

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11期 (決算日2016年10月25日)

作成対象期間 (2015年10月27日～2016年10月25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)	騰 落 率			ベンチマーク 京都・滋賀インデックス		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	み 金	期 騰 落 中 率	期 騰 落	中 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
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
11期(2016年10月25日)	12,602		60	△ 4.9	113.25	△ 5.6	97.5	—	3,649

* 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

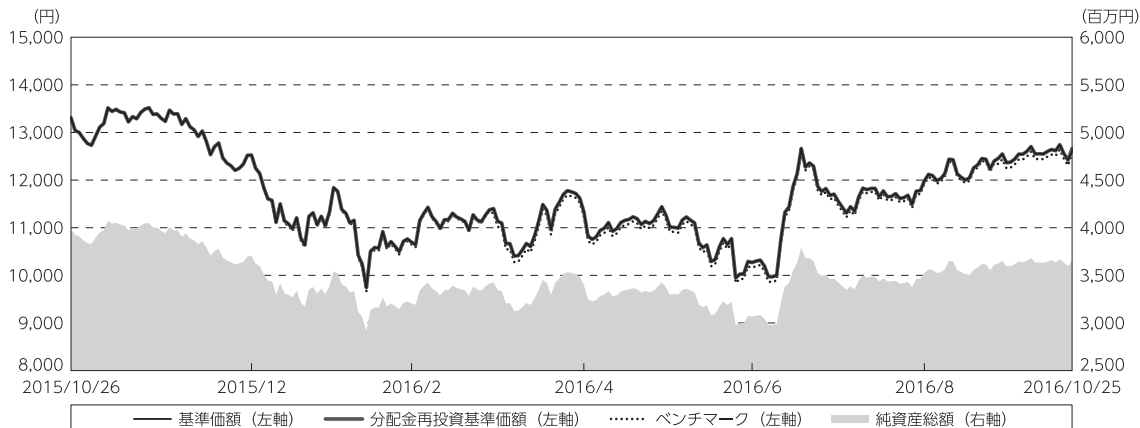
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		ベンチマーク 京都・滋賀インデックス	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		円	%				
(期 首) 2015年10月26日	13,309		—	120.02	—	97.9	—
10月末	12,768		△ 4.1	115.02	△ 4.2	97.5	—
11月末	13,233		△ 0.6	119.44	△ 0.5	97.6	—
12月末	12,525		△ 5.9	112.86	△ 6.0	97.3	—
2016年 1 月末	11,328		△14.9	101.85	△15.1	97.2	—
2 月末	10,696		△19.6	96.03	△20.0	97.2	—
3 月末	11,096		△16.6	99.04	△17.5	97.1	—
4 月末	11,338		△14.8	101.36	△15.6	97.6	—
5 月末	11,441		△14.0	102.37	△14.7	97.7	—
6 月末	10,269		△22.8	91.65	△23.6	97.7	—
7 月末	11,705		△12.1	104.83	△12.7	97.6	—
8 月末	11,983		△10.0	107.48	△10.5	97.5	—
9 月末	12,365		△ 7.1	110.46	△ 8.0	97.3	—
(期 末) 2016年10月25日	12,662		△ 4.9	113.25	△ 5.6	97.5	—

* 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。

※「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：13,309円

期 末：12,602円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：△4.9% (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(2015年10月26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(2015年10月26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13,309円から期末12,662円(分配金込み)に647円の値下がりとなりました。

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の結果や、主要指数採用銘柄の上昇などを受けて、一進一退の展開となりました。

○投資環境

期首の株式市場は、原油などの資源価格が総じて堅調に推移したことなどから横ばいで推移しました。しかし、日銀から金融政策の現状維持が発表されると、急激な円高と株安が進行し、2016年4月末にかけて株式市場は下落しました。

6月には英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票の世論調査で離脱派の比率が高まったことや日米の金融政策の現状維持が決定したことで、円高ドル安が進行して株式市場は下落しました。中旬以降は、英国のEU残留派が盛り返したとの報道などから反発する局面もありましたが、離脱派の勝利が決定したことを受け、株式市場ではリスクを避ける動きが鮮明となり下落となりました。

7月には米国株が過去最高値を更新したことや参議院議員選挙での与党勝利を受けて政府による大規模な景気対策への期待が高まったことなどから、株式市場は上昇しました。また、「ポケモンGO」の人気を背景に主要指数採用銘柄である任天堂の株価は急騰し、京都・滋賀インデックスを押し上げました。

○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－4.9%となり、ベンチマークである京都・滋賀インデックスの－5.6%を0.7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

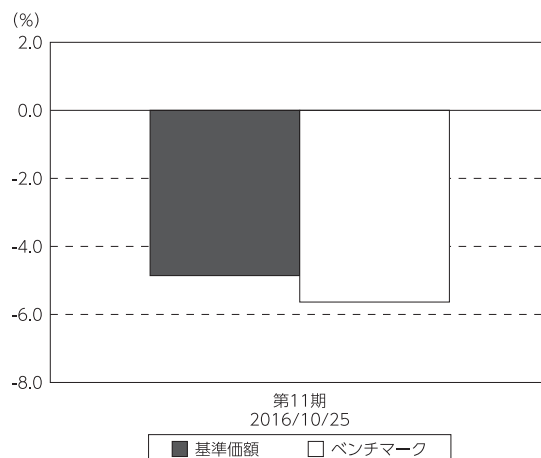
（マイナス要因）

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、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11期
	2015年10月27日～ 2016年10月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	60 0.474%
当期の収益	60
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	6,537

(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

(2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 114	% 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)	(47)	(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)	(60)	(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)	(6)	(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	0.000	(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)	
(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	114	0.972	
期中の平均基準価額は、11,728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10月27日～2016年10月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 135 (△ 86)	千円 220,703 (—)	千株 137	千円 350,444

* 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10月27日～2016年10月25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	571,148千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,401,561千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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10月27日～2016年10月25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	
		B A			D C	
預金	百万円 2,561	百万円 2,561	% 100.0	百万円 2,561	百万円 2,561	% 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
株式	百万円 0.21553	百万円 0.33468	百万円 4

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年10月25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	—	—
シート平和	0.3	—	—
大成建設	3	2	1,552
大林組	2	1.5	1,494
清水建設	2	2	1,838
長谷工コーポレーション	0.7	0.6	610
鹿島建設	2	2	1,390
大東建託	0.2	0.2	3,417
住友林業	0.2	—	—
大和ハウス工業	1.4	1.4	3,936
積水ハウス	1.5	1.5	2,535
きんでん	—	0.5	626
食料品 (2.7%)			
日清製粉グループ本社	1.3	1.3	2,057
山崎製パン	—	0.4	983
カルビー	1.4	1.3	4,979
明治ホールディングス	0.3	0.3	3,132
日本ハム	1	1	2,523
アサヒグループホールディングス	1.1	1	3,691
麒麟ホールディングス	2.2	2.2	3,826
宝ホールディングス	44.3	43.1	42,410
サントリー食品インターナショナル	1.7	1.7	7,650
日清食品ホールディングス	0.3	0.3	1,812
日本たばこ産業	11.3	5.5	21,153
ファーマフーズ	5.9	5.8	2,476
繊維製品 (1.0%)			
グンゼ	21	21	7,098
帝人	4	0.7	1,375
東レ	11	11	10,646
ワコールホールディングス	29	14	16,674
パルプ・紙 (0.0%)			
王子ホールディングス	3	2	876
日本製紙	0.3	0.3	587

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 (2.1%)			
旭化成	4	4	3,690
昭和電工	5	0.5	681
デンカ	2	2	926
エア・ウォーター	—	0.2	387
カネカ	1	1	853
三菱瓦斯化学	2	0.7	1,115
三井化学	3	3	1,551
三菱ケミカルホールディングス	3.1	3	2,022
積水化学工業	2	1.9	2,933
宇部興産	4	4	840
第一工業製薬	11	11	3,839
三洋化成工業	12	2.3	11,109
D I C	3	0.3	957
タカラバイオ	24.5	23.9	36,232
日東電工	0.8	0.8	5,932
医薬品 (4.0%)			
武田薬品工業	8	7.8	36,995
塩野義製薬	3	2.9	15,265
日本新薬	14	11.3	60,681
科研製薬	1.2	1.2	7,836
ロート製薬	—	1.5	2,685
参天製薬	7	6.8	10,234
大塚ホールディングス	1.7	1.6	7,278
石油・石炭製品 (0.1%)			
J Xホールディングス	5.5	5.4	2,222
ゴム製品 (0.6%)			
ブリヂストン	5.2	5	19,965
ガラス・土石製品 (1.4%)			
日本電気硝子	84	82	47,314
TOTO	0.8	0.8	3,328
鉄鋼 (0.1%)			
神戸製鋼所	12	1.1	932
ジェイ エフ イー ホールディングス	1.5	1.4	2,011

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	—	—
三菱マテリアル	3	0.3	851
DOWAホールディングス	1	1	758
住友電気工業	3.9	3.7	5,740
金属製品 (0.3%)			
東洋製罐グループホールディングス	0.9	0.9	1,686
L I X I L グループ	1.3	1.3	3,114
ヤマシナ	29.3	28.4	1,618
日東精工	4	4	1,592
サンコール	3.5	3.4	1,570
日本発條	1.1	1.1	1,080
機械 (2.1%)			
小松製作所	4.9	4.8	11,419
日立建機	1.4	1.3	2,753
TOWA	5.1	5	5,525
クボタ	6	5.6	9,203
ダイキン工業	1	1	9,875
サムコ	0.8	—	—
フジテック	9.5	18.6	22,078
日本精工	2.3	2.3	2,658
ユースン精機	1.8	1.8	4,417
三菱重工業	17	17	7,672
電気機器 (49.3%)			
日立製作所	7	7	3,693
三菱電機	5	5.3	7,441
日本電産	49.2	48	473,616
第一精工	3.4	3.3	3,870
日新電機	22	21.4	34,860
オムロン	34.9	33.4	126,252
シライ電子工業	2.8	2.8	932
シーシーエス	0.8	1.1	1,182
ジーエス・ユアサ コーポレーション	74	82	36,900
エスケーエレクトロニクス	2.3	2.3	2,451
日本電気	8	8	2,192
富士通	4	4	2,263
パナソニック	8.3	8.1	8,756
京写	3	3	921

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	—	—
堀場製作所	8.7	8.4	42,252
オブテックス	1.7	3.4	8,925
ローム	18	17.1	93,195
京セラ	60.6	59	304,204
村田製作所	36.1	35.1	505,440
ニチコン	15.9	15.5	13,733
S C R E E Nホールディングス	52	10.1	67,367
キャノン	4.5	4.4	13,525
輸送用機器 (0.7%)			
川崎重工業	9	9	2,700
ニチユ三菱フォークリフト	7.6	7.3	4,431
トヨタ自動車	—	1.8	10,873
三菱自動車工業	14.3	13.9	8,340
ダイハツ工業	7.3	—	—
精密機器 (2.5%)			
島津製作所	51	50	76,450
HOYA	2.4	2.2	9,086
松風	1.6	1.6	2,267
その他製品 (20.2%)			
凸版印刷	2	1	989
大日本印刷	1	1	1,045
日本写真印刷	9.2	8.9	22,178
任天堂	28.9	28.1	693,648
電気・ガス業 (0.6%)			
関西電力	9.6	9.3	8,887
電源開発	0.4	0.4	986
大阪瓦斯	30	29	12,896
陸運業 (1.3%)			
西日本旅客鉄道	1.2	1.1	7,234
東海旅客鉄道	1.7	0.9	15,579
西武ホールディングス	—	1.9	3,503
近鉄グループホールディングス	10	9	3,825
阪急阪神ホールディングス	11	2.1	7,308
京阪ホールディングス	10	9	6,318
日本通運	2	2	996
ヤマトホールディングス	0.9	0.9	2,135

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.1%)			
日本郵船	4	4	808
商船三井	3	3	762
川崎汽船	2	2	528
空運業 (0.1%)			
日本航空	0.8	0.8	2,464
A N Aホールディングス	8	7	1,981
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
上組	1	1	876
情報・通信業 (2.0%)			
T I S	—	0.2	550
ネクソン	—	0.9	1,534
システム ディ	0.7	0.6	491
フェイス	1.2	1.2	1,423
野村総合研究所	0.55	0.3	1,134
オービック	0.1	0.1	548
ヤフー	12.3	12	4,992
トレンドマイクロ	0.3	0.3	1,107
日本オラクル	0.1	—	—
トーセ	—	1.5	1,228
大塚商会	0.2	0.2	1,030
日本電信電話	4.9	2.2	10,247
KDD I	5.8	5.5	16,940
N T T ドコモ	4.4	4.2	10,623
東宝	0.4	0.2	632
エヌ・ティ・ティ・データ	0.6	0.6	3,264
S C S K	—	0.2	833
ソフトバンクグループ	2.6	2.5	16,327
卸売業 (0.8%)			
双日	2.7	2.6	712
アルフレッサ ホールディングス	0.5	0.5	1,085
メディカルホールディングス	0.5	0.5	892
たけびし	1.5	1.5	1,608
伊藤忠商事	3.6	3.5	4,457
丸紅	3.8	3.7	2,034
豊田通商	0.8	0.7	1,712
三井物産	3.9	3.8	5,510
住友商事	2.7	2.6	3,125

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱商事	3.4	3.4	8,124
ムーンバット	1.1	—	—
小売業 (1.9%)			
ローソン	0.2	0.2	1,592
エービーシー・マート	0.2	0.2	1,298
日本マクドナルドホールディングス	0.1	—	—
J. フロント リテイリング	1.4	1.4	2,003
マツモトキヨシホールディングス	—	0.1	535
スタートトゥデイ	—	0.7	1,284
三越伊勢丹ホールディングス	1	0.9	986
白鳩	0.8	0.8	418
セブン&アイ・ホールディングス	1.9	1.9	8,567
ソルハホールディングス	0.1	0.1	1,182
良品計画	0.1	0.1	2,254
ドンキホーテホールディングス	0.4	0.4	1,636
スギホールディングス	0.4	0.4	2,296
ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.2	0.3	1,977
青山商事	—	0.1	367
しまむら	0.1	0.1	1,333
高島屋	2	1	862
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.9	0.9	1,392
ニッセンホールディングス	6.8	6.6	442
丸井グループ	1.3	1.3	1,896
イオン	1.9	1.8	2,671
平和堂	6	5.8	12,533
ヤマダ電機	2.1	2	1,082
ニトリホールディングス	0.2	0.2	2,496
王将フードサービス	2.4	2.3	9,269
ファーストリテイリング	0.2	0.2	7,370
サンドラッグ	0.1	0.2	1,628
銀行業 (2.0%)			
滋賀銀行	27	26	13,728
京都銀行	39	75	57,150
セブン銀行	2.6	2.5	817
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
フューチャーベンチャーキャピタル	1.3	1.4	2,007
S B I ホールディングス	0.5	0.5	600
大和証券グループ本社	4	4	2,349

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村ホールディングス	8.3	8.1	4,004
保険業 (0.6%)			
SOMPOホールディングス	0.9	0.9	3,005
MS&ADインシュアランスグループホール	1.4	1.3	3,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	0.9	0.9	1,257
第一生命ホールディングス	2.6	2.5	3,691
東京海上ホールディングス	1.6	1.6	6,539
T&Dホールディングス	1.5	1.4	1,719
その他金融業 (1.1%)			
クレディセゾン	0.4	0.4	708
アイフル	98.5	96	30,144
イオンフィナンシャルサービス	0.5	0.5	896
アコム	—	3.4	1,618
オリックス	2.9	2.8	4,135
三菱UFJリース	1.9	1.9	932
不動産業 (0.7%)			
ヒューリック	1.4	1.4	1,432
野村不動産ホールディングス	0.4	0.4	719
東急不動産ホールディングス	1.4	1.4	810
飯田グループホールディングス	0.6	0.6	1,206
ハウスドゥ	—	1.7	2,267
パーク24	0.3	0.3	1,000
三井不動産	2	2	4,704
三菱地所	3	3	6,028
東京建物	0.5	0.5	653
住友不動産	1	1	2,739

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レオパレス21	0.6	—	—
イオンモール	0.6	0.6	933
日本空港ビルデング	0.2	0.2	796
サービス業 (0.8%)			
ミクシィ	0.2	—	—
テンプホールディングス	—	0.5	889
総合警備保障	—	0.2	1,056
カカココム	0.5	0.5	901
エムスリー	0.7	0.7	2,219
ディー・エヌ・エー	0.3	0.3	1,012
博報堂DYホールディングス	0.8	0.4	505
電通	0.6	0.6	3,114
みらかホールディングス	0.2	0.2	1,012
ファルコホールディングス	1.1	1.1	1,507
リゾートトラスト	0.2	0.2	427
ユー・エス・エス	0.7	0.3	530
サイバーエージェント	0.1	0.3	918
楽天	3.1	3	3,805
リクルートホールディングス	—	1.2	5,058
セコム	0.5	0.5	3,826
ベネッセホールディングス	0.2	0.2	552
合 計	株 数 ・ 金 額	1,433	1,344 3,559,234
	銘柄数<比率>	217	223 <97.5%>

*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。

○投資信託財産の構成

(2016年10月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,559,234	96.0
コール・ローン等、その他	148,716	4.0
投資信託財産総額	3,707,950	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10月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,707,950,101
コール・ローン等	129,217,611
株式(評価額)	3,559,234,230
未収配当金	19,498,260
(B) 負債	58,177,979
未払金	16,048,920
未払収益分配金	17,376,913
未払解約金	8,097,416
未払信託報酬	16,599,308
未払利息	158
その他未払費用	55,264
(C) 純資産総額(A－B)	3,649,772,122
元本	2,896,152,212
次期繰越損益金	753,619,910
(D) 受益権総口数	2,896,152,212口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,602円

(注) 期首元本額は2,994,392,506円、期中追加設定元本額は312,343,705円、期中一部解約元本額は410,583,999円、1口当たり純資産額は1.2602円です。

○損益の状況 (2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	51,513,488
受取配当金	51,494,351
受取利息	20,592
その他収益金	21,234
支払利息	△ 22,689
(B) 有価証券売買損益	△ 164,500,844
売買益	216,758,305
売買損	△ 381,259,149
(C) 信託報酬等	△ 33,763,597
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 146,750,953
(E) 前期繰越損益金	874,652,291
(F) 追加信託差損益金	43,095,485
(配当等相当額)	(1,018,342,159)
(売買損益相当額)	(△ 975,246,674)
(G) 計(D+E+F)	770,996,823
(H) 収益分配金	△ 17,376,913
次期繰越損益金(G+H)	753,619,910
追加信託差損益金	43,095,485
(配当等相当額)	(1,018,342,159)
(売買損益相当額)	(△ 975,246,674)
分配準備積立金	875,025,269
繰越損益金	△ 164,500,844

* 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(2015年10月27日～2016年10月25日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年10月27日～ 2016年10月25日
a. 配当等収益(経費控除後)	17,749,891円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,018,342,159円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	874,652,291円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,910,744,341円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,597円
g. 分配金	17,376,913円
h. 分配金(1万口当たり)	60円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	60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。