

積立て株式ファンド

愛称：MIP [Monthly Investment Plan]

運用報告書(全体版)

第53期（決算日2021年12月10日）

作成対象期間（2020年12月11日～2021年12月10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ないます。 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ないます。

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 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
		税金	分配	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率			
49期(2017年12月11日)	円 350	円 6	% 21.1	円 22,939	% 19.8	% 96.3	% 3.6	百万円 21,176	
50期(2018年12月10日)	324	4	△ 6.3	21,220	△ 7.5	96.2	3.8	17,861	
51期(2019年12月10日)	356	6	11.7	23,410	10.3	97.4	2.5	18,676	
52期(2020年12月10日)	404	7	15.4	26,756	14.3	99.4	0.5	19,442	
53期(2021年12月10日)	428	6	7.4	28,438	6.3	97.1	2.8	19,117	

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
			日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(期首) 2020年12月10日	円 404	% -	円 26,756	% -	% 99.4	% 0.5
12月末	415	2.7	27,444	2.6	98.7	1.2
2021年1月末	418	3.5	27,663	3.4	97.0	2.9
2月末	438	8.4	28,966	8.3	98.5	1.4
3月末	444	9.9	29,179	9.1	95.0	5.0
4月末	438	8.4	28,813	7.7	95.5	4.5
5月末	438	8.4	28,860	7.9	96.0	3.9
6月末	437	8.2	28,792	7.6	96.2	3.8
7月末	414	2.5	27,284	2.0	96.5	3.5
8月末	426	5.4	28,090	5.0	96.6	3.3
9月末	449	11.1	29,453	10.1	95.0	4.8
10月末	441	9.2	28,893	8.0	95.4	4.5
11月末	424	5.0	27,822	4.0	95.7	4.2
(期末) 2021年12月10日	434	7.4	28,438	6.3	97.1	2.8

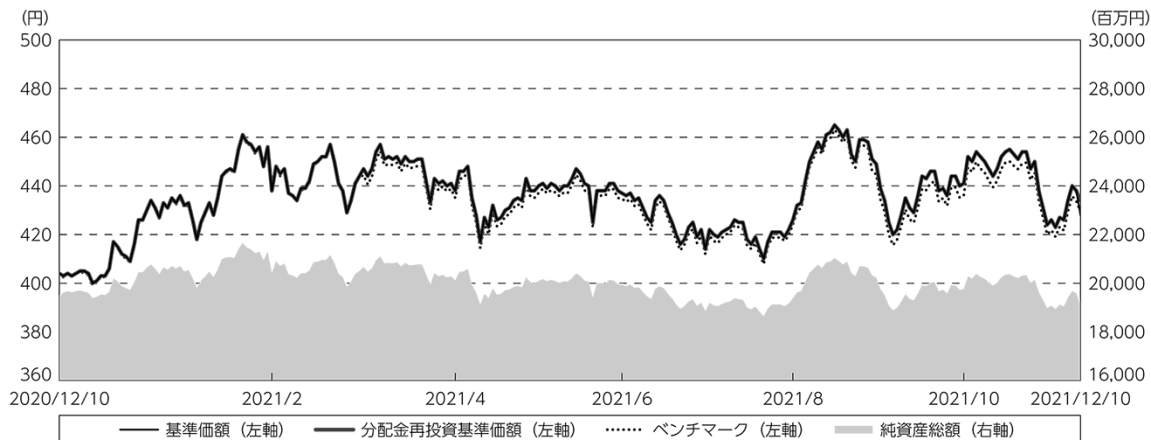
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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



- (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(2020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(2020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

国内株式の株価の変動

○投資環境

<国内株式市場>

期首から新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことや、米国の大型経済対策への期待感などから上昇しました。2021年3月下旬以降は、新型コロナウイルス変異株の感染再拡大による景気減速懸念などから軟調に推移しました。

9月上旬には菅首相の自民党総裁選出馬見送りが報道され、新首相の下で内閣が一新されることから、内閣支持率の回復期待が浮上したことなどにより一時上昇しましたが、その後は米中景気先行き不安や岸田新政権に対する期待が後退したことなどから下落しました。10月中旬

には、原油価格や米長期金利上昇が一服し過度なインフレ懸念が落ち着いたことなどから上昇しましたが、11月下旬以降は新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高いと思われるオミクロン株への懸念が高まったことなどにより下落しました。

○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、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+7.4%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+6.3%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

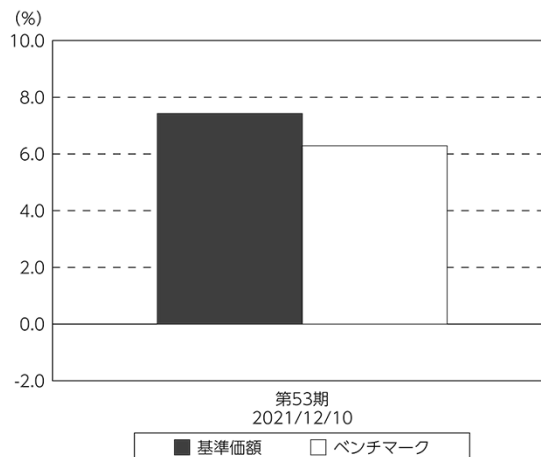
（マイナス要因）

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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1千口当たり・税込み)

項 目	第53期
	2020年12月11日～ 2021年12月10日
当期分配金	6
(対基準価額比率)	1.382%
当期の収益	6
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	497

(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なってまいります。
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

(2020年12月11日～2021年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(2)	(0.413)	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)	(0.220)	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)	(0.159)	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	3	0.796	
期中の平均基準価額は、431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。

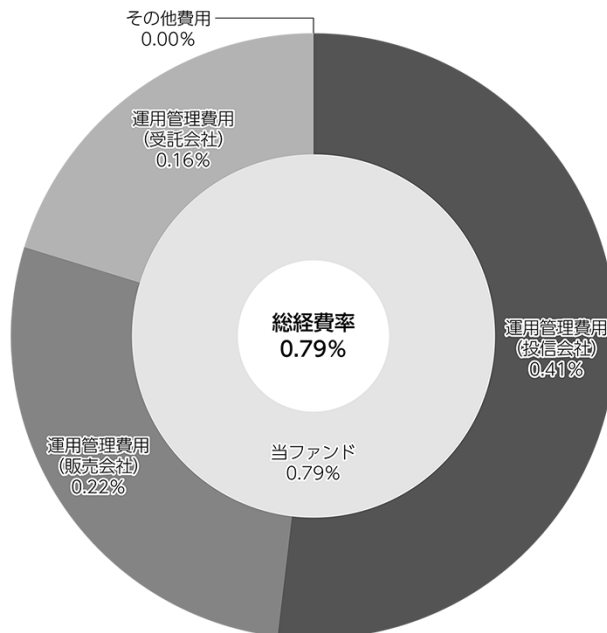
*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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。

(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0.79%です。



(注) 当ファンドの費用は1千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、売買委託手数料及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) 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

(2020年12月11日～2021年12月10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		24	465,811	600	2,465,605
		(156)	(-)		

*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		4,908	4,501	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年12月11日～2021年12月10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	2,931,417千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	19,111,178千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.15

*(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

(2020年12月11日～2021年12月10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 465	百万円 462	99.4	百万円 2,465	百万円 53	2.2

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 11

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

(2021年12月10日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
水産・農林業 (0.1%)						
日本水産	26	23	12,259			
マルハニチロ	2.6	2.3	5,418			
鉱業 (0.1%)						
I N P E X	10.4	9.2	9,071			
建設業 (1.5%)						
コムシスホールディングス	26	23	58,397			
大成建設	5.2	4.6	16,054			
大林組	26	23	20,148			
清水建設	26	23	16,376			
長谷工コーポレーション	5.2	4.6	6,582			
鹿島建設	13	11.5	15,249			
大和ハウス工業	26	23	76,659			
積水ハウス	26	23	54,498			
日揮ホールディングス	26	23	22,770			
食料品 (3.6%)						
日清製粉グループ本社	26	23	38,226			
明治ホールディングス	5.2	4.6	31,832			
日本ハム	13	11.5	46,230			
サッポロホールディングス	5.2	4.6	10,483			
アサヒグループホールディングス	26	23	104,650			
キリンホールディングス	26	23	42,561			
宝ホールディングス	26	23	28,290			
キッコーマン	26	23	201,480			
味の素	26	23	78,223			
ニチレイ	13	11.5	30,164			
日本たばこ産業	26	23	53,647			
繊維製品 (0.1%)						
東洋紡	2.6	2.3	2,893			
銘 柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
ユニチカ	2.6	2.3	692			
帝人	5.2	4.6	6,320			
東レ	26	23	15,932			
パルプ・紙 (0.1%)						
王子ホールディングス	26	23	12,719			
日本製紙	2.6	2.3	2,596			
化学 (7.7%)						
クラレ	26	23	23,092			
旭化成	26	23	25,357			
昭和電工	2.6	2.3	5,906			
住友化学	26	23	12,282			
日産化学	26	23	152,260			
東ソー	13	11.5	19,366			
トクヤマ	5.2	4.6	8,477			
デンカ	5.2	4.6	16,606			
信越化学工業	26	23	447,810			
三井化学	5.2	4.6	14,628			
三菱ケミカルホールディングス	13	11.5	9,661			
宇部興産	2.6	2.3	4,524			
花王	26	23	138,713			
D I C	2.6	2.3	6,808			
富士フイルムホールディングス	26	23	197,984			
資生堂	26	23	154,974			
日東電工	26	23	195,500			
医薬品 (6.8%)						
協和キリン	26	23	73,715			
武田薬品工業	26	23	70,863			
アステラス製薬	130	115	204,355			
大日本住友製薬	26	23	30,728			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
塩野義製薬	26	23	177,100
中外製薬	78	69	255,300
エーザイ	26	23	154,422
第一三共	78	69	193,717
大塚ホールディングス	26	23	94,162
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	10.4	9.2	27,213
E N E O Sホールディングス	26	23	9,913
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	13	11.5	21,436
ブリヂストン	26	23	113,229
ガラス・土石製品 (1.1%)			
A G C	5.2	4.6	25,760
日本板硝子	2.6	2.3	1,189
日本電気硝子	7.8	6.9	20,679
住友大阪セメント	2.6	2.3	8,337
太平洋セメント	2.6	2.3	5,310
東海カーボン	26	23	27,876
T O T O	13	11.5	63,365
日本硝子	26	23	43,125
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	2.6	2.3	4,230
神戸製鋼所	2.6	2.3	1,317
ジェイ エフ イー ホールディングス	2.6	2.3	3,236
大平洋金属	2.6	2.3	4,949
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	2.6	2.3	3,887
三井金属鉱業	2.6	2.3	6,957
東邦亜鉛	2.6	2.3	5,096
三菱マテリアル	2.6	2.3	4,662
住友金属鉱山	13	11.5	51,071
D O W Aホールディングス	5.2	4.6	20,654
古河電気工業	2.6	2.3	5,299
住友電気工業	26	23	35,017
フジクラ	26	23	13,409
金属製品 (0.0%)			
S U M C O	2.6	2.3	5,455
東洋製罐グループホールディングス	26	—	—
機械 (5.3%)			
日本製鋼所	5.2	4.6	17,020
オークマ	5.2	4.6	23,276
アマダ	26	23	26,542

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小松製作所	26	23	62,318
住友重機械工業	5.2	4.6	12,249
日立建機	26	23	77,395
クボタ	26	23	58,650
荏原製作所	5.2	4.6	30,130
ダイキン工業	26	23	608,810
日本精工	26	23	17,917
N T N	26	23	5,221
ジェイテクト	26	23	24,380
三井E&Sホールディングス	—	2.3	871
日立造船	5.2	4.6	3,657
三菱重工業	2.6	2.3	6,103
I H I	2.6	2.3	5,234
電気機器 (26.7%)			
日清紡ホールディングス	26	—	—
コニカミノルタ	26	23	11,316
ミネベアミツミ	26	23	75,670
日立製作所	5.2	4.6	30,084
三菱電機	26	23	34,017
富士電機	5.2	4.6	28,060
安川電機	26	23	131,330
オムロン	26	23	270,250
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.2	4.6	11,504
日本電気	2.6	2.3	12,259
富士通	2.6	2.3	45,126
沖電気工業	2.6	2.3	2,047
セイコーエプソン	52	46	90,068
パナソニック	26	23	28,669
シャープ	26	23	29,992
ソニーグループ	26	23	319,010
T D K	26	69	315,675
アルプスアルパイン	26	23	24,587
横河電機	26	23	48,047
アドバンテスト	52	46	465,980
キーエンス	—	2.3	166,451
カシオ計算機	26	23	35,121
ファナック	26	23	552,690
京セラ	52	46	326,048
太陽誘電	26	23	151,340
村田製作所	—	18.4	161,368
S C R E E Nホールディングス	5.2	4.6	53,820
キヤノン	39	34.5	90,976

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リコー	26	23	23,161
東京エレクトロン	26	23	1,422,320
輸送用機器 (4.7%)			
デンソー	26	23	199,962
三井E&Sホールディングス	2.6	—	—
川崎重工業	2.6	2.3	4,565
日産自動車	26	23	12,567
いすゞ自動車	13	11.5	17,077
トヨタ自動車	26	115	235,980
日野自動車	26	23	22,287
三菱自動車工業	2.6	2.3	759
マツダ	5.2	4.6	4,204
本田技研工業	52	46	146,510
スズキ	26	23	105,731
S U B A R U	26	23	48,012
ヤマハ発動機	26	23	68,080
精密機器 (3.7%)			
テルモ	104	92	430,376
ニコン	26	23	27,209
オリンパス	104	92	224,710
シチズン時計	26	23	11,845
その他製品 (2.8%)			
バンダイナムコホールディングス	26	23	206,747
凸版印刷	13	11.5	22,080
大日本印刷	13	11.5	31,843
ヤマハ	26	23	134,320
任天堂	—	2.3	123,740
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	2.6	2.3	703
中部電力	2.6	2.3	2,757
関西電力	2.6	2.3	2,449
東京瓦斯	5.2	4.6	9,177
大阪瓦斯	5.2	4.6	8,606
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	5.2	4.6	12,079
東急	13	11.5	18,170
小田急電鉄	13	11.5	24,794
京王電鉄	5.2	4.6	23,184
京成電鉄	13	11.5	36,340
東日本旅客鉄道	2.6	2.3	16,307
西日本旅客鉄道	2.6	2.3	11,617
東海旅客鉄道	2.6	2.3	36,903

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本通運	2.6	2.3	15,525
ヤマトホールディングス	26	23	62,629
海運業 (0.3%)			
日本郵船	2.6	2.3	18,676
商船三井	2.6	2.3	17,986
川崎汽船	2.6	2.3	15,732
空運業 (0.0%)			
A N Aホールディングス	2.6	2.3	5,469
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	13	11.5	33,258
情報・通信業 (10.6%)			
ネクソン	52	46	103,730
Zホールディングス	10.4	9.2	6,573
トレンドマイクロ	26	23	156,630
スカパーJ S A Tホールディングス	2.6	—	—
日本電信電話	10.4	9.2	28,391
K D D I	156	138	460,092
ソフトバンク	26	23	34,270
東宝	2.6	2.3	11,569
エヌ・ティ・ティ・データ	130	115	274,735
コナミホールディングス	26	23	135,010
ソフトバンクグループ	156	138	761,484
卸売業 (2.2%)			
双日	2.6	2.3	3,792
伊藤忠商事	26	23	79,580
丸紅	26	23	24,092
豊田通商	26	23	114,080
三井物産	26	23	59,110
住友商事	26	23	37,697
三菱商事	26	23	81,466
小売業 (9.9%)			
J. フロント リテイリング	13	11.5	11,097
三越伊勢丹ホールディングス	26	23	18,607
セブン&アイ・ホールディングス	26	23	114,333
高島屋	13	11.5	12,040
丸井グループ	26	23	50,646
イオン	26	23	64,158
ファーストリテイリング	26	23	1,564,000
銀行業 (0.5%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	26	23	9,729
新生銀行	2.6	2.3	4,301
あおぞら銀行	2.6	2.3	5,899

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UFJフィナンシャル・グループ	26	23	14,421
りそなホールディングス	2.6	2.3	1,005
三井住友トラスト・ホールディングス	2.6	2.3	8,799
三井住友フィナンシャルグループ	2.6	2.3	8,887
千葉銀行	26	23	15,479
ふくおかフィナンシャルグループ	5.2	4.6	8,712
静岡銀行	26	23	19,067
みずほフィナンシャルグループ	2.6	2.3	3,326
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	26	23	15,111
野村ホールディングス	26	23	11,585
松井証券	26	23	18,124
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	6.5	4.6	22,701
MS&ADインシュアランスグループホール	7.8	6.9	23,342
第一生命ホールディングス	2.6	2.3	5,518
東京海上ホールディングス	13	11.5	69,575
T&Dホールディングス	5.2	4.6	6,688
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	26	23	26,864
日本取引所グループ	26	23	55,016

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 (1.1%)			
東急不動産ホールディングス	26	23	13,869
三井不動産	26	23	54,912
三菱地所	26	23	36,087
東京建物	13	11.5	19,354
住友不動産	26	23	79,396
サービス業 (6.3%)			
エムスリー	62.4	55.2	320,877
ディー・エヌ・エー	7.8	6.9	11,999
電通グループ	26	23	91,770
サイバーエージェント	5.2	18.4	36,505
楽天グループ	26	23	26,335
リクルートホールディングス	78	69	476,859
日本郵政	26	23	20,267
セコム	26	23	179,170
合 計	株数・金額 4,717	4,298	18,557,894
	銘柄数<比率>	225	225 <97.1%>

*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 539	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	18,557,894	95.3
コール・ローン等、その他	906,671	4.7
投資信託財産総額	19,464,565	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 (2021年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,464,565,497
コール・ローン等	870,455,099
株式(評価額)	18,557,894,080
未収入金	10,470,318
未収配当金	2,256,000
差入委託証拠金	23,490,000
(B) 負債	347,138,867
未払収益分配金	268,299,126
未払解約金	66,000
未払信託報酬	78,446,679
未払利息	262
その他未払費用	326,800
(C) 純資産総額(A-B)	19,117,426,630
元本	14,756,451,970
次期繰越損益金	4,360,974,660
(D) 受益権総口数	44,716,521,115口
1千口当たり基準価額(C/D)	428円

(注) 期首元本額は15,863,699,411円、期中追加設定元本額は234,330,743円、期中一部解約元本額は1,341,578,184円、1口当たり純資産額は0.4280円です。

○損益の状況 (2020年12月11日～2021年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	318,748,498
受取配当金	318,842,402
受取利息	△ 4
その他収益金	90,585
支払利息	△ 184,485
(B) 有価証券売買損益	1,118,012,192
売買益	2,810,195,744
売買損	△ 1,692,183,552
(C) 先物取引等取引損益	22,071,623
取引益	99,930,934
取引損	△ 77,859,311
(D) 信託報酬等	△ 159,466,191
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,299,366,122
(F) 前期繰越損益金	7,057,472,038
(G) 追加信託差損益金	△ 3,727,564,374
(配当等相当額)	(14,167,729,253)
(売買損益相当額)	(△17,895,293,627)
(H) 計(E+F+G)	4,629,273,786
(I) 収益分配金	△ 268,299,126
次期繰越損益金(H+I)	4,360,974,660
追加信託差損益金	△ 3,727,564,374
(配当等相当額)	(14,167,729,253)
(売買損益相当額)	(△17,895,293,627)
分配準備積立金	8,088,539,034

* 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(2020年12月11日～2021年12月10日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年12月11日～ 2021年12月10日
a. 配当等収益(経費控除後)	283,905,135円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,015,460,987円
c. 信託約款に定める収益調整金	14,167,729,253円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,057,472,038円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	22,524,567,413円
f. 分配対象収益(1千口当たり)	503円
g. 分配金	268,299,126円
h. 分配金(1千口当たり)	6円

○分配金のお知らせ

1千口当たり分配金（税込み）	6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。