

JPX日経400ファンド

運用報告書(全体版)

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016年9月6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	2014年1月31日以降、無期限とします。	
運用方針	JPX日経400マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主な投資対象	JPX日経400ファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。なお、上場投資信託証券に投資する場合があります。
主な投資制限	JPX日経400ファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	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、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）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、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/>

○設定以来の運用実績

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	配 金	期 騰 落 中 率	JPX日経インデックス400	期 騰 落 中 率			
(設定日)	円		円	%		%	%	%	百万円
2014年 1 月31日	10, 000		—	—	11, 063. 66	—	—	—	1, 000
1 期(2014年9月8日)	10, 741		30	7. 7	11, 778. 63	6. 5	99. 1	0. 8	2, 304
2 期(2015年9月7日)	11, 872		85	11. 3	12, 977. 78	10. 2	97. 3	2. 7	6, 777
3 期(2016年9月6日)	11, 169		110	△ 5. 0	12, 160. 56	△ 6. 3	98. 2	1. 8	7, 894

* 基準価額の騰落率は分配金込み。
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

- ①「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）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、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属している。
- ③「JPX日経400ファンド」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び「JPX日経400ファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」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「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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。

○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
			JPX日経インデックス400	騰 落 率		
(期 首) 2015年9月7日	円 11,872	% —	12,977.78	% —	% 97.3	% 2.7
9月末	11,625	△ 2.1	12,628.54	△ 2.7	97.6	2.3
10月末	12,883	8.5	14,000.71	7.9	97.3	2.7
11月末	13,090	10.3	14,232.27	9.7	97.7	2.2
12月末	12,841	8.2	13,951.93	7.5	97.2	2.7
2016年1月末	11,888	0.1	12,917.43	△ 0.5	97.1	2.8
2月末	10,813	△ 8.9	11,755.65	△ 9.4	97.1	2.9
3月末	11,284	△ 5.0	12,161.79	△ 6.3	97.1	2.8
4月末	11,239	△ 5.3	12,124.68	△ 6.6	97.5	2.5
5月末	11,545	△ 2.8	12,453.26	△ 4.0	98.4	1.5
6月末	10,442	△12.0	11,250.20	△13.3	98.9	1.1
7月末	11,023	△ 7.2	11,879.95	△ 8.5	98.8	1.1
8月末	11,102	△ 6.5	11,967.56	△ 7.8	97.8	2.2
(期 末) 2016年9月6日	11,279	△ 5.0	12,160.56	△ 6.3	98.2	1.8

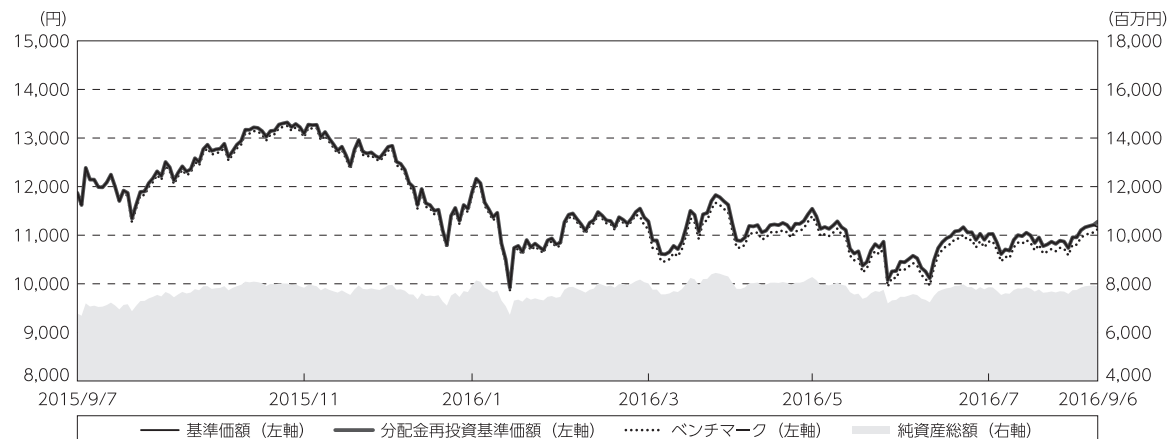
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組めますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：11,872円

期 末：11,169円 (既払分配金(税込み)：110円)

騰落率：△ 5.0% (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9月7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、JPX日経インデックス400です。ベンチマークは、作成期首(2015年9月7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11,872円から期末11,279円(分配金込み)に593円の値下がりとなりました。

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や円高の進行により企業業績への影響が懸念されたことなどから、基準価額は下落しました。

○投資環境

株式市場は、期首から2015年11月下旬まで、中国経済への懸念が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）総裁の追加金融緩和を示唆する発言など世界的な金融緩和継続の流れ、国内企業の決算への期待などを背景に上昇しました。

12月以降は、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。

○当ファンドのポートフォリオ

[JPX日経400ファンド]

主要投資対象である「JPX日経400マザーファンド」受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資し、実質株式組入比率を高位に維持しました。

[JPX日経400マザーファンド]

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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－5.0%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の－6.3%を1.3ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

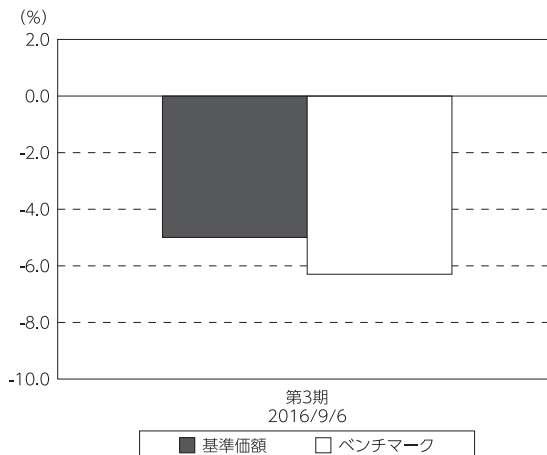
(プラス要因)

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、JPX 日経インデックス 400 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10,000口当たり110円とさせていただきます。

ま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 3 期
	2015年 9 月 8 日～ 2016年 9 月 6 日
当期分配金	110
(対基準価額比率)	0.975%
当期の収益	110
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,169

(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

〔JPX日経400ファンド〕

主要投資対象である〔JPX日経400マザーファンド〕受益証券を高位に組入れ、引き続き、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指します。

〔JPX日経400マザーファンド〕

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

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9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 66	% 0.571	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(30)	(0.258)	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)	(30)	(0.258)	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	2	0.015	(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)	(2)	(0.015)	
(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	0.589	
期中の平均基準価額は、11,647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。

* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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9月8日～2016年9月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
JPX日経400マザーファンド	千口 1,993,449	千円 2,385,589	千口 766,325	千円 939,673

* 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年9月8日～2016年9月6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
	JPX日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	9,609,833千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,952,972千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64

* (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9月8日～2016年9月6日)

利害関係人との取引状況

<JPX日経400ファンド>

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
預金	288	288	100.0	288	288	100.0

<JPX日経400マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	7,349	94	1.3	2,259	—	—
預金	10,505	10,505	100.0	10,505	10,505	100.0

平均保有割合 50.6%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<JPX日経400マザーファンド>

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	48	20	101

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)	1,163千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.143千円
(B) / (A)	0.0%

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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9月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
JPX日経400マザーファンド	5,600,167	6,827,291	7,894,397

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成
 (2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
JPX日経400マザーファンド	7,894,397	98.5
コール・ローン等、その他	119,691	1.5
投資信託財産総額	8,014,088	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9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,014,088,953
コール・ローン等	27,937,542
JPX日経400マザーファンド(評価額)	7,894,397,658
未収入金	91,753,753
(B) 負債	119,338,921
未払収益分配金	77,752,434
未払解約金	19,058,578
未払信託報酬	22,401,131
未払利息	40
その他未払費用	126,738
(C) 純資産総額(A－B)	7,894,750,032
元本	7,068,403,099
次期繰越損益金	826,346,933
(D) 受益権総口数	7,068,403,099口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,169円

(注) 期首元本額は5,708,557,496円、期中追加設定元本額は2,592,889,831円、期中一部解約元本額は1,233,044,228円、1口当たり純資産額は1.1169円です。

○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,125
受取利息	6,181
支払利息	△ 4,056
(B) 有価証券売買損益	△ 346,553,528
売買益	84,120,500
売買損	△ 430,674,028
(C) 信託報酬等	△ 44,299,201
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 390,850,604
(E) 前期繰越損益金	△ 260,490,511
(F) 追加信託差損益金	1,555,440,482
(配当等相当額)	(370,475,617)
(売買損益相当額)	(1,184,964,865)
(G) 計(D＋E＋F)	904,099,367
(H) 収益分配金	△ 77,752,434
次期繰越損益金(G＋H)	826,346,933
追加信託差損益金	1,555,440,482
(配当等相当額)	(378,858,611)
(売買損益相当額)	(1,176,581,871)
分配準備積立金	55,735,935
繰越損益金	△ 784,829,484

*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9月8日～2016年9月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年9月8日～ 2016年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	110,649,789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	770,610,998円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	22,838,580円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	904,099,367円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,279円
g. 分配金	77,752,434円
h. 分配金(1万口当たり)	110円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	110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。

JPX日経400マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016年9月6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。

運用方針	JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 投資する株式は、原則として、東京証券取引所に上場している（上場予定を含みます。）銘柄のうち、JPX日経インデックス400に採用されているものおよび採用が決定されたものとしします。 投資する上場投資信託証券は、野村アセットマネジメント株式会社が委託者であり、JPX日経インデックス400に連動する投資効果を目指して運用されるものとしします。 株式の組入比率は、原則として高位を維持することを基本としします。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。なお、上場投資信託証券に投資する場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	JPX日経インデックス400	期 騰 落			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年1月31日	10,000	—	11,063.66	—	—	—	999
1期(2014年9月8日)	10,808	8.1	11,778.63	6.5	99.1	0.8	3,218
2期(2015年9月7日)	12,101	12.0	12,977.78	10.2	97.3	2.7	12,453
3期(2016年9月6日)	11,563	△ 4.4	12,160.56	△ 6.3	98.2	1.8	16,638

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

- ①「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）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、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属している。
- ③「JPX日経400マザーファンド」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び「JPX日経400マザーファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」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「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

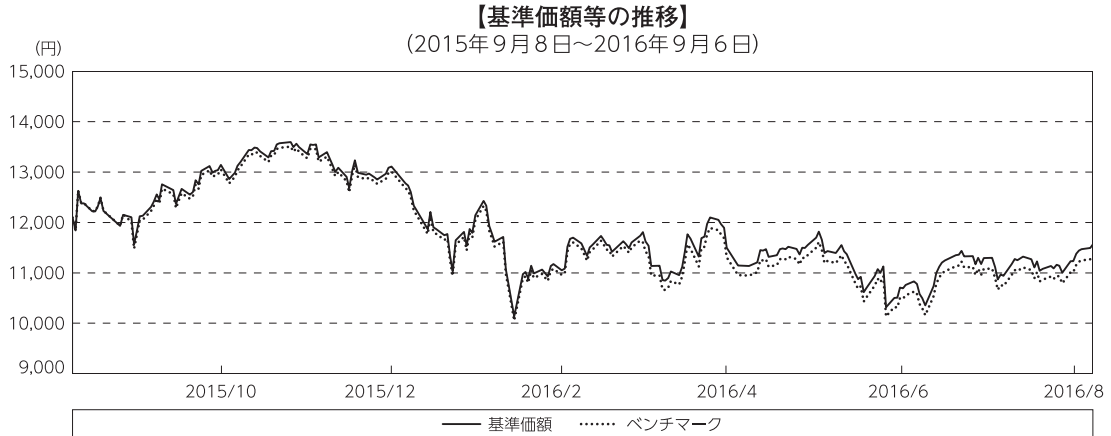
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落	率	JPX日経インデックス400	騰 落		
(期 首)	円	%		%	%	%
2015年9月7日	12,101	—	12,977.78	—	97.3	2.7
9月末	11,853	△ 2.0	12,628.54	△ 2.7	97.6	2.3
10月末	13,142	8.6	14,000.71	7.9	97.3	2.7
11月末	13,360	10.4	14,232.27	9.7	97.7	2.2
12月末	13,112	8.4	13,951.93	7.5	97.2	2.7
2016年1月末	12,144	0.4	12,917.43	△ 0.5	97.1	2.8
2月末	11,051	△ 8.7	11,755.65	△ 9.4	97.1	2.9
3月末	11,538	△ 4.7	12,161.79	△ 6.3	97.1	2.8
4月末	11,498	△ 5.0	12,124.68	△ 6.6	97.5	2.5
5月末	11,817	△ 2.3	12,453.26	△ 4.0	98.4	1.5
6月末	10,693	△ 11.6	11,250.20	△ 13.3	98.9	1.1
7月末	11,293	△ 6.7	11,879.95	△ 8.5	98.8	1.1
8月末	11,380	△ 6.0	11,967.56	△ 7.8	97.8	2.2
(期 末)						
2016年9月6日	11,563	△ 4.4	12,160.56	△ 6.3	98.2	1.8

*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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPX日経インデックス400です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首12,101円から期末11,563円に538円の値下がりとなりました。

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や円高の進行により企業業績への影響が懸念されたことなどから、基準価額は下落しました。

○投資環境

株式市場は、期首から2015年11月下旬まで、中国経済への懸念が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）総裁の追加金融緩和を示唆する発言など世界的な金融緩和継続の流れ、国内企業の決算への期待などを背景に上昇しました。

12月以降は、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。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質株式組入比率（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

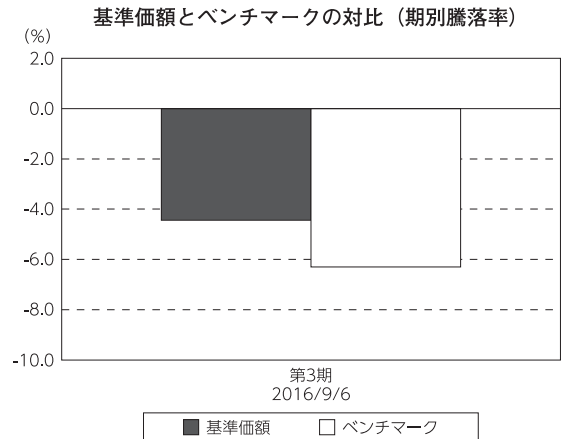
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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－4.4%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の－6.3%を1.9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未収配当金が計上されたこと



(注) ベンチマークは、JPX 日経インデックス 400 です。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても引き続き組入比率を高位に維持し、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

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 9 月 8 日～2016年 9 月 6 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.015	(a) 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)	(2)	(0.015)	
合 計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、11,906円です。			

*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 9 月 8 日～2016年 9 月 6 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 5,627 (△ 400)	千円 7,349,842 ()	千株 1,593	千円 2,259,990

*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 8,781	百万円 8,797	百万円 －	百万円 －

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年9月8日～2016年9月6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	9,609,833千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,952,972千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64

* (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9月8日～2016年9月6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 7,349	百万円 94	1.3	百万円 2,259	百万円 —	—
預金	10,505	10,505	100.0	10,505	10,505	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 未 保 有 額
株式	百万円 48	百万円 20	百万円 101

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)	2,265千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.275千円
(B) / (A)	0.0%

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9月6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 (0.0%)			
日本水産	—	15.7	7,049
鉱業 (0.3%)			
国際石油開発帝石	45.6	64.7	55,564
建設業 (3.1%)			
安藤・間	5.8	8.2	4,993
東急建設	—	4	4,008
コムシスホールディングス	3.9	5.3	10,319
ミサワホーム	1	—	—
大成建設	45	64	50,624
大林組	26	36.8	36,137
清水建設	26	38	35,986
長谷工コーポレーション	10.8	14.3	14,271
鹿島建設	38	58	41,586
三井住友建設	35.1	47.1	4,568
熊谷組	—	18	5,094
大東建託	3.2	4.5	71,100
N I P P O	2	3	5,889
前田道路	—	4	7,148
住友林業	6.4	8.5	11,806
大和ハウス工業	25.5	36.3	100,333
積水ハウス	27.2	41.1	70,609
協和エクシオ	3.7	4.8	7,161
九電工	—	2.2	7,304
日揮	9	12.3	20,122
千代田化工建設	6	—	—
食料品 (4.5%)			
江崎グリコ	—	2.8	15,120
カルビー	3.2	4.6	17,158
ヤクルト本社	4.6	6.6	30,855
明治ホールディングス	2.6	7.3	70,299
日本ハム	6	9	21,699
アサヒグループホールディングス	16.2	23	82,018
キリンホールディングス	35.1	52.9	91,887
伊藤園	2.6	3.6	11,682

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キッコーマン	7	9	30,150
味の素	20	25.8	58,398
キュービー	4.4	6.2	18,153
ニチレイ	9	13	13,611
東洋水産	4.5	6	26,340
日清食品ホールディングス	3.7	5.2	31,460
日本たばこ産業	50.3	51.7	212,331
繊維製品 (0.5%)			
東レ	63	83	80,983
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	33	45	19,305
大王製紙	4	5.1	5,941
化学 (7.0%)			
クラレ	12.8	19.3	28,139
旭化成	50	72	62,308
住友化学	60	84	40,404
日産化学工業	5.2	6.9	21,907
東ソー	22	31	19,313
デンカ	17	24	10,800
信越化学工業	14.5	20.6	152,357
エア・ウォーター	7	9	17,208
大陽日酸	10.4	8.8	9,134
日本パーカライジング	3.8	5.9	8,142
三菱瓦斯化学	—	20	13,860
J S R	8	10.8	16,804
三菱ケミカルホールディングス	50.6	76.9	49,800
日本合成化学工業	2	—	—
ダイセル	11.4	15.5	19,809
積水化学工業	19	26.1	38,993
日本ゼオン	7	10	8,820
アイカ工業	2.4	3.4	8,904
宇都興産	41	61	11,834
日立化成	4	5.7	13,309
日本化薬	5	7	7,882
日油	7	9	9,027

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
花王	21.8	29.2	163,578
日本ベイントホールディングス	7	8.9	31,239
関西ベイント	10	13	29,692
D I C	32	4.5	13,792
富士フィルムホールディングス	18.5	26.3	103,332
資生堂	14.4	21.8	59,328
コーセー	1.3	1.9	19,380
シーズ・ホールディングス	1.1	1.5	4,062
小林製薬	1.3	3.5	17,342
日東電工	6.3	8.9	61,401
ニフコ	1.8	2.2	11,990
ユニ・チャーム	16.4	23.2	59,310
医薬品 (6.5%)			
協和発酵キリン	10	13.7	21,783
武田薬品工業	30.3	45.7	216,343
アステラス製薬	90.6	124.6	196,868
塩野義製薬	12.6	16.7	78,857
田辺三菱製薬	9.4	13.4	26,786
中外製薬	8.1	11.4	38,874
科研製薬	3	2	11,880
エーザイ	10.7	14.1	90,804
ロート製薬	3.7	—	—
小野薬品工業	3.7	26.1	70,992
久光製薬	2.3	3.6	17,784
持田製薬	0.6	—	—
参天製薬	14.9	21.1	28,548
ツムラ	2.5	3.6	9,957
沢井製薬	1.3	1.9	13,148
第一三共	27.2	38.6	94,608
キョーリン製薬ホールディングス	2.2	3.1	6,866
大塚ホールディングス	17.4	24.7	113,274
大正製薬ホールディングス	1.9	2.8	27,524
石油・石炭製品 (—%)			
昭和シェル石油	8.1	—	—
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	4.9	6.9	11,730
東洋ゴム工業	3.7	6.1	8,418
ブリヂストン	27.3	38.7	139,590
住友ゴム工業	7.6	10.7	16,938

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.0%)			
旭硝子	43	57	36,537
住友大阪セメント	—	23	10,810
太平洋セメント	50	73	22,849
T O T O	12	8.4	33,264
日本碍子	10	14.5	32,828
日本特殊陶業	7	9.9	19,423
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	345	51.7	113,042
神戸製鋼所	140	211	20,467
ジェイ エフ イー ホールディングス	20.6	31.4	50,758
日立金属	8.2	13.1	16,676
非鉄金属 (0.9%)			
三井金属鉱業	22	—	—
三菱マテリアル	50	72	21,456
住友金属鉱山	22	32	42,928
DOWAホールディングス	10	15	10,620
住友電気工業	30.5	45.9	70,456
アサヒホールディングス	1.2	—	—
金属製品 (0.3%)			
三和ホールディングス	7.6	11.4	10,533
三協立山	1.1	1.5	2,419
リンナイ	1.5	2.1	20,370
日本発條	7	10.8	10,800
機械 (5.2%)			
オーエスジー	3.7	5.2	9,968
DMG森精機	—	6.8	7,554
ディスコ	0.9	1.5	17,910
ニューフレアテクノロジー	0.1	0.2	1,006
ナブテスコ	4.9	6	15,786
SMC	2.4	3.4	98,294
小松製作所	39.6	56.2	127,349
住友重機械工業	22	33	16,863
日立建機	3.6	5.1	9,735
クボタ	39	55.1	84,055
荏原製作所	17	25	14,275
ダイキン工業	11.3	16	153,600
椿本チエイン	4	7	5,600
ダイフク	—	5.9	10,354
タダノ	4	5.3	5,379

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
平和	2.3	3.4	7,840
ユニバーサルエンターテインメント	0.8	—	—
竹内製作所	—	2.2	3,302
セガサミーホールディングス	8.3	—	—
T P R	0.9	1.3	3,495
ホシザキ	2.3	3.2	26,848
日本精工	15.9	22.5	23,827
ジェイテクト	8.2	11.7	18,684
不二越	7	11	4,026
THK	5.1	7.3	14,381
イーグル工業	1.1	1.4	1,891
マキタ	5	7.1	51,262
三菱重工業	130	195	87,828
I H I	56	84	25,284
電気機器 (12.7%)			
コニカミノルタ	18.1	27.4	25,920
ブラザー工業	10	14.2	25,176
ミネベア	11	17.7	17,823
日立製作所	186	280	141,092
三菱電機	77	117	155,376
富士電機	21	33	15,807
安川電機	9.5	13.6	20,767
日本電産	8.5	13.2	118,918
オムロン	8.3	12.4	43,152
日本電気	100	151	41,676
富士通	74	106	56,847
沖電気工業	27	47	6,627
ルネサスエレクトロニクス	—	5.7	3,579
セイコーエプソン	10.5	16.3	32,306
ワコム	6.1	—	—
エレコム	—	0.9	2,051
パナソニック	94.6	125.2	133,525
アンリツ	4.6	—	—
富士通ゼネラル	2	3	6,132
日立国際電気	2	2.5	4,615
T D K	4.7	6.6	48,246
アルプス電気	6.3	9.4	21,403
ヒロセ電機	1.3	1.8	23,472
日本航空電子工業	2	3	4,647
横河電機	7.7	11	14,256

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本光電工業	3.2	4.6	11,274
堀場製作所	1.4	2.2	10,824
キーエンス	1.8	2.5	179,150
シスメックス	6	8.5	56,610
スタンレー電気	5.5	7.8	20,794
カシオ計算機	7.7	11	16,742
ファナック	8	11.1	192,640
エンプラス	0.3	0.6	1,740
浜松ホトニクス	6	8.6	27,649
京セラ	12.7	18	87,534
村田製作所	8.1	11.6	156,716
小糸製作所	4.6	6.6	33,528
ミツバ	1.4	1.9	2,661
S C R E E Nホールディングス	—	11	14,443
キャノン	41.6	59	179,360
リコー	23.2	35.5	35,074
東京エレクトロン	6.5	9	83,583
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	2.7	—	—
ユニプレス	1.5	—	—
豊田自動織機	7	10	49,950
デンソー	19.1	27.1	116,855
東海理化電機製作所	2	—	—
三井造船	30	—	—
川崎重工業	56	85	27,115
名村造船所	2.2	3.3	2,366
日産自動車	108.5	149.4	157,617
いすゞ自動車	24.4	31.8	39,209
トヨタ自動車	25.1	45.9	286,186
日野自動車	11	15.6	17,628
三菱自動車工業	28.3	—	—
日信工業	—	2.4	3,693
N O K	3.7	5.3	11,310
カルソニックカンセイ	6	8	6,896
アイシン精機	7.1	11.2	54,488
マツダ	23	34.7	59,441
ダイハツ工業	9.2	—	—
本田技研工業	51.9	88	279,752
スズキ	16.2	20	69,820
富士重工業	26.3	34.6	144,005

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマハ発動機	10.9	15.5	32,937
エクセディ	1	—	—
豊田合成	2.5	4	9,600
日本精機	2	—	—
シマノ	3.1	4.4	69,520
ティ・エス テック	1.6	2.5	6,595
精密機器 (1.8%)			
テルモ	11.8	16.8	66,612
島津製作所	—	14	22,792
ニコン	14.4	20.5	31,672
トプコン	2.3	3.7	4,810
オリンパス	11.5	16.3	55,175
HOYA	18.4	24.8	98,629
朝日インテック	—	2.6	11,726
セイコーホールディングス	5	7	2,366
その他製品 (0.7%)			
バンダイナムコホールディングス	8.5	11.3	33,346
パイロットコーポレーション	1.3	1.9	7,799
アシックス	7.2	10.9	23,544
ヤマハ	5.7	8.1	27,580
ビジョン	4.4	6.2	18,048
電気・ガス業 (1.4%)			
中部電力	—	33.5	48,256
東北電力	—	27.4	36,332
電源開発	5.6	9.3	24,524
東京瓦斯	94	122	55,351
大阪瓦斯	80	113	47,177
東邦瓦斯	—	28	25,340
陸運業 (5.2%)			
東武鉄道	41	59	30,621
相鉄ホールディングス	18	25	13,725
東京急行電鉄	42	64	50,688
小田急電鉄	25	35	38,395
京王電鉄	22	31	27,497
京成電鉄	12	16	20,624
東日本旅客鉄道	14.2	19.9	180,950
西日本旅客鉄道	7.4	10.5	63,819
東海旅客鉄道	6.9	9.8	167,776
西日本鉄道	13	19	9,386
近鉄グループホールディングス	78	110	44,880

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
阪急阪神ホールディングス	52	14.7	50,053
南海電気鉄道	23	33	16,434
京阪ホールディングス	23	33	22,968
名古屋鉄道	38	53	27,507
日本通運	30	42	21,000
ヤマトホールディングス	13.6	19.6	48,069
山九	9	14	8,344
海運業 (0.1%)			
日本郵船	65	98	19,796
空運業 (0.8%)			
日本航空	—	21	65,961
ANAホールディングス	152	203	58,058
倉庫・運輸関連業 (—%)			
近鉄エクスプレス	0.7	—	—
情報・通信業 (7.4%)			
グリー	4.6	6.6	3,781
ネクソン	7.2	11.9	17,778
コロプラ	—	3	4,986
ティーガイア	0.8	1.1	1,608
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17.8	25.2	6,400
野村総合研究所	4.3	7.3	26,024
フジ・メディア・ホールディングス	7.9	—	—
オービック	2.6	3.7	19,906
ヤフー	54.7	77.5	32,627
トレンドマイクロ	3.7	5.7	20,748
日本オラクル	1.2	1.7	10,489
伊藤忠テクノソリューションズ	1.7	2.4	6,290
大塚商会	2.1	2.9	13,543
USEN	3.5	4.9	1,568
エイベックス・グループ・ホールディングス	1.5	—	—
日本テレビホールディングス	7	9.9	17,334
日本電信電話	46.4	47.2	224,341
KDDI	69.6	72.8	230,484
光通信	0.7	1.3	12,246
NTTドコモ	58.8	80.8	215,291
GMOインターネット	2.8	3.9	5,346
東宝	5.4	7.7	24,139
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	6.7	36,113
SCSK	1.8	2.6	10,023
ソフトバンクグループ	28.5	39.1	269,711

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
卸売業 (4.5%)			
双日	51	68.1	17,365
アルフレッサ ホールディングス	9	13.6	28,043
シップヘルスケアホールディングス	1.4	2.2	6,344
第一興商	1.8	2.5	10,587
メディパルホールディングス	7.6	10.8	18,986
伊藤忠商事	63.8	84.9	108,289
丸紅	66.7	106.4	55,434
豊田通商	8.5	12	28,740
兼松	15	23	3,611
三井物産	64.7	97.8	135,746
日立ハイテクノロジーズ	2.6	3.7	13,949
住友商事	45	68.1	77,565
三菱商事	58.4	81.2	178,680
阪和興業	—	11	6,512
岩谷産業	8	13	7,462
東邦ホールディングス	2.6	3.5	7,395
サンリオ	2.1	3.3	6,646
日鉄住金物産	7	9	3,240
ミスミグループ本社	8.6	12.1	20,013
小売業 (4.4%)			
ローソン	2.9	4.1	30,381
エービーシー・マート	1.1	1.4	9,310
ゲオホールディングス	1.4	1.8	2,512
セリア	0.9	1.2	8,592
MonotaRO	1.3	3.8	10,104
J. フロント リテイリング	9.6	13.7	17,755
マツモトキヨシホールディングス	1.7	2.2	10,912
スタートトゥデイ	2.4	3.3	16,252
三越伊勢丹ホールディングス	15.2	—	—
ウエルシアホールディングス	1	1.2	7,416
クリエイトSDホールディングス	—	1.6	3,694
コスモス薬品	0.4	0.5	9,605
セブン&アイ・ホールディングス	31.9	45.2	204,394
ツルハホールディングス	1.6	2.5	27,075
クスリのアオキ	—	1	4,115
ノジマ	—	1.7	2,094
良品計画	0.9	1.2	23,412
ドンキホーテホールディングス	4.9	7	25,025
V Tホールディングス	3.2	4.9	2,151

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユナイテッドアローズ	1	1.5	4,125
スギホールディングス	1.4	1.9	10,108
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2.6	3.3	23,397
日本瓦斯	1.6	1.7	4,962
AOKIホールディングス	1.8	—	—
しまむら	0.9	1.3	15,964
高島屋	11	16	13,088
イオン	31.4	44.5	65,882
イズミ	1.7	2.1	8,746
ヤオコー	0.9	1.2	4,914
ケーズホールディングス	1.8	4.6	7,705
アインホールディングス	0.9	1.3	8,177
ニトリホールディングス	3.3	4.7	51,982
パローホールディングス	1.6	2.3	6,536
ファーストリテイリング	1.5	1.8	66,348
サンドラッグ	1.6	2.3	18,193
銀行業 (7.9%)			
東京ＴＹフィナンシャルグループ	—	1.5	4,182
九州フィナンシャルグループ	—	22.1	13,967
コンソルディア・フィナンシャルグループ	—	75.4	40,278
新生銀行	73	94	15,886
あおぞら銀行	51	68	25,636
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	233.8	496.8	281,784
りそなホールディングス	89.2	126.5	59,783
三井住友トラスト・ホールディングス	169	226	84,659
三井住友フィナンシャルグループ	37.7	77.4	287,618
西日本シティ銀行	27	—	—
千葉銀行	29	42	25,830
横浜銀行	51	—	—
常陽銀行	28	—	—
群馬銀行	18	24	11,664
ふくおかフィナンシャルグループ	31	47	21,056
静岡銀行	22	32	27,136
十六銀行	13	—	—
スルガ銀行	8.1	10.3	26,223
八十二銀行	18	26.1	14,355
ほくほくフィナンシャルグループ	52	74	10,656
広島銀行	23	32	13,984
中国銀行	7.2	10.2	13,107
伊予銀行	10.9	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セブン銀行	25.7	40.5	15,268
みずほフィナンシャルグループ	780.9	1,548	284,367
山口フィナンシャルグループ	10	13	14,365
北洋銀行	11.5	16.3	5,884
京葉銀行	8	—	—
証券・商品先物取引業 (1.3%)			
F P G	—	3.9	3,724
S B I ホールディングス	9.2	13	16,276
ジャフコ	1	1.8	5,490
大和証券グループ本社	71	101	62,882
野村ホールディングス	155.9	208.1	101,011
岡三証券グループ	6	9	4,770
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	8.8	12.4	6,398
松井証券	3.9	5.3	4,902
カブドットコム証券	6.8	9.2	3,201
保険業 (3.3%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	16.9	24	81,240
MS&ADインシュアランスグループホール	24.3	32.3	96,883
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.3	10.4	14,944
第一生命保険	48.9	69.3	105,370
東京海上ホールディングス	30.9	43.8	184,047
T&Dホールディングス	27.8	39.4	48,777
その他金融業 (1.5%)			
全国保証	—	2.8	11,298
クレディセゾン	6.2	—	—
芙蓉総合リース	0.8	1.2	6,132
興銀リース	1.4	2	4,234
東京センチュリーリース	1.8	2.5	9,837
イオンフィナンシャルサービス	5	7.1	13,667
アコム	15.3	—	—
オリエントコーポレーション	—	46.8	9,874
日立キャピタル	1.5	2.5	5,492
オリックス	54	76.6	120,223
三菱UFJリース	19.3	27.4	13,535
日本取引所グループ	11.2	31.8	52,915
不動産業 (3.1%)			
いちご	—	12	5,304
ヒューリック	15.9	22.5	22,455
野村不動産ホールディングス	4.6	7.2	12,657
プレサンスコーポレーション	0.3	0.4	1,746

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東急不動産ホールディングス	20	26.2	15,300
飯田グループホールディングス	4.9	10	19,560
パーク 2 4	3.8	5.5	16,610
三井不動産	40	57	129,960
三菱地所	57	80	156,000
東京建物	8.3	12.6	15,661
住友不動産	18	26	73,515
大京	12	20	3,460
レオパレス 2 1	8.3	12.7	8,813
スターツコーポレーション	1.2	1.7	3,109
住友不動産販売	0.5	0.8	1,602
タカラレーベン	3.4	4.7	3,313
イオンモール	4.9	7	10,395
エヌ・ティ・ティ都市開発	4.7	6.7	6,492
サービス業 (3.3%)			
ミクシィ	1.8	2.3	8,429
日本M&Aセンター	1.2	1.8	10,278
テンブホールディングス	1.6	8	13,592
クックパッド	1.8	2.6	2,698
総合警備保障	2.7	3.8	19,798
カカコム	5.3	8.2	14,276
ディップ	—	1.3	3,913
エムスリー	7	9.9	30,393
ディー・エヌ・エー	4	5.1	16,396
博報堂DYホールディングス	11.2	15.9	19,111
ぐるなび	—	1.3	3,402
電通	9	12.8	74,624
みらかホールディングス	2.1	—	—
オリエンタルランド	8.7	12.4	78,578
リゾートトラスト	3.1	4.8	10,718
ユー・エス・エス	9.8	13.9	24,491
サイバーエージェント	2	3	17,550
楽天	37.7	58.5	77,980
リログループ	0.4	0.6	8,862
エイチ・アイ・エス	1.3	1.9	5,033
カナモト	1.1	1.6	3,592
セコム	7.8	11.9	94,057
ベネッセホールディングス	2.9	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数 評 価 額
イオンディライト	千株	千株	千円
	0.8	1.1	3,284
合 計	株 数 ・ 金 額	8,440	12,074 16,335,037
	銘柄数 < 比率 >	400	400 < 98.2% >

*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	J P X 日 経 4 0 0	百万円 297
			百万円 ー

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
株式	千円 %
	16,335,037 97.5
コール・ローン等、その他	424,520 2.5
投資信託財産総額	16,759,557 100.0

*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9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,759,557,876
コール・ローン等	394,941,840
株式(評価額)	16,335,037,630
未収入金	14,365,705
未収配当金	9,186,700
差入委託証拠金	6,026,001
(B) 負債	120,591,574
未払金	699,200
未払解約金	119,891,808
未払利息	566
(C) 純資産総額(A－B)	16,638,966,302
元本	14,389,874,915
次期繰越損益金	2,249,091,387
(D) 受益権総口数	14,389,874,915口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,563円

(注) 期首元本額は10,292,035,414円、期中追加設定元本額は6,569,033,862円、期中一部解約元本額は2,471,194,361円、1口当たり純資産額は1.1563円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

・JPX日経400ファンド	6,827,291,930円
・野村インデックスファンド・JPX日経400	6,416,057,753円
・ノムラPOFs用インデックスファンド・JPX日経400 (適格機関投資家専用)	1,101,482,096円
・野村DC・JPX日経400ファンド	45,043,136円

○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	301,955,243
受取配当金	301,666,902
受取利息	133,690
その他収益金	206,166
支払利息	△ 51,515
(B) 有価証券売買損益	△ 874,086,759
売買益	688,212,148
売買損	△1,562,298,907
(C) 先物取引等取引損益	△ 16,294,775
取引益	151,534,771
取引損	△ 167,829,546
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 588,426,291
(E) 前期繰越損益金	2,161,934,034
(F) 追加信託差損益金	1,186,509,876
(G) 解約差損益金	△ 510,926,232
(H) 計(D+E+F+G)	2,249,091,387
次期繰越損益金(H)	2,249,091,387

* 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(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。

* 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。