

野村 日経225 オープン

運用報告書(全体版)

第20期（決算日2017年2月15日）

作成対象期間（2016年2月16日～2017年2月15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。
なお、当ファンドは、運用開始以来永らくご愛顧いただきましたが、2018年2月15日に信託期間満了となります。
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	1997年9月8日から2018年2月15日までです。
運 用 方 針	日経平均株価（日経225）と連動する投資成果を目標として運用を行います。株式への投資にあたっては、日経平均株価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、原則として高位に保ちます。
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・配当収入と売買益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、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	み 金 騰 落	中 率	日経平均株価 (日経225)	期 騰 落 中 率			
	円	円	%		円	%	%	%	百万円
16期(2013年2月15日)	5,542	50	22.3		11,173	20.7	97.1	2.7	7,474
17期(2014年2月17日)	7,144	65	30.1		14,393	28.8	94.2	5.6	6,227
18期(2015年2月16日)	8,926	85	26.1		18,004	25.1	93.9	5.9	4,883
19期(2016年2月15日)	7,947	75	△10.1		16,023	△11.0	82.1	17.3	2,489
20期(2017年2月15日)	9,669	95	22.9		19,438	21.3	79.5	20.5	2,572

* 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 騰 落 率	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		日経平均株価 (日経225)	騰 落 率		
(期 首)	円	円	%	%	%
2016年2月15日	7,947	16,023	－	82.1	17.3
2月末	7,950	16,027	0.0	82.1	17.3
3月末	8,378	16,759	5.4	81.3	18.5
4月末	8,311	16,666	4.6	81.6	18.3
5月末	8,607	17,235	8.3	96.8	3.2
6月末	7,785	15,576	△2.0	96.7	3.3
7月末	8,277	16,569	4.2	96.7	2.9
8月末	8,436	16,887	6.2	82.6	17.3
9月末	8,271	16,450	4.1	87.5	12.1
10月末	8,756	17,425	10.2	87.9	12.1
11月末	9,199	18,308	15.8	89.6	10.4
12月末	9,609	19,114	20.9	96.7	3.2
2017年1月末	9,561	19,041	20.3	78.8	21.2
(期 末)					
2017年2月15日	9,764	19,438	22.9	79.5	20.5

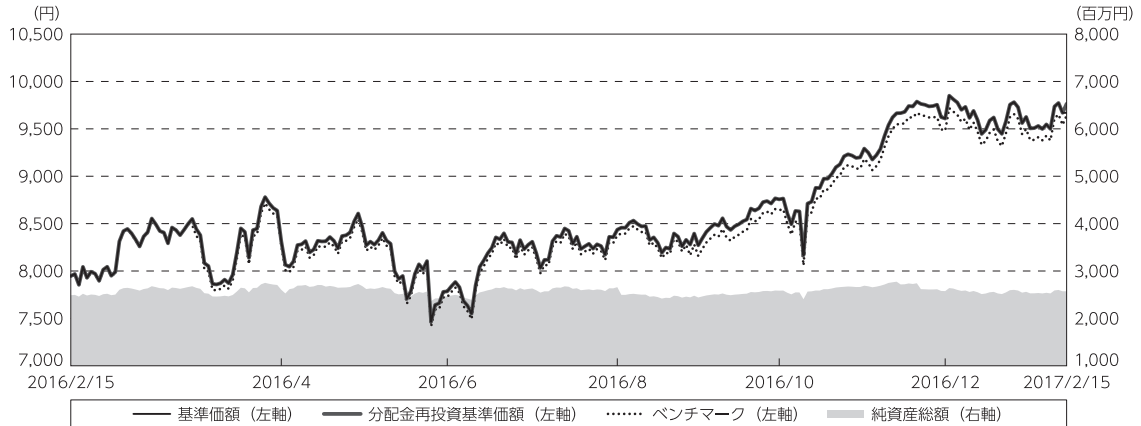
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

- ①「日経平均株価」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、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」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「日経平均株価」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 オープン」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 オープン」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、「日経平均株価」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、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」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：7,947円

期 末：9,764円 (既払分配金 (税込み)：95円)

騰落率：22.9% (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 (2016年2月15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 (2016年2月15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7,947円から期末9,764円 (分配金込み) に1,817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

期首から2016年8月まで、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、株式市場は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、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。

○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採用銘柄の入れ替え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+22.9%となり、ベンチマークである日経平均株価の+21.3%を1.6ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

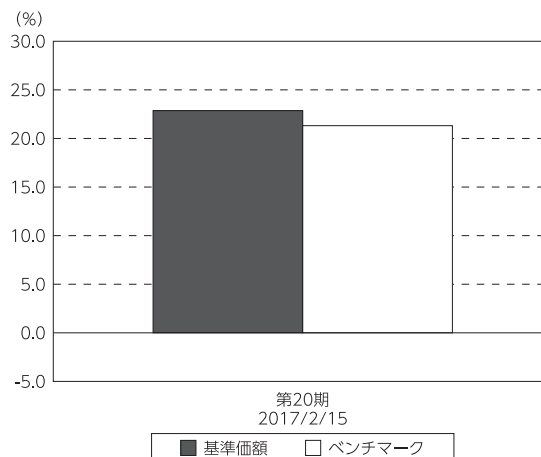
（プラス要因）

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

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口当たり・税込み)

項 目	第20期
	2016年2月16日～ 2017年2月15日
当期分配金	95
(対基準価額比率)	0.973%
当期の収益	95
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,130

(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

今後も、日経平均株価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。
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口当たりの費用明細

(2016年2月16日～2017年2月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 67	% 0.778	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(26)	(0.302)	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)	(36)	(0.421)	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)	(5)	(0.054)	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	0.011	(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)	(1)	(0.011)	
(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	68	0.792	
期中の平均基準価額は、8,595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2月16日～2017年2月15日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		236	488,294	432	940,688
		(△ 63)	(ー)		

*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	百万円	百万円	百万円
		2,666	2,635	—	—

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年2月16日～2017年2月15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	1,428,982千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,278,616千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.62

* (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2月16日～2017年2月15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 488	百万円 1	% 0.2	百万円 940	百万円 2	% 0.2

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
	百万円	百万円	百万円
株式	0.44364	1	3

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)	286千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.456千円
(B) / (A)	0.2%

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。

○組入資産の明細

(2017年2月15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	5	4	2,304
マルハニチロ	0.5	0.4	1,314
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	2	1.6	1,824
建設業 (2.7%)			
コムシスホールディングス	5	4	8,140
大成建設	5	4	3,260
大林組	5	4	4,300
清水建設	5	4	4,212
長谷工コーポレーション	1	0.8	1,044
鹿島建設	5	4	2,976
大和ハウス工業	5	4	12,528
積水ハウス	5	4	7,392
日揮	5	4	8,108
千代田化工建設	5	4	2,944
食料品 (4.8%)			
日清製粉グループ本社	5	4	6,700
明治ホールディングス	1	0.8	7,032

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ハム	5	4	12,320
サッポロホールディングス	5	0.8	2,276
アサヒグループホールディングス	5	4	15,688
キリンホールディングス	5	4	7,412
宝ホールディングス	5	4	4,396
キッコーマン	5	4	13,640
味の素	5	4	9,054
ニチレイ	5	2	5,062
日本たばこ産業	5	4	14,984
繊維製品 (0.3%)			
東洋紡	5	4	776
ユニチカ	5	4	360
帝人	5	0.8	1,742
東レ	5	4	3,955
パルプ・紙 (0.3%)			
王子ホールディングス	5	4	2,108
日本製紙	0.5	0.4	804
北越紀州製紙	5	4	3,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (8.8%)			
クラレ	5	4	6,868
旭化成	5	4	4,414
昭和電工	5	0.4	803
住友化学	5	4	2,516
日産化学工業	5	4	15,920
日本曹達	5	—	—
東ソー	5	4	3,952
トクヤマ	5	4	2,292
デンカ	5	4	2,460
信越化学工業	5	4	38,872
三井化学	5	4	2,160
三菱ケミカルホールディングス	2.5	2	1,679
宇部興産	5	4	1,112
日本化薬	5	4	6,312
花王	5	4	22,760
富士フイルムホールディングス	5	4	17,648
資生堂	5	4	11,562
日東電工	5	4	39,096
医薬品 (7.8%)			
協和発酵キリン	5	4	6,564
武田薬品工業	5	4	20,772
アステラス製薬	25	20	30,900
大日本住友製薬	5	4	7,924
塩野義製薬	5	4	21,976
中外製薬	5	4	15,220
エーザイ	5	4	24,788
第一三共	5	4	10,380
大塚ホールディングス	—	4	20,976
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	5	4	4,404
J Xホールディングス	5	4	2,156
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	2.5	2	4,130
ブリヂストン	5	4	17,124
ガラス・土石製品 (1.6%)			
旭硝子	5	4	3,704
日本板硝子	5	0.4	347
日本電気硝子	8	6	4,236
住友大阪セメント	5	4	1,828

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
太平洋セメント	5	4	1,680
東海カーボン	5	4	1,940
TOTO	2.5	2	8,520
日本碍子	5	4	9,868
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	0.5	0.4	1,130
神戸製鋼所	5	0.4	444
ジェイ エフ イー ホールディングス	0.5	0.4	856
日新製鋼	0.5	0.4	631
大平洋金属	5	4	1,596
非鉄金属 (1.5%)			
日本軽金属ホールディングス	5	4	1,152
三井金属鉱業	5	4	1,552
東邦亜鉛	5	4	2,516
三菱マテリアル	5	0.4	1,564
住友金属鉱山	5	4	6,634
DOWAホールディングス	5	4	3,956
古河機械金属	5	4	968
古河電気工業	5	0.4	1,632
住友電気工業	5	4	7,542
フジクラ	5	4	3,396
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	0.5	0.4	692
東洋製罐グループホールディングス	5	4	8,520
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	5	0.8	1,660
オークマ	5	4	4,860
アマダホールディングス	5	4	5,264
小松製作所	5	4	11,416
住友重機械工業	5	4	3,320
日立建機	5	4	10,904
クボタ	5	4	7,292
荏原製作所	5	0.8	2,708
ダイキン工業	5	4	44,000
日本精工	5	4	6,520
NTN	5	4	2,200
ジェイテクト	5	4	7,532
日立造船	1	0.8	511
三菱重工業	5	4	1,823
IHI	5	4	1,364

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気機器 (17.7%)			
日清紡ホールディングス	5	4	4,548
コニカミノルタ	5	4	4,476
ミネベアミツミ	5	4	5,836
日立製作所	5	4	2,564
東芝	5	4	838
三菱電機	5	4	6,828
富士電機	5	4	2,576
安川電機	5	4	8,636
明電舎	5	4	1,544
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5	4	1,992
日本電気	5	4	1,084
富士通	5	4	2,603
沖電気工業	5	0.4	642
パナソニック	5	4	5,100
シャープ	5	—	—
ソニー	5	4	14,380
TDK	5	4	31,480
ミツミ電機	5	—	—
アルプス電気	5	4	13,660
パイオニア	5	4	956
横河電機	5	4	7,040
アドバンテスト	10	8	16,088
カシオ計算機	5	4	6,216
ファナック	5	4	90,240
京セラ	10	8	50,192
太陽誘電	5	4	6,180
S C R E E Nホールディングス	5	0.8	6,192
キャノン	7.5	6	19,938
リコー	5	4	4,048
東京エレクトロン	5	4	46,200
輸送用機器 (6.7%)			
デンソー	5	4	20,304
三井造船	5	4	712
川崎重工業	5	4	1,468
日産自動車	5	4	4,508
いすゞ自動車	2.5	2	3,120
トヨタ自動車	5	4	25,964
日野自動車	5	4	5,400
三菱自動車工業	0.5	0.4	278

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マツダ	1	0.8	1,288
本田技研工業	10	8	29,048
スズキ	5	4	17,892
富士重工業	5	4	17,532
ヤマハ発動機	—	4	10,408
精密機器 (2.8%)			
テルモ	10	8	31,480
ニコン	5	4	6,576
オリンパス	5	4	16,080
シチズン時計	5	4	2,896
その他製品 (1.0%)			
凸版印刷	5	4	4,548
大日本印刷	5	4	4,848
ヤマハ	5	4	11,808
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	0.5	0.4	171
中部電力	0.5	0.4	599
関西電力	0.5	0.4	492
東京瓦斯	5	4	2,073
大阪瓦斯	5	4	1,731
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	5	4	2,288
東京急行電鉄	5	4	3,360
小田急電鉄	5	2	4,556
京王電鉄	5	4	3,620
京成電鉄	5	2	5,360
東日本旅客鉄道	0.5	0.4	4,152
西日本旅客鉄道	0.5	0.4	2,932
東海旅客鉄道	0.5	0.4	7,422
日本通運	5	4	2,348
ヤマトホールディングス	5	4	9,434
海運業 (0.2%)			
日本郵船	5	4	972
商船三井	5	4	1,472
川崎汽船	5	4	1,188
空運業 (0.1%)			
A N Aホールディングス	5	4	1,314
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	5	4	6,468

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
情報・通信業 (11.8%)			
ヤフー	2	1.6	856
トレンドマイクロ	5	4	17,560
スカパー J S A Tホールディングス	0.5	0.4	196
日本電信電話	1	0.8	3,813
KDD I	30	24	71,208
N T T ドコモ	0.5	0.4	1,072
東宝	0.5	0.4	1,284
エヌ・ティ・ティ・データ	5	4	21,760
コナミホールディングス	5	4	18,780
ソフトバンクグループ	15	12	104,040
卸売業 (2.3%)			
双日	0.5	0.4	118
伊藤忠商事	5	4	6,454
丸紅	5	4	2,917
豊田通商	5	4	13,520
三井物産	5	4	6,832
住友商事	5	4	6,020
三菱商事	5	4	10,604
小売業 (10.8%)			
J. フロント リテイリング	2.5	2	3,378
三越伊勢丹ホールディングス	5	4	5,628
セブン&アイ・ホールディングス	5	4	17,820
ユニー・ファミリーマートホールディングス	—	4	29,280
高島屋	5	4	3,976
丸井グループ	5	4	6,308
イオン	5	4	6,698
ユニーグループ・ホールディングス	5	—	—
ファーストリテイリング	5	4	148,200
銀行業 (1.1%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	4	2,475
新生銀行	5	4	828
あおぞら銀行	5	4	1,668
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5	4	3,074
りそなホールディングス	0.5	0.4	249
三井住友トラスト・ホールディングス	5	0.4	1,687
三井住友フィナンシャルグループ	0.5	0.4	1,830

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千葉銀行	5	4	3,088
横浜銀行	5	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	5	4	2,020
静岡銀行	5	4	4,040
みずほフィナンシャルグループ	5	4	843
証券・商品先物取引業 (0.5%)			
大和証券グループ本社	5	4	2,878
野村ホールディングス	5	4	3,044
松井証券	5	4	3,780
保険業 (1.1%)			
S O M P Oホールディングス	1.3	1	4,237
MS&ADインシュアランスグループホール	1.5	1.2	4,723
ソニーフィナンシャルホールディングス	1	0.8	1,633
第一生命ホールディングス	0.5	0.4	890
東京海上ホールディングス	2.5	2	10,036
T & Dホールディングス	1	0.8	1,458
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	5	4	8,692
不動産業 (1.9%)			
東急不動産ホールディングス	5	4	2,648
三井不動産	5	4	10,842
三菱地所	5	4	9,166
東京建物	2.5	2	3,244
住友不動産	5	4	13,112
サービス業 (3.3%)			
ディー・エヌ・エー	1.5	1.2	2,988
電通	5	4	23,280
楽天	—	4	4,308
東京ドーム	5	2	2,164
セコム	5	4	33,764
合 計	株 数 ・ 金 額	1,053	793
	銘柄数<比率>	225	225
			2,044,953
			<79.5%>

*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225mini	百万円 526	百万円 —

* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年2月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,044,953	% 78.4
コール・ローン等、その他	562,749	21.6
投資信託財産総額	2,607,702	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2月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,607,702,990
コール・ローン等	531,393,166
株式(評価額)	2,044,953,400
未収入金	4,689,424
未収配当金	3,808,000
差入委託証拠金	22,859,000
(B) 負債	35,369,181
未払収益分配金	25,272,470
未払信託報酬	10,054,408
未払利息	468
その他未払費用	41,835
(C) 純資産総額(A－B)	2,572,333,809
元本	2,660,260,000
次期繰越損益金	△ 87,926,191
(D) 受益権総口数	266,026口
1口当たり基準価額(C／D)	9,669円

(注) 期首元本額は3,132,080,000円、期中追加設定元本額は120,000,000円、期中一部解約元本額は591,820,000円、1口当たり純資産額は9,669円です。

○損益の状況 (2016年2月16日～2017年2月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	37,653,572
受取配当金	37,746,089
受取利息	101
その他収益金	4,719
支払利息	△ 97,337
(B) 有価証券売買損益	405,792,932
売買益	503,457,913
売買損	△ 97,664,981
(C) 先物取引等取引損益	58,957,277
取引益	83,470,462
取引損	△ 24,513,185
(D) 信託報酬等	△ 20,140,407
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	482,263,374
(F) 前期繰越損益金	486,727,654
(G) 追加信託差損益金	△1,031,644,749
(配当等相当額)	(1,219,125,841)
(売買損益相当額)	(△2,250,770,590)
(H) 計(E＋F＋G)	△ 62,653,721
(I) 収益分配金	△ 25,272,470
次期繰越損益金(H＋I)	△ 87,926,191
追加信託差損益金	△1,031,644,749
(配当等相当額)	(1,219,125,841)
(売買損益相当額)	(△2,250,770,590)
分配準備積立金	943,718,558

* 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(2016年2月16日～2017年2月15日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年2月16日～ 2017年2月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	36,145,056円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	190,407,841円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,219,125,841円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	742,438,131円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	2,188,116,869円
f. 分配対象収益(1口当たり)	8,225円
g. 分配金	25,272,470円
h. 分配金(1口当たり)	95円

○分配金のお知らせ

1 口当たり分配金（税込み）	95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。