ホールディングス	44	41	29,110
三井不動産	44	41	115,538
三菱地所	44	41	98,974
東京建物	22	20.5	31,672
住友不動産	44	41	133,004
サービス業 (3.3%)			
ディー・エヌ・エー	13.2	12.3	38,745
電通	44	41	215,660
楽天	—	41	48,093
東京ドーム	44	20.5	24,559
セコム	44	41	346,532
合 計	株 数 ・ 金 額	9,264	8,128 20,468,490
	銘柄数<比率>	225	225 <97.6%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国 内	株式先物取引	日経225	百万円 498	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年12月12日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	20,468,490	96.2
コール・ローン等、その他	819,042	3.8
投資信託財産総額	21,287,532	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12月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,287,532,226
コール・ローン等	778,082,836
株式(評価額)	20,468,490,690
未収入金	35,945,700
未収配当金	3,633,000
差入委託証拠金	1,380,000
(B) 負債	315,020,205
未払収益分配金	213,984,093
未払解約金	26,076,749
未払信託報酬	74,646,837
未払利息	1,560
その他未払費用	310,966
(C) 純資産総額(A－B)	20,972,512,021
元本	23,538,250,280
次期繰越損益金	△ 2,565,738,259
(D) 受益権総口数	71,328,031,141口
1千口当たり基準価額(C／D)	294円

(注) 期首元本額は24,856,351,197円、期中追加設定元本額は438,759,265円、期中一部解約元本額は1,756,860,182円、1口当たり純資産額は0.2940円です。

○損益の状況 (2015年12月11日～2016年12月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	349,334,518
受取配当金	349,546,988
受取利息	75,133
その他収益金	35,572
支払利息	△ 323,175
(B) 有価証券売買損益	196,348,131
売買益	1,454,328,523
売買損	△ 1,257,980,392
(C) 先物取引等取引損益	△ 14,242,215
取引益	108,206,257
取引損	△ 122,448,472
(D) 信託報酬等	△ 151,822,945
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	379,617,489
(F) 前期繰越損益金	3,730,970,530
(G) 追加信託差損益金	△ 6,462,342,185
(配当等相当額)	(22,048,393,410)
(売買損益相当額)	(△28,510,735,595)
(H) 計(E＋F＋G)	△ 2,351,754,166
(I) 収益分配金	△ 213,984,093
次期繰越損益金(H＋I)	△ 2,565,738,259
追加信託差損益金	△ 6,462,342,185
(配当等相当額)	(22,048,393,410)
(売買損益相当額)	(△28,510,735,595)
分配準備積立金	3,896,603,926

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2015年12月11日～2016年12月12日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年12月11日～ 2016年12月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	249,541,296円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	130,076,193円
c. 信託約款に定める収益調整金	22,048,393,410円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	3,730,970,530円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	26,158,981,429円
f. 分配対象収益(1千口当たり)	366円
g. 分配金	213,984,093円
h. 分配金(1千口当たり)	3円

○分配金のお知らせ

1 千口当たり分配金（税込み）	3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。