

JPX日経400ファンド

運用報告書(全体版)

第5期（決算日2018年9月6日）

作成対象期間（2017年9月7日～2018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
4期(2017年9月6日)	13,038		130	17.9	14,113.10	16.1	98.3	1.7	5,173
5期(2018年9月6日)	13,898		140	7.7	14,960.51	6.0	97.1	2.8	3,889

* 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) 2017年9月6日	円 13,038	% —	14,113.10	% —	% 98.3	% 1.7
9月末	13,763	5.6	14,787.20	4.8	98.1	1.8
10月末	14,539	11.5	15,630.13	10.7	97.8	2.1
11月末	14,766	13.3	15,876.76	12.5	98.1	1.9
12月末	14,962	14.8	16,074.10	13.9	98.6	1.4
2018年1月末	15,121	16.0	16,250.68	15.1	97.9	2.1
2月末	14,522	11.4	15,613.45	10.6	97.7	2.3
3月末	14,243	9.2	15,180.09	7.6	97.3	2.6
4月末	14,739	13.0	15,712.78	11.3	97.8	2.2
5月末	14,492	11.2	15,449.70	9.5	97.0	3.0
6月末	14,376	10.3	15,312.40	8.5	97.8	2.1
7月末	14,546	11.6	15,499.78	9.8	97.2	2.7
8月末	14,386	10.3	15,332.17	8.6	97.4	2.6
(期 末) 2018年9月6日	14,038	7.7	14,960.51	6.0	97.1	2.8

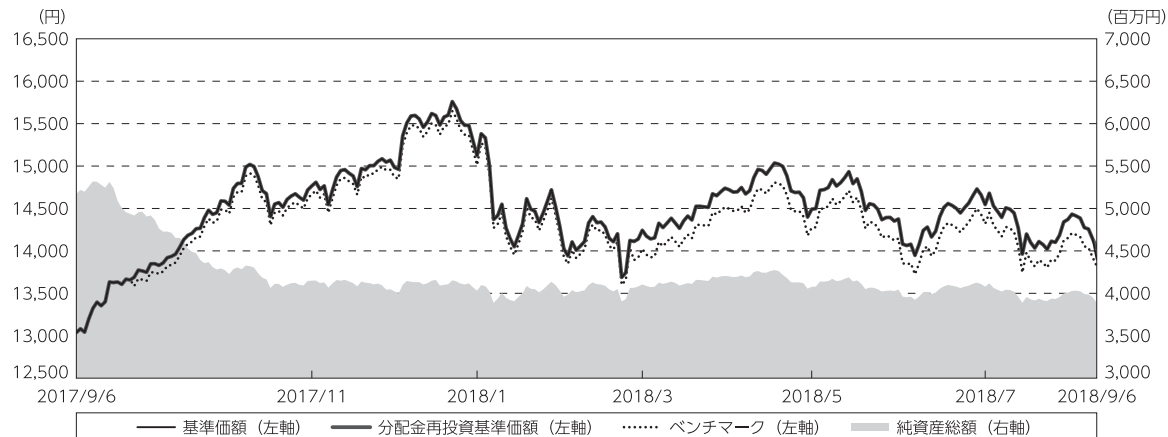
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：13,038円

期 末：13,898円 (既払分配金(税込み)：140円)

騰落率： 7.7% (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(2017年9月6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、JPX日経インデックス400です。ベンチマークは、作成期首(2017年9月6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13,038円から期末14,038円(分配金込み)に1,000円の値上がりとなりました。

衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などから上昇しました。

○投資環境

株式市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）において保有資産縮小が決定されたことなどから米国金利が上昇し外国為替市場で円安が進んだこと、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国の長期金利の上昇などから米国株式市場が下落したこと、外国為替市場で円高ドル安が進行したことや、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながるなどの懸念などから下落しました。

3月下旬以降は、米中貿易摩擦懸念が薄れたことや、円高ドル安が一服したことなどから上昇しましたが、5月下旬以降は、米国の保護主義強化への警戒感が再度高まったことなどから下落しました。

○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+7.7%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+6.0%を1.7ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

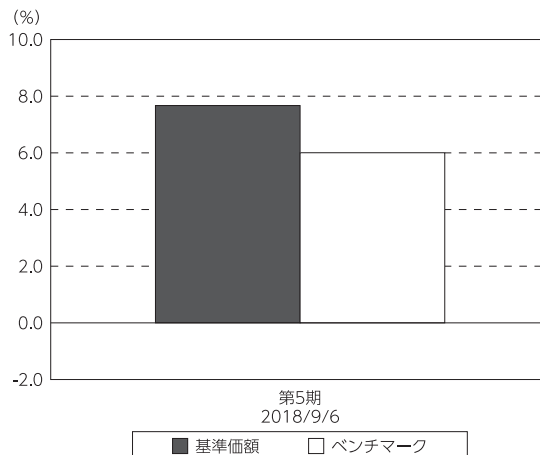
(プラス要因)

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140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 5 期
	2017年 9 月 7 日～ 2018年 9 月 6 日
当期分配金	140
(対基準価額比率)	0.997%
当期の収益	140
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,897

(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

(2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 83	% 0.572	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(38)	(0.259)	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)	(38)	(0.259)	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)	(8)	(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	0.011	(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)	(2)	(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	85	0.586	
期中の平均基準価額は、14,537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

(2017年9月7日～2018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 455,317	千円 694,223	千口 1,608,684	千円 2,407,749

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年9月7日～2018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	7,956,260千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,027,152千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.56

* (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

(2017年9月7日～2018年9月6日)

利害関係人との取引状況

<JPX日経400ファンド>

該当事項はございません。

<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	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 3,401	百万円 12	% 0.4	百万円 4,554	百万円 7	% 0.2

平均保有割合 28.9%

※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
株式	百万円 12	百万円 38	百万円 64

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証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2018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
JPX日経400マザーファンド	千口 3,772,519	千口 2,619,152	千円 3,888,656

*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

(2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
JPX日経400マザーファンド	千円 3,888,656	% 98.7
コール・ローン等、その他	53,132	1.3
投資信託財産総額	3,941,788	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 (2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,941,788,266
コール・ローン等	13,224,019
JPX日経400マザーファンド(評価額)	3,888,656,009
未収入金	39,908,238
(B) 負債	52,736,899
未払収益分配金	39,177,330
未払解約金	1,713,680
未払信託報酬	11,779,260
未払利息	20
その他未払費用	66,609
(C) 純資産総額(A－B)	3,889,051,367
元本	2,798,380,758
次期繰越損益金	1,090,670,609
(D) 受益権総口数	2,798,380,758口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,898円

(注) 期首元本額は3,967,796,912円、期中追加設定元本額は916,519,035円、期中一部解約元本額は2,085,935,189円、1口当たり純資産額は1.3898円です。

○損益の状況 (2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,315
支払利息	△ 6,315
(B) 有価証券売買損益	188,833,283
売買益	385,881,261
売買損	△ 197,047,978
(C) 信託報酬等	△ 24,181,390
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	164,645,578
(E) 前期繰越損益金	154,551,104
(F) 追加信託差損益金	810,651,257
(配当等相当額)	(214,295,384)
(売買損益相当額)	(596,355,873)
(G) 計(D＋E＋F)	1,129,847,939
(H) 収益分配金	△ 39,177,330
次期繰越損益金(G＋H)	1,090,670,609
追加信託差損益金	810,651,257
(配当等相当額)	(216,904,086)
(売買損益相当額)	(593,747,171)
分配準備積立金	280,019,352

* 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 (2017年9月7日～2018年9月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年9月7日～ 2018年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	79,050,617円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	85,594,961円
c. 信託約款に定める収益調整金	810,651,257円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	154,551,104円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,129,847,939円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,037円
g. 分配金	39,177,330円
h. 分配金(1万口当たり)	140円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	140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5期（決算日2018年9月6日）

作成対象期間（2017年9月7日～2018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	騰 落 率	ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
			JPX日経インデックス400	騰 落 率			
(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
4期(2017年9月6日)	13,711	18.6	14,113.10	16.1	98.3	1.7	14,673
5期(2018年9月6日)	14,847	8.3	14,960.51	6.0	97.1	2.8	14,511

*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	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)	円	%		%	%	%
2017年9月6日	13,711	—	14,113.10	—	98.3	1.7
9月末	14,479	5.6	14,787.20	4.8	98.1	1.8
10月末	15,304	11.6	15,630.13	10.7	97.9	2.1
11月末	15,550	13.4	15,876.76	12.5	98.1	1.9
12月末	15,764	15.0	16,074.10	13.9	98.6	1.4
2018年1月末	15,939	16.2	16,250.68	15.1	97.9	2.1
2月末	15,315	11.7	15,613.45	10.6	97.7	2.3
3月末	15,028	9.6	15,180.09	7.6	97.4	2.6
4月末	15,558	13.5	15,712.78	11.3	97.8	2.2
5月末	15,305	11.6	15,449.70	9.5	97.0	3.0
6月末	15,190	10.8	15,312.40	8.5	97.8	2.1
7月末	15,377	12.2	15,499.78	9.8	97.2	2.7
8月末	15,215	11.0	15,332.17	8.6	97.4	2.6
(期 末)						
2018年9月6日	14,847	8.3	14,960.51	6.0	97.1	2.8

*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13,711円から期末14,847円に1,136円の値上がりとなりました。

衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などから上昇しました。

○投資環境

株式市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）において保有資産縮小が決定されたことなどから米国金利が上昇し外国為替市場で円安が進んだこと、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国の長期金利の上昇などから米国株式市場が下落したこと、外国為替市場で円高ドル安が進行したことや、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながるとの懸念などから下落しました。

3月下旬以降は、米中貿易摩擦懸念が薄れたことや、円高ドル安が一服したことなどから上昇しましたが、5月下旬以降は、米国の保護主義強化への警戒感が再度高まったことなどから下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

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

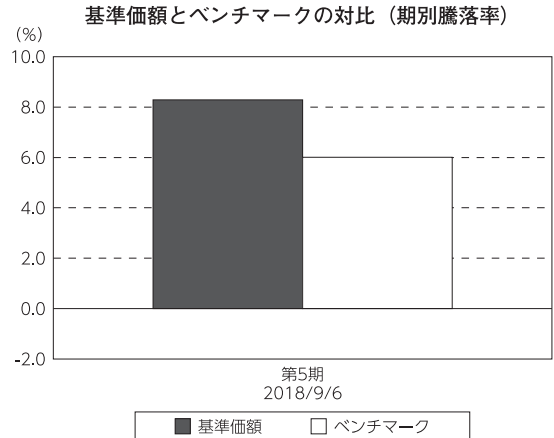
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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+8.3%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+6.0%を2.3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



（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実質株式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

(2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 2	% 0.010	(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)	(0.010)	
合 計	2	0.010	
期中の平均基準価額は、15,335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

(2017年9月7日～2018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 1,467 (△1,162)	千円 3,401,860 ()	千株 2,137	千円 4,554,400

*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 7,124	百万円 6,975	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年9月7日～2018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	7,956,260千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,027,152千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.56

* (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

(2017年9月7日～2018年9月6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 3,401	百万円 12	% 0.4	百万円 4,554	百万円 7	% 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
株式	百万円 12	百万円 38	百万円 64

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

(2018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 (0.1%)			
日本水産	12.1	9.4	5,931
マルハニチロ	—	1.6	6,040
鉱業 (0.4%)			
国際石油開発帝石	49.1	40.8	49,796
建設業 (2.8%)			
安藤・間	6.7	6.8	5,623
東急建設	3.3	3.2	3,209
コムシスホールディングス	3.6	3	9,015
大成建設	47	8.4	42,168
大林組	28	25.2	26,132
清水建設	28.5	25.7	24,286
長谷工コーポレーション	10.9	9.8	13,759
鹿島建設	41	37	28,971
西松建設	—	1.9	5,008
三井住友建設	35.7	6.1	4,355
前田建設工業	6	6	8,178
戸田建設	11	9.8	7,310
熊谷組	15	1.3	3,714
大東建託	3.4	3	46,095
N I P P O	2	1.9	3,847
前田道路	3	2.6	5,725
五洋建設	10.3	10	6,780
住友林業	6.4	5.4	9,779
大和ハウス工業	27.6	24.8	80,748
積水ハウス	28.6	27.3	47,406
協和エクシオ	3.7	3	9,255
九電工	1.8	1.7	7,344
食料品 (3.9%)			
森永製菓	—	1.8	7,353
江崎グリコ	2.3	2.1	11,109
カルビー	3.8	3.4	11,934
ヤクルト本社	5	4.4	35,552
明治ホールディングス	5.5	5	36,450
日本ハム	7	3.2	12,736

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アサヒグループホールディングス	17.5	15.7	75,344
キリンホールディングス	40.2	34	91,800
サントリー食品インターナショナル	6.4	5	22,500
キッコーマン	6.5	5.4	30,780
味の素	19.2	17.3	31,745
キュービー	4.7	4.2	10,991
ニチレイ	4.3	3.6	9,723
東洋水産	4.6	4.1	16,605
日清食品ホールディングス	3.6	2.9	20,532
日本たばこ産業	51.7	43.4	125,382
繊維製品 (0.4%)			
帝人	7.1	6.4	13,529
東レ	63.3	56.9	46,276
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	34	33	25,047
大王製紙	3.5	—	—
化学 (7.7%)			
クラレ	14.7	12.4	19,257
旭化成	54	48.9	76,895
昭和電工	—	4.9	25,284
住友化学	64	58	35,148
日産化学	4.7	4.5	23,580
東ソー	25	11.3	18,746
デンカ	17	2.9	10,454
信越化学工業	15.6	12.9	128,987
エア・ウォーター	7.2	6.5	12,454
大陽日酸	6.7	6	9,804
日本パーカライジング	4.5	4	5,756
三菱瓦斯化学	8.1	6.5	14,813
三井化学	40	7.1	19,482
J S R	8.8	7.9	16,321
三菱ケミカルホールディングス	58.7	52.5	50,730
ダイセル	11.8	10.6	13,069
積水化学工業	19.4	16	29,712
日本ゼオン	7	6.6	7,609

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	評 価 額
	株 数	株 数	
	千株	千株	千円
アイカ工業	2.8	2.2	9,306
宇部興産	44	4	10,832
日立化成	4.8	3.9	8,892
ダイキョーニシカワ	1.5	1.5	1,945
日本化薬	6	—	—
日油	7	3	10,440
花王	20.5	18.4	158,608
日本ペイントホールディングス	6.7	6.1	25,711
関西ペイント	9.2	8.2	16,588
D I C	3.4	3.3	12,408
資生堂	15.5	14.9	112,822
ライオン	11.6	10.4	24,564
コーセー	1.4	1.3	25,155
シーズ・ホールディングス	1.1	0.9	4,324
ポーラ・オルビスホールディングス	—	3.2	11,856
小林製薬	2.3	2.1	16,254
日東電工	6.3	5.7	47,304
ニフコ	1.5	2.7	8,067
ユニ・チャーム	17.7	15.9	57,049
医薬品 (5.7%)			
協和発酵キリン	10.4	9.4	18,442
武田薬品工業	32.7	27.6	123,868
アステラス製薬	85.6	73.7	134,134
大日本住友製薬	6.2	5.6	11,804
塩野義製薬	11.1	10.6	68,052
田辺三菱製薬	10.2	9.1	16,380
中外製薬	8.7	7.8	50,856
科研製薬	1.6	1.4	7,826
エーザイ	10.7	9	88,794
小野薬品工業	19.8	17.7	51,073
久光製薬	2.5	2.2	17,160
参天製薬	15.7	14.2	24,125
ツムラ	2.9	2.7	10,273
沢井製薬	1.5	1.5	8,790
第一三共	25.7	21.4	90,971
大塚ホールディングス	17.3	14.3	74,517
石油・石炭製品 (0.9%)			
出光興産	—	6.3	35,091
J X T Gホールディングス	—	119.5	88,023
コスモエネルギーホールディングス	—	2.2	8,712

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	評 価 額
	株 数	株 数	
	千株	千株	千円
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	4.8	4.3	9,735
東洋ゴム工業	4.9	—	—
ブリヂストン	29.4	23	91,333
住友ゴム工業	8.2	6.7	10,666
ガラス・土石製品 (0.8%)			
A G C	8.5	7.6	33,478
住友大阪セメント	16	—	—
太平洋セメント	53	4.7	15,745
T O T O	6.4	5.8	26,680
日本碍子	11	9.1	15,915
日本特殊陶業	7.5	6.3	18,704
ニチアス	—	4	5,808
鉄鋼 (0.9%)			
新日鐵住金	39.3	33.1	71,016
ジェイ エフ イー ホールディングス	23.8	20	47,230
東京製鐵	4.4	4	3,372
日立金属	8.9	8	10,096
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	22.4	21.6	5,140
三菱マテリアル	5.4	4.9	14,646
住友金属鉱山	23	9.5	33,801
DOWAホールディングス	10	1.9	6,175
古河電気工業	—	2.5	9,175
住友電気工業	32.8	27.7	46,494
金属製品 (0.3%)			
S U M C O	—	8.2	14,809
三和ホールディングス	8.6	7.1	9,258
リンナイ	1.5	1.3	10,595
東プレ	—	1.4	3,733
日本発條	8.2	7.4	8,606
機械 (5.1%)			
アマダホールディングス	11.7	11.4	13,121
オーエスジー	3.7	3.6	8,917
DMG森精機	4.6	4.7	8,398
デイスコ	1	1	18,520
ニューフレアテクノロジー	0.2	—	—
ナブテスコ	4.5	4.1	11,668
三井海洋開発	—	0.8	2,644
SMC	2.6	2.3	79,511

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	40.2	36.2	111,170
住友重機械工業	25	4.3	15,480
日立建機	3.9	3.5	11,287
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1.2	1.1	4,455
クボタ	44.9	40.2	67,958
荏原製作所	3.9	3.3	12,160
ダイキン工業	11.4	10.2	141,117
椿本チエイン	5	4	3,880
ダイフク	4.2	3.8	20,900
タダノ	4.4	3.6	4,212
平和	2.6	2.3	5,977
竹内製作所	1.5	1.3	3,625
T P R	0.9	0.8	2,108
ホシザキ	2.6	2.2	22,968
日本精工	17.1	15.4	18,926
ジェイテクト	8.9	8	11,984
THK	5.9	4.7	13,084
イーグル工業	0.9	—	—
マキタ	10.9	9.8	48,412
三菱重工業	140	12.6	50,803
電気機器 (15.1%)			
コニカミノルタ	19.5	17.5	18,567
ブラザー工業	10.2	9.1	19,737
ミネベアミツミ	15.1	13.9	28,522
日立製作所	200	180	126,702
三菱電機	88.8	74.9	109,391
富士電機	25	23	20,286
安川電機	9.7	8.7	29,884
日本電産	10.8	9	142,425
オムロン	8.8	8	37,800
日本電気	114	9.7	29,439
富士通	80	77	60,676
ルネサスエレクトロニクス	4.3	7.8	5,998
セイコーエプソン	12.4	11.2	20,529
アルバック	1.4	1.7	7,437
エレコム	0.7	0.7	1,989
パナソニック	95.6	85.6	110,723
富士通ゼネラル	2.8	2.3	4,165
日立国際電気	2.2	—	—
ソニー	51.4	38.1	239,572

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TDK	4.7	3.9	48,321
アルプス電気	7.7	6.5	21,547
クラリオン	4	4	1,248
ヒロセ電機	1.3	1.2	15,084
日本航空電子工業	2	—	—
横河電機	9	7.5	16,732
日本光電工業	3.5	3.1	10,059
堀場製作所	1.6	1.5	10,020
アドバンテスト	5.7	4.2	11,067
キーエンス	3.8	3.5	211,890
シスメックス	6.5	5.8	55,506
OBARA GROUP	0.5	0.4	2,052
スタンレー電気	5.9	5.7	20,491
カシオ計算機	6.7	6	10,716
ファナック	8.4	7.1	150,200
浜松トニクス	6.1	5.4	23,328
京セラ	13.7	12.3	82,459
村田製作所	8.7	7.9	147,453
小糸製作所	5	4.5	29,295
ミツバ	1.5	—	—
SCREENホールディングス	1.7	1.4	11,074
キヤノン	44.8	40.3	138,309
リコー	25	—	—
東京エレクトロン	5.6	5	89,925
輸送用機器 (7.4%)			
トヨタ紡織	2.9	2.2	4,131
豊田自動織機	7.6	6.1	37,210
デンソー	20.5	16.6	86,535
川崎重工業	65	5.8	17,214
日産自動車	98.2	88.3	90,728
いすゞ自動車	24.1	21.7	34,220
トヨタ自動車	37.3	30.1	200,676
日野自動車	11.9	10.7	12,026
日信工業	1.9	—	—
NOK	4	4	7,940
アイシン精機	7.6	6.2	31,062
マツダ	26.4	23.5	29,304
本田技研工業	71.8	66.4	211,351
スズキ	16.5	14.8	106,930
S U B A R U	25.8	23.2	73,451

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	11.8	10.6	29,224
豊田合成	2.7	2.7	7,314
シマノ	3.4	3	50,610
テイ・エス テック	1.9	1.7	6,851
精密機器 (1.8%)			
テルモ	12.8	11.5	70,840
島津製作所	10.7	8.9	28,969
オリンパス	13.3	11.2	48,552
H O Y A	17.1	15.1	95,311
朝日インテック	2	3.6	15,120
セイコーホールディングス	6	—	—
その他製品 (2.0%)			
バンダイナムコホールディングス	9.2	7.7	33,033
パイロットコーポレーション	1.5	1.3	7,865
アシックス	8.3	7.4	11,573
ヤマハ	5.6	4.9	26,362
ビジョン	5	4.5	25,020
任天堂	—	4.6	175,812
電気・ガス業 (1.6%)			
中部電力	27.4	22.9	35,872
関西電力	34	30.6	47,567
東北電力	20.8	17.5	24,097
九州電力	—	16.5	20,229
電源開発	6.6	6	16,716
東京瓦斯	89	15.7	40,553
大阪瓦斯	81	14.5	29,485
東邦瓦斯	21	3.7	13,468
陸運業 (4.7%)			
東武鉄道	44	7.9	24,371
相鉄ホールディングス	18	3.2	10,912
東京急行電鉄	22.6	20.3	37,128
小田急電鉄	13.3	11.1	27,239
京王電鉄	23	4.2	23,142
京成電鉄	6.2	5.2	19,136
東日本旅客鉄道	15.9	13.3	132,348
西日本旅客鉄道	8	6.8	49,701
東海旅客鉄道	6.9	6.7	145,423
西武ホールディングス	11.5	9.5	18,705
西日本鉄道	13	—	—
近鉄グループホールディングス	84	7.1	30,530

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	10.5	9.5	37,002
南海電気鉄道	23	—	—
京阪ホールディングス	25	4.2	16,611
名古屋鉄道	40	7.6	19,053
日本通運	31	2.8	19,292
ヤマトホールディングス	14.9	12.4	39,630
山九	11	1.8	10,260
日立物流	1.7	1.6	4,832
空運業 (0.7%)			
日本航空	14.6	13	51,766
ANAホールディングス	155	13.8	51,474
情報・通信業 (8.0%)			
新日鉄住金ソリューションズ	1.3	1.1	3,778
T I S	—	2.4	12,408
ネクソン	9.1	18.7	25,824
コロプラ	2.6	2.1	1,507
ティーガイア	0.8	0.7	1,973
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22.1	17.7	3,982
野村総合研究所	6.1	4.7	25,709
オービック	2.8	2.3	23,920
ヤフー	58.9	53	19,398
トレンドマイクロ	4	3.9	27,417
日本オラクル	1.3	1.2	10,872
伊藤忠テクノソリューションズ	1.9	3.3	7,962
大塚商会	2.5	4	15,920
日本ユニシス	—	2	5,326
日本テレビホールディングス	7.5	6.7	12,073
日本電信電話	41.4	42.9	202,573
KDD I	74	64.8	186,688
光通信	1	0.9	19,098
NTT ドコモ	60.5	52.8	149,028
GMOインターネット	3	2.7	4,822
東宝	5.4	4.8	15,744
エヌ・ティ・ティ・データ	25.4	22.8	32,170
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.2	3.4	17,340
カブコン	—	3.1	8,587
S C S K	2.2	1.7	8,857
コナミホールディングス	3.7	3	13,275
ソフトバンクグループ	24.2	27.1	271,135

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 (4.8%)			
双日	48.5	43.6	16,698
アルフレッサ ホールディングス	9.7	8.2	21,959
神戸物産	0.5	0.6	3,318
シップヘルスケアホールディングス	1.6	1.5	6,202
第一興商	1.8	1.5	7,620
メディバルホールディングス	8.2	7.4	16,080
伊藤忠商事	60.2	54.1	105,143
丸紅	80.9	60.6	54,758
豊田通商	9.2	8.2	30,422
兼松	17	3.1	5,034
三井物産	74.3	60.8	109,166
日立ハイテクノロジーズ	2.8	2.6	10,907
住友商事	51.7	46.5	82,235
三菱商事	61.6	51.8	160,321
阪和興業	8	1.4	5,082
岩谷産業	9	1.6	6,168
東邦ホールディングス	2.6	2.2	6,283
サンリオ	2.5	—	—
PALTAC	—	1	5,680
日鉄住金物産	0.7	0.6	3,252
ミスミグループ本社	9.5	8.6	23,770
小売業 (4.6%)			
ローソン	2.6	1.9	12,217
エービーシー・マート	1.5	1.3	7,904
アダストリア	1.3	1.1	1,522
セリア	2	1.8	7,560
ビックカメラ	4.7	3.9	5,662
Monotaro	2.9	2.3	14,145
J. フロント リテイリング	10.4	8.8	13,763
マツモトキヨシホールディングス	1.6	3	12,690
スタートトゥデイ	7.2	7.2	25,020
ウエルシアホールディングス	2.2	1.9	9,538
クリエイトSDホールディングス	1.2	1.1	2,890
すかいらーくホールディングス	—	6.9	11,171
コスモス薬品	0.4	0.4	9,316
セブン&アイ・ホールディングス	34.4	30.9	139,050
ツルハホールディングス	1.6	1.6	20,528
クスリのアオキホールディングス	0.7	0.6	4,872
ノジマ	1.3	1.3	3,105

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
良品計画	1.1	1	32,350
ドンキホーテホールディングス	5.3	4.8	25,104
ゼンショーホールディングス	—	3.8	8,367
ユナイテッドアローズ	1.1	0.9	3,775
スギホールディングス	1.8	1.6	8,560
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3.6	2.4	23,424
日本瓦斯	1.5	1.4	7,378
しまむら	1	0.9	9,261
高島屋	14	—	—
丸井グループ	—	6.8	16,558
イオン	33.8	28.4	67,024
イズミ	1.5	1.3	8,801
ヤオコー	0.9	0.8	5,032
ケーズホールディングス	3.5	6.5	8,736
アインホールディングス	1.2	1	8,550
ニトリホールディングス	3.5	2.9	47,705
パローホールディングス	1.8	—	—
ファーストリテイリング	1.4	1	54,280
サンドラッグ	3.1	2.8	10,766
銀行業 (6.2%)			
めぶきフィナンシャルグループ	39.6	38.4	14,361
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1.2	—	—
九州フィナンシャルグループ	18	16.2	8,586
コンコルディア・フィナンシャルグループ	53.2	44.1	22,579
新生銀行	78	6	10,008
あおぞら銀行	52	4.4	16,940
三菱UFJフィナンシャル・グループ	288.7	340.3	228,103
りそなホールディングス	96.1	81.1	48,951
三井住友トラスト・ホールディングス	17.2	14.5	62,872
三井住友フィナンシャルグループ	50.3	50.1	216,882
千葉銀行	32	26.2	17,973
群馬銀行	17.9	—	—
静岡銀行	22	18.6	17,409
スルガ銀行	8.4	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	5.5	—	—
広島銀行	24	10.9	8,164
中国銀行	7.6	—	—
セブン銀行	30.8	27.7	9,695
みずほフィナンシャルグループ	1,071.5	1,003.7	193,613
山口フィナンシャルグループ	10	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
証券、商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	2.9	2.4	2,752
S B I ホールディングス	9.3	8.4	25,191
ジャフコ	1.4	—	—
大和証券グループ本社	75	63.2	41,509
野村ホールディングス	168	127.1	64,884
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9.4	8.2	5,149
松井証券	4.7	3.6	4,158
カブドットコム証券	6.1	—	—
保険業 (2.9%)			
S O M P O ホールディングス	17.2	14.5	64,525
M S & A D インシュアランスグループホール	23	19.3	62,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.9	6.1	13,108
第一生命ホールディングス	49.5	41.8	84,979
東京海上ホールディングス	33.1	27.8	141,641
T & D ホールディングス	29.9	22.8	36,913
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	2.3	2.1	9,103
芙蓉総合リース	0.9	0.8	5,312
興銀リース	1.5	—	—
東京センチュリー	1.7	1.5	9,135
イオンフィナンシャルサービス	5.2	5.2	11,434
オリエントコーポレーション	17.8	16	2,544
日立キャピタル	1.9	2	5,978
オリックス	58.2	49.3	84,598
三菱ＵＦＪリース	20.8	18.7	11,238
日本取引所グループ	25.5	21.2	39,029
不動産業 (2.6%)			
いちご	7.8	10.6	4,547
ヒューリック	17.1	15.4	15,754
野村不動産ホールディングス	5.5	4.9	11,147
ブレサンスコーポレーション	1.3	1	1,492
オープンハウス	1.3	1.2	6,336
東急不動産ホールディングス	19.9	17.9	12,995
飯田グループホールディングス	6.8	6.2	11,984
パーク 2 4	4.5	4.3	13,889
三井不動産	43.6	36.9	90,294

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱地所	61.1	55	98,175
東京建物	9	8.1	10,570
住友不動産	20	18	67,464
レオパレス 2 1	10.2	8.8	5,244
スターツコーポレーション	1.1	1	2,351
イオンモール	5.3	4.8	8,520
エヌ・ティ・ティ都市開発	5.1	4.6	5,497
サービス業 (4.5%)			
ミクシィ	2.3	1.8	4,680
日本M&Aセンター	2.5	5	14,395
パースホルディングス	6.7	6.6	16,308
総合警備保障	3.2	2.8	13,468
カカコム	6.1	5.4	10,794
ディップ	1.1	1	2,573
エムスリー	7.5	7.5	39,075
ディー・エヌ・エー	3.9	3.9	7,324
博報堂D Yホールディングス	12.1	9.9	18,037
電通	—	8.7	43,935
オリエンタルランド	9.4	8.5	99,322
リゾートトラスト	3.4	3	5,331
ユー・エス・エス	10.5	8.7	17,756
サイバーエージェント	5.2	4.4	26,004
楽天	40.8	33.4	26,820
エン・ジャパン	—	0.8	4,024
テクノプロ・ホールディングス	—	1.3	8,853
リクルートホールディングス	—	55.2	188,232
リログループ	4.3	3.9	11,895
カナモト	1.2	1	3,680
セコム	9	7.6	68,483
メイテック	1	0.8	4,272
イオンディライト	1	0.9	3,496
合 計	株 数 ・ 金 額	8,340	6,508
	銘柄数<比率>	400	400
			<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	J P X 日 経 4 0 0	百万円 412	百万円 —

* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成 (2018年9月6日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 14, 093, 708	% 96. 8
コール・ローン等、その他	468, 880	3. 2
投資信託財産総額	14, 562, 588	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 (2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,562,462,178
コール・ローン等	445,550,670
株式(評価額)	14,093,708,620
未収入金	107,464
未収配当金	7,747,426
差入委託証拠金	15,347,998
(B) 負債	50,657,563
未払金	6,709,773
未払解約金	43,947,105
未払利息	685
(C) 純資産総額(A－B)	14,511,804,615
元本	9,774,114,580
次期繰越損益金	4,737,690,035
(D) 受益権総口数	9,774,114,580口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,847円

(注) 期首元本額は10,702,295,189円、期中追加設定元本額は2,968,373,342円、期中一部解約元本額は3,896,553,951円、1口当たり純資産額は1.4847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

- ・野村インデックスファンド・JPX日経400 5,264,747,846円
- ・JPX日経400ファンド 2,619,152,697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) 1,623,083,985円
- ・野村DC・JPX日経400ファンド 267,130,052円

○損益の状況 (2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	305,245,092
受取配当金	305,084,594
その他収益金	324,268
支払利息	△ 163,770
(B) 有価証券売買損益	823,623,481
売買益	1,501,665,623
売買損	△ 678,042,142
(C) 先物取引等取引損益	19,552,357
取引益	73,566,703
取引損	△ 54,014,346
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	1,148,420,930
(E) 前期繰越損益金	3,971,692,844
(F) 追加信託差損益金	1,561,278,095
(G) 解約差損益金	△1,943,701,834
(H) 計(D＋E＋F＋G)	4,737,690,035
次期繰越損益金(H)	4,737,690,035

*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。