

京都・滋賀インデックス ファンド

(愛称:京 (みやこ) ファンド)

運用報告書(全体版)

第10期 (決算日2015年10月26日)

作成対象期間 (2014年10月28日～2015年10月26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11月10日から2020年10月26日（当初、2015年10月25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京都・滋賀インデックス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、京都府及び滋賀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)	税 込 配 分			ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	期 騰 落 率	京 都 ・ 滋 賀 イン デ ッ ク ス	期 騰 落 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
6期(2011年10月25日)	6,312		50	△19.2	55.28	△20.3	97.8	—	4,365
7期(2012年10月25日)	5,842		40	△6.8	50.96	△7.8	97.8	—	3,544
8期(2013年10月25日)	8,627		80	49.0	76.19	49.5	97.8	—	4,748
9期(2014年10月27日)	9,830		95	15.0	87.46	14.8	97.9	—	4,138
10期(2015年10月26日)	13,309		130	36.7	120.02	37.2	97.9	—	3,985

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 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	騰 落 率	ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			京 都 ・ 滋 賀 イン デ ッ ク ス	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2014年10月27日	9,830	—	87.46	—	97.9	—
10月末	10,417	6.0	92.84	6.1	97.6	—
11月末	11,302	15.0	100.95	15.4	97.5	—
12月末	11,124	13.2	99.33	13.6	97.9	—
2015年1月末	10,894	10.8	97.32	11.3	97.1	—
2月末	11,816	20.2	105.81	21.0	98.0	—
3月末	12,809	30.3	114.33	30.7	96.9	—
4月末	13,324	35.5	119.09	36.2	97.5	—
5月末	14,200	44.5	127.11	45.3	97.1	—
6月末	13,980	42.2	125.08	43.0	97.7	—
7月末	14,065	43.1	125.96	44.0	98.0	—
8月末	13,495	37.3	120.84	38.2	97.8	—
9月末	11,992	22.0	106.61	21.9	96.6	—
(期 末)						
2015年10月26日	13,439	36.7	120.02	37.2	97.9	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

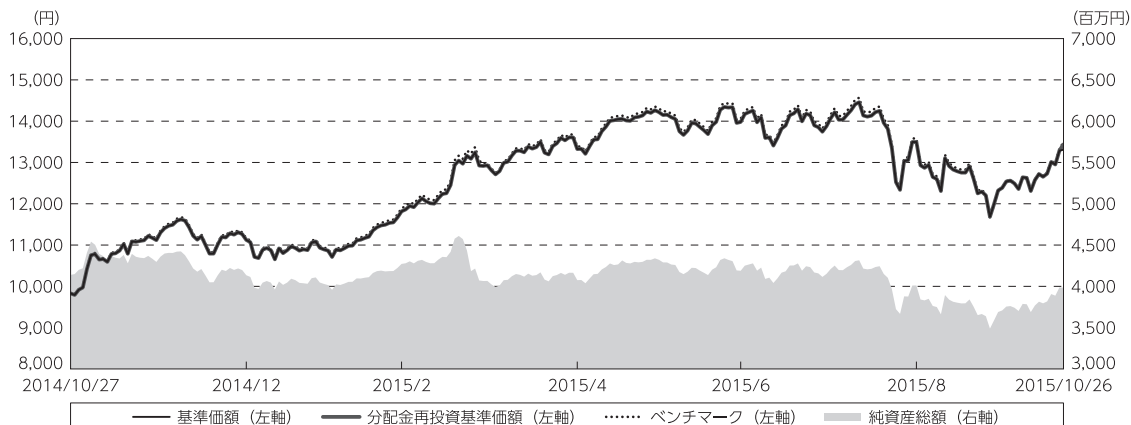
* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

※「京都・滋賀インデックス」は、京都府及び滋賀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、野村證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證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：9,830円

期 末：13,309円 (既払分配金(税込み)：130円)

騰落率：36.7% (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(2014年10月27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、京都・滋賀インデックスです。ベンチマークは、作成期首(2014年10月27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9,830円から期末13,439円(分配金込み)に3,609円の値上がりとなりました。

企業業績拡大への期待感が膨らんだことを受け、基準価額は上昇しました。

○投資環境

期首から2015年8月中旬にかけては、実質GDP(国内総生産)成長率が市場予想を上回ったことや、一段と円安が進み国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだこと、主要指数採用銘柄である任天堂がDeNAとの業務・資本提携を発表し株価が上昇したことを受け、京都・滋賀インデックスは上昇しました。

8月中旬以降は、中国や新興国への景気減速への懸念が高まったことなどから、企業収益への不安につながり大きく下落しました。

また10月以降は、世界的に金融緩和政策が継続されるだろうとの期待が投資家の間に広まったことから上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式組入比率は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

京都・滋賀インデックスの動きに連動した投資成果を目指すため、京都・滋賀インデックス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+36.7%となり、ベンチマークである京都・滋賀インデックスの+37.2%を0.5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（特に2015年3月、9月に大きく作用）

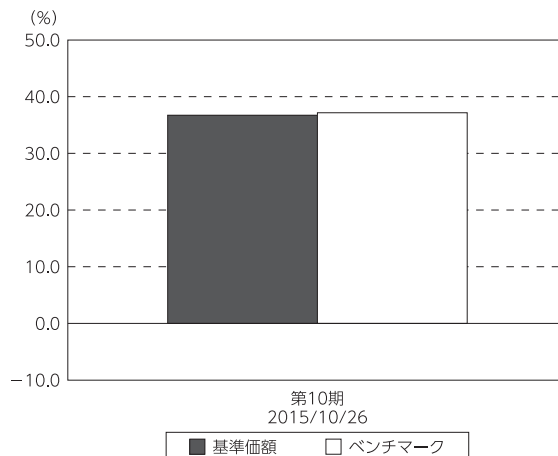
(マイナス要因)

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) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、京都・滋賀インデックスです。

◎分配金

収益分配金は、経費控除後の配当等収益や基準価額水準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10期
	2014年10月28日～ 2015年10月26日
当期分配金	130
(対基準価額比率)	0.967%
当期の収益	130
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,529

(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、京都・滋賀インデックスに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 万口当たりの費用明細

(2014年10月28日～2015年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 121	% 0.969	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(50)	(0.404)	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)	(64)	(0.512)	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)	(7)	(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	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)	(0.001)	
(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	121	0.973	
期中の平均基準価額は、12,451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

(2014年10月28日～2015年10月26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		75	151,202	684	1,644,537
		(8)	(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。

○株式売買比率

(2014年10月28日～2015年10月26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	1,795,740千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,030,877千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.44

* (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

(2014年10月28日～2015年10月26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 151	百万円 6	% 4.0	百万円 1,644	百万円 36	% 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 未 保 有 額
株式	百万円 0.08149	百万円 2	百万円 6

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

(2015年10月26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
建設業 (0.5%)			
コムシスホールディングス	—	0.3	483
シード平和	—	0.3	454
大成建設	4	3	2,370
大林組	2	2	2,128
清水建設	2	2	2,092
長谷工コーポレーション	0.9	0.7	858
鹿島建設	3	2	1,394
大東建託	0.3	0.2	2,612
住友林業	—	0.2	293
大和ハウス工業	2.1	1.4	4,344
積水ハウス	2.2	1.5	2,940
食料品 (3.1%)			
日清製粉グループ本社	1.9	1.3	2,324
カルビー	2	1.4	6,139
明治ホールディングス	0.2	0.3	2,736
日本ハム	1	1	2,531
アサヒグループホールディングス	1.6	1.1	4,154
麒麟ホールディングス	3.4	2.2	3,735
宝ホールディングス	64.3	44.3	38,363
サントリー食品インターナショナル	2.5	1.7	8,270
日清食品ホールディングス	0.4	0.3	1,704
日本たばこ産業	16.4	11.3	47,787
ファーマフーズ	4.3	5.9	2,808
繊維製品 (1.7%)			
グンゼ	31	21	8,358
帝人	5	4	1,676
東レ	16	11	11,825
ワコールホールディングス	21	29	44,457
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	4	3	1,872
日本製紙	—	0.3	656
化学 (1.7%)			
旭化成	6	4	3,071

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭和電工	7	5	770
デンカ	3	2	1,116
エア・ウォーター	1	—	—
カネカ	—	1	1,049
三菱瓦斯化学	2	2	1,360
三井化学	5	3	1,374
三菱ケミカルホールディングス	4.5	3.1	2,314
積水化学工業	3	2	2,706
宇部興産	—	4	976
第一工業製薬	13	11	4,202
三洋化成工業	17	12	10,668
D I C	4	3	987
タカラバイオ	35.6	24.5	30,894
日東電工	1.2	0.8	6,434
医薬品 (3.8%)			
武田薬品工業	11.7	8	46,272
塩野義製薬	4.3	3	12,720
日本新薬	21	14	62,580
科研製薬	—	1.2	9,756
参天製薬	1.5	7	11,088
大塚ホールディングス	2.6	1.7	6,580
石油・石炭製品 (0.1%)			
J Xホールディングス	7.7	5.5	2,670
ゴム製品 (0.6%)			
ブリヂストン	7.5	5.2	22,984
ガラス・土石製品 (1.4%)			
日本電気硝子	118	84	50,148
TOTO	1	0.8	3,332
鉄鋼 (0.1%)			
神戸製鋼所	17	12	1,908
ジェイ エフ イー ホールディングス	2.1	1.5	2,997
日立金属	2	—	—
メタルアート	2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.2%)			
三井金属鉱業	—	2	524
三菱マテリアル	5	3	1,305
DOWAホールディングス	2	1	1,072
住友電気工業	5.6	3.9	6,713
金属製品 (0.3%)			
東洋製罐グループホールディングス	1.1	0.9	2,050
L I X I L グループ	1.9	1.3	3,415
ヤマシナ	42.4	29.3	1,728
日東精工	6	4	1,260
サンコール	5	3.5	2,285
日本発條	—	1.1	1,365
機械 (1.7%)			
小松製作所	7.3	4.9	10,030
日立建機	1.6	1.4	2,751
TOWA	7.4	5.1	3,264
クボタ	8	6	11,433
ダイキン工業	1.4	1	8,044
サムコ	1	0.8	746
フジテック	13.9	9.5	12,350
日本精工	3	2.3	3,256
ユースン精機	2.6	1.8	4,032
三菱重工業	22	17	10,677
電気機器 (49.1%)			
日立製作所	—	7	5,113
三菱電機	8	5	6,515
日本電産	69.7	49.2	455,641
第一精工	4.9	3.4	5,511
日新電機	32	22	17,380
オムロン	52.9	34.9	149,546
シライ電子工業	4.1	2.8	630
シーシーエス	1.2	0.8	1,022
ジーエス・ユアサ コーポレーション	107	74	39,072
エスケーエレクトロニクス	3.4	2.3	2,440
日本電気	9	8	3,304
富士通	5	4	2,414
パナソニック	11	8.3	11,781
京写	4	3	1,344

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アズビル	—	0.8	2,428
堀場製作所	12.6	8.7	41,064
オプテックス	2.5	1.7	3,855
ローム	26.1	18	113,400
京セラ	88	60.6	363,054
村田製作所	52.1	36.1	619,837
ニチコン	23.1	15.9	15,597
S C R E E Nホールディングス	75	52	35,880
キヤノン	6.6	4.5	17,154
輸送用機器 (0.9%)			
川崎重工業	12	9	4,500
ニチユ三菱フォークリフト	11	7.6	3,997
三菱自動車工業	20.8	14.3	14,428
ダイハツ工業	10.5	7.3	10,804
精密機器 (2.8%)			
島津製作所	74	51	94,452
HOYA	3.5	2.4	11,076
松風	2.4	1.6	2,556
その他製品 (18.5%)			
凸版印刷	2	2	2,132
大日本印刷	2	1	1,250
日本写真印刷	13.3	9.2	23,993
任天堂	41.9	28.9	693,889
電気・ガス業 (0.8%)			
関西電力	13.9	9.6	14,654
電源開発	0.5	0.4	1,558
大阪瓦斯	44	30	14,649
陸運業 (1.8%)			
西日本旅客鉄道	1.7	1.2	9,997
東海旅客鉄道	2.5	1.7	36,652
近鉄グループホールディングス	28	10	4,650
阪急阪神ホールディングス	31	11	8,591
京阪電気鉄道	14	10	8,460
日本通運	3	2	1,262
ヤマトホールディングス	1.4	0.9	2,334
海運業 (0.1%)			
日本郵船	5	4	1,304
商船三井	4	3	1,008

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	3	2	566
空運業 (0.2%)			
日本航空	1.1	0.8	3,592
A N Aホールディングス	11	8	2,896
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
中央倉庫	2.8	—	—
上組	1	1	1,052
情報・通信業 (2.2%)			
システム ディ	1	0.7	369
フェイス	3.5	1.2	1,675
野村総合研究所	0.7	0.55	2,717
オービック	—	0.1	623
ヤフー	17.9	12.3	6,174
トレンドマイクロ	0.4	0.3	1,390
日本オラクル	—	0.1	537
大塚商会	0.3	0.2	1,232
日本電信電話	1.8	4.9	22,417
KDD I	2.8	5.8	16,988
N T T ドコモ	6.9	4.4	10,285
東宝	0.6	0.4	1,230
エヌ・ティ・ティ・データ	0.9	0.6	3,654
ソフトバンクグループ	3.8	2.6	17,292
卸売業 (0.9%)			
ウライ	3	—	—
双日	3.9	2.7	715
アルフレッサ ホールディングス	0.7	0.5	1,121
メディカルホールディングス	0.8	0.5	1,028
たけびし	—	1.5	1,579
伊藤忠商事	5.2	3.6	5,556
丸紅	5.5	3.8	2,659
豊田通商	1.1	0.8	2,256
三井物産	5.6	3.9	6,011
住友商事	3.9	2.7	3,612
三菱商事	5.1	3.4	7,714
ムーンバット	8	1.1	1,008
サンリオ	0.3	—	—
小売業 (2.0%)			
ローソン	0.3	0.2	1,780

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エービーシー・マート	—	0.2	1,376
日本マクドナルドホールディングス	0.2	0.1	277
J. フロント リテイリング	2.1	1.4	2,741
三越伊勢丹ホールディングス	1.5	1	1,928
白鳩	—	0.8	416
オンリー	1.8	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	2.8	1.9	10,212
ソルハホールディングス	—	0.1	944
良品計画	0.1	0.1	2,327
ドンキホーテホールディングス	0.3	0.4	1,800
スギホールディングス	—	0.4	2,360
ファミリーマート	0.3	0.2	989
しまむら	0.1	0.1	1,392
高島屋	2	2	2,154
エイチ・ツー・オー リテイリング	—	0.9	2,128
ニッセンホールディングス	19.7	6.8	1,312
丸井グループ	2.1	1.3	1,989
イオン	2.7	1.9	3,395
平和堂	8.7	6	16,212
ヤマダ電機	3	2.1	1,176
ニトリホールディングス	0.4	0.2	1,886
王将フードサービス	3.4	2.4	9,564
ファーストリテイリング	0.3	0.2	8,800
サンドラッグ	—	0.1	637
銀行業 (1.7%)			
滋賀銀行	39	27	16,659
京都銀行	56	39	48,984
セブン銀行	3.7	2.6	1,437
証券・商品先物取引業 (0.3%)			
フューチャーベンチャーキャピタル	—	1.3	952
S B I ホールディングス	0.7	0.5	752
大和証券グループ本社	6	4	3,454
野村ホールディングス	12	8.3	6,547
保険業 (0.7%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1.3	0.9	3,573
MS & ADインシュアランスグループホール	2	1.4	5,108
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.4	0.9	2,047
第一生命保険	3.8	2.6	5,577

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京海上ホールディングス	2.4	1.6	7,668
T & Dホールディングス	2.1	1.5	2,454
その他金融業 (1.4%)			
クレディセゾン	0.6	0.4	1,000
アイフル	142.8	98.5	47,477
イオンフィナンシャルサービス	0.7	0.5	1,472
オリックス	4.2	2.9	5,343
三菱UFJリース	2.8	1.9	1,181
不動産業 (0.7%)			
ヒューリック	1.9	1.4	1,587
野村不動産ホールディングス	0.6	0.4	958
東急不動産ホールディングス	2	1.4	1,225
飯田グループホールディングス	0.9	0.6	1,330
パーク24	—	0.3	736
三井不動産	3	2	6,678
三菱地所	4	3	7,789
東京建物	1	0.5	767
住友不動産	1	1	4,121
レオパレス21	—	0.6	381
イオンモール	0.9	0.6	1,211
日本空港ビルデング	—	0.2	1,238

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サービス業 (0.6%)			
ミクシィ	—	0.2	900
アマタホールディングス	0.3	—	—
カカココム	0.7	0.5	1,114
エムスリー	—	0.7	1,697
ディー・エヌ・エー	0.5	0.3	727
博報堂DYホールディングス	—	0.8	987
電通	0.9	0.6	4,032
みらかホールディングス	0.3	0.2	1,064
ファルコホールディングス	1.8	1.1	1,646
リゾートトラスト	—	0.2	602
ワタベウエディング	1.5	—	—
ユー・エス・エス	1	0.7	1,467
サイバーエージェント	—	0.1	494
楽天	4.2	3.1	5,387
セコム	0.7	0.5	3,974
ベネッセホールディングス	0.3	0.2	644
合 計	株 数 ・ 金 額	2,033	1,433
	銘柄数<比率>	197	217
			<97.9%>

*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。

*一印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2015年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,901,032	96.2
コール・ローン等、その他	154,081	3.8
投資信託財産総額	4,055,113	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 (2015年10月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,055,113,742
コール・ローン等	135,461,158
株式(評価額)	3,901,032,770
未収配当金	18,619,560
未収利息	254
(B) 負債	69,959,752
未払収益分配金	38,927,102
未払解約金	11,277,165
未払信託報酬	19,689,912
その他未払費用	65,573
(C) 純資産総額(A－B)	3,985,153,990
元本	2,994,392,506
次期繰越損益金	990,761,484
(D) 受益権総口数	2,994,392,506口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,309円

(注) 期首元本額4,210百万円、期中追加設定元本額455百万円、期中一部解約元本額1,671百万円、計算口数当たり純資産額13,309円。

○損益の状況 (2014年10月28日～2015年10月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	49,602,484
受取配当金	49,515,894
受取利息	62,839
その他収益金	23,751
(B) 有価証券売買損益	950,154,309
売買益	1,325,876,921
売買損	△ 375,722,612
(C) 信託報酬等	△ 40,191,843
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	959,564,950
(E) 前期繰越損益金	82,333,922
(F) 追加信託差損益金	△ 12,210,286
(配当等相当額)	(952,288,508)
(売買損益相当額)	(△ 964,498,794)
(G) 計(D＋E＋F)	1,029,688,586
(H) 収益分配金	△ 38,927,102
次期繰越損益金(G＋H)	990,761,484
追加信託差損益金	△ 12,210,286
(配当等相当額)	(952,288,508)
(売買損益相当額)	(△ 964,498,794)
分配準備積立金	1,002,971,770

* 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(2014年10月28日～2015年10月26日)は以下の通りです。

項 目	第10期
	2014年10月28日～ 2015年10月26日
a. 配当等収益(経費控除後)	47,608,969円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	471,518,676円
c. 信託約款に定める収益調整金	952,288,508円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	522,771,227円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,994,187,380円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,659円
g. 分配金	38,927,102円
h. 分配金(1万口当たり)	130円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	130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

①運用報告書（全体版）について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

②デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年1月20日＞

③有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞