野村インデックスファンド・JPX日経400
愛称：Funds-i JPX日経400

運用報告書(全体版)

第２期（決算日2015年９月７日）

作成対象期間（2014年９月９日～2015年９月７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３月７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	野村インデックスファンド・JPX日経400	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	野村インデックスファンド・JPX日経400	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、利子・配当等収益等を中心として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	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	JPX日経インデックス400	期中騰落率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2014年3月7日	10,000	－	－	11,113.92	－	－	－	1
1期(2014年9月8日)	10,696	0	7.0	11,778.63	6.0	99.1	0.8	914
2期(2015年9月7日)	11,924	0	11.5	12,977.78	10.2	97.3	2.7	5,365

＊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「野村インデックスファンド・JPX日経400」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「野村インデックスファンド・JPX日経400」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。

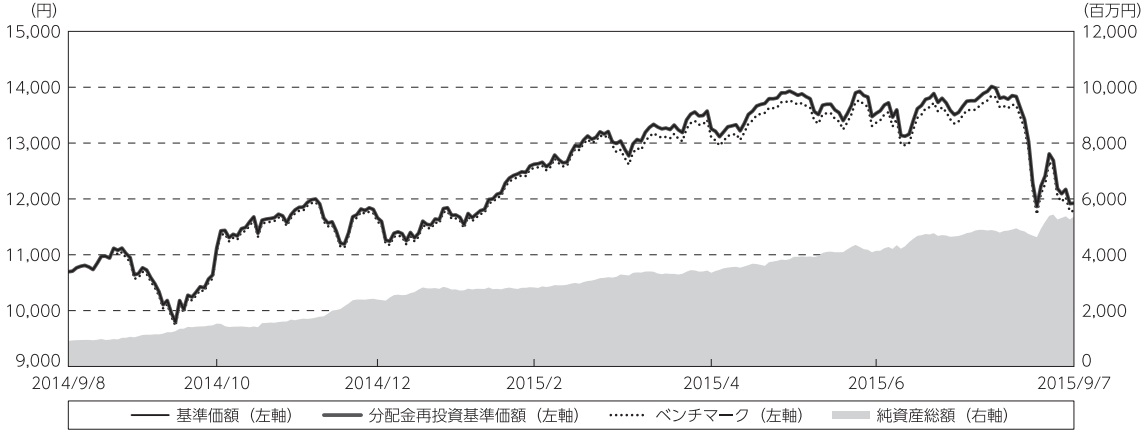
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2014年9月8日	10,696	－	11,778.63	－	99.1	0.8
9月末	11,022	3.0	12,055.67	2.4	98.7	1.3
10月末	11,119	4.0	12,172.62	3.3	98.8	1.1
11月末	11,715	9.5	12,835.53	9.0	99.0	0.9
12月末	11,662	9.0	12,768.42	8.4	99.3	0.7
2015年1月末	11,713	9.5	12,830.17	8.9	99.6	0.4
2月末	12,621	18.0	13,826.67	17.4	99.2	0.7
3月末	12,891	20.5	14,022.96	19.1	97.8	2.2
4月末	13,254	23.9	14,421.55	22.4	97.4	2.6
5月末	13,899	29.9	15,121.12	28.4	98.0	2.0
6月末	13,532	26.5	14,716.19	24.9	97.1	2.8
7月末	13,750	28.6	14,961.66	27.0	97.8	2.1
8月末	12,688	18.6	13,813.71	17.3	97.8	2.2
(期末)						
2015年9月7日	11,924	11.5	12,977.78	10.2	97.3	2.7

＊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：10,696円
期　末：11,924円（既払分配金(税込み)：0円）
騰落率：　11.5%（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９月８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（2014年９月８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10,696円から期末11,924円に1,228円の値上がりとなりました。

日銀が追加金融緩和を決定したことや、世界的な金融緩和が継続していること、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったことなどから、上昇しました。

○投資環境

期首から2014年10月中旬にかけては、世界景気の先行き不透明感やエボラ出血熱の感染拡大が懸念されたことから株式市場は下落しました。

10月下旬以降は、米国の堅調な経済指標を背景に米国株が反転したこと、同月末に日銀が追加金融緩和を決定したことから上昇に転じました。

12月には、為替や原油価格の変動などの影響を受けて株式市場は乱高下する展開となりましたが、2015年１月中旬以降は、世界的な金融緩和が継続していることや、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったこと、国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだことなどから上昇しました。割安感の低下や、利益確定売り圧力の高まりから一時下落する局面があったものの、実質GDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回ったことや、一段と円安が進んだことを受け、５月末まで上昇が続きました。

６月以降は、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況、中国株式市場の急落などを巡り、一進一退の展開となりました。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や、為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり大きく下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村インデックスファンド・JPX日経400]

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＋11.5%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の＋10.2%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。

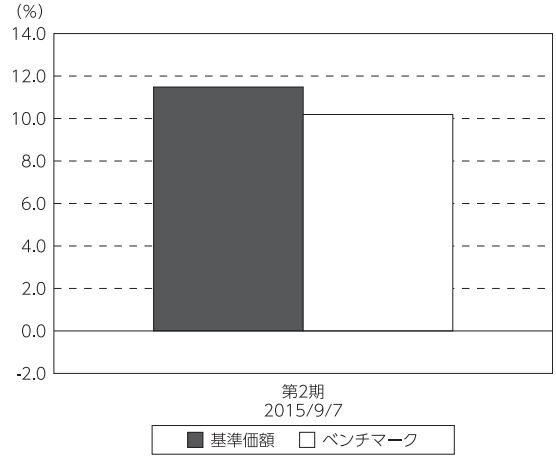
（プラス要因）

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（特に2014年９月、2015年３月に大きく影響）

（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

今期につきましては、基準価額水準等を勘案し収益分配を見送ら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２期 2014年９月９日～ 2015年９月７日
当期分配金	－
（対基準価額比率）	－%
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,924

（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

[野村インデックスファンド・JPX日経400]

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

（2014年９月９日～2015年９月７日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	54	0.431	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(25)	(0.198)	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）	(25)	(0.200)	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）	(4)	(0.032)	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	4	0.030	(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）	(4)	(0.030)	
(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	58	0.464	
期中の平均基準価額は、12,488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

(2014年９月９日～2015年９月７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
	千口	千円	千口	千円
JPX日経400マザーファンド	4,730,654	5,892,172	1,143,264	1,448,615

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年９月９日～2015年９月７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	18,905,983千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,659,832千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.18

＊(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９月９日～2015年９月７日)

利害関係人との取引状況

＜野村インデックスファンド・JPX日経400＞

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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	13,691	438	3.2	5,214	242	4.6

平均保有割合　35.5%

※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	122	44	111

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）	896千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.667千円
（B）／（A）	0.1%

＊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です。

○組入資産の明細

（2015年９月７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	845,894	4,433,284	5,364,717

＊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

（2015年９月７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	5,364,717	99.2
コール・ローン等、その他	41,180	0.8
投資信託財産総額	5,405,897	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９月７日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,405,897,925
コール・ローン等	40,534,131
JPX日経400マザーファンド(評価額)	5,364,717,546
未収入金	646,172
未収利息	76
(B) 負債	40,645,435
未払解約金	31,825,911
未払信託報酬	8,753,935
その他未払費用	65,589
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	5,365,252,490
元本	4,499,456,990
次期繰越損益金	865,795,500
(D) 受益権総口数	4,499,456,990口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,924円

(注) 期首元本額854百万円、期中追加設定元本額6,945百万円、期中一部解約元本額3,300百万円、計算口数当たり純資産額11,924円。

○損益の状況 (2014年９月９日～2015年９月７日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	15,123
受取利息	15,123
(B) 有価証券売買損益	△ 299,301,476
売買益	104,510,924
売買損	△ 403,812,400
(C) 信託報酬等	△ 12,936,651
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 312,223,004
(E) 前期繰越損益金	7,871,948
(F) 追加信託差損益金	1,170,146,556
(配当等相当額)	(210,292,414)
(売買損益相当額)	(959,854,142)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	865,795,500
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	865,795,500
追加信託差損益金	1,170,146,556
(配当等相当額)	(221,214,999)
(売買損益相当額)	(948,931,557)
分配準備積立金	38,707,032
繰越損益金	△ 343,058,088

＊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９月９日～2015年９月７日) は以下の通りです。

項　　目	第２期 2014年９月９日～ 2015年９月７日
a. 配当等収益(経費控除後)	30,835,084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	827,088,468円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,871,948円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	865,795,500円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	1,924円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	0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書面決議の要件緩和等に関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＞

③書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用と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＞

④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５月27日＞

⑤信用リスク集中回避のための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５月27日＞

⑥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＞

JPX日経400マザーファンド

運用報告書

第２期（決算日2015年９月７日）

作成対象期間（2014年９月９日～2015年９月７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		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率	JPX日経インデックス400	期中騰落率			
(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

＊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。

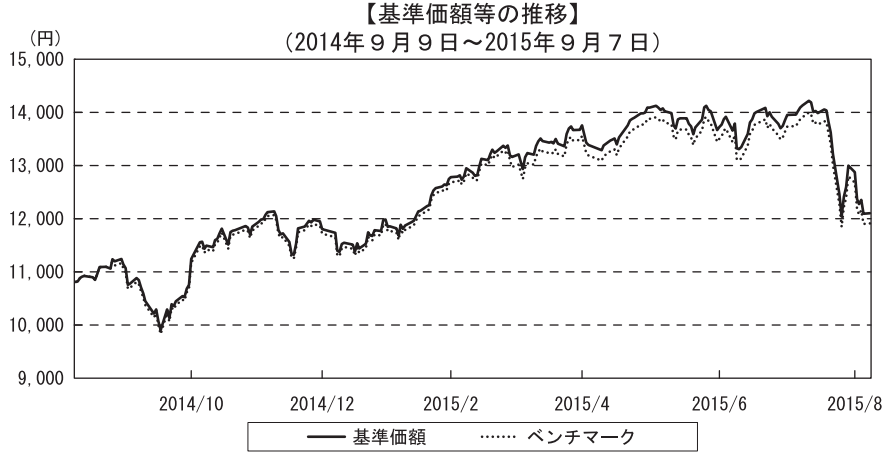
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2014年9月8日	10,808	－	11,778.63	－	99.1	0.8
9月末	11,140	3.1	12,055.67	2.4	98.7	1.3
10月末	11,242	4.0	12,172.62	3.3	98.8	1.1
11月末	11,849	9.6	12,835.53	9.0	99.0	0.9
12月末	11,800	9.2	12,768.42	8.4	99.3	0.7
2015年1月末	11,856	9.7	12,830.17	8.9	99.6	0.4
2月末	12,779	18.2	13,826.67	17.4	99.2	0.7
3月末	13,057	20.8	14,022.96	19.1	97.8	2.2
4月末	13,430	24.3	14,421.55	22.4	97.4	2.6
5月末	14,088	30.3	15,121.12	28.4	98.0	2.0
6月末	13,722	27.0	14,716.19	24.9	97.1	2.8
7月末	13,948	29.1	14,961.66	27.0	97.9	2.1
8月末	12,875	19.1	13,813.71	17.3	97.8	2.2
(期末)						
2015年9月7日	12,101	12.0	12,977.78	10.2	97.3	2.7

＊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10,808円から期末12,101円に1,293円の値上がりとなりました。

日銀が追加金融緩和を決定したことや、世界的な金融緩和が継続していること、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったことなどから、上昇しました。

○投資環境

期首から2014年10月中旬にかけては、世界景気の先行き不透明感やエボラ出血熱の感染拡大が懸念されたことから株式市場は下落しました。

10月下旬以降は、米国の堅調な経済指標を背景に米国株が反転したこと、同月末に日銀が追加金融緩和を決定したことから上昇に転じました。

12月には、為替や原油価格の変動などの影響を受けて株式市場は乱高下する展開となりましたが、2015年１月中旬以降は、世界的な金融緩和が継続していることや、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったこと、国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだことなどから上昇しました。割安感の低下や、利益確定売り圧力の高まりから一時下落する局面があったものの、実質GDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回ったことや、一段と円安が進んだことを受け、５月末まで上昇が続きました。

６月以降は、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況、中国株式市場の急落などを巡り、一進一退の展開となりました。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や、為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり大きく下落しました。

○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

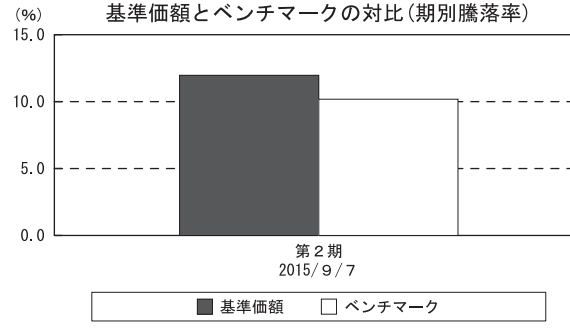
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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＋12.0%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の＋10.2%を1.8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（特に2014年９月、2015年３月に大きく影響）



（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

(2014年９月９日～2015年９月７日)

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	4	0.028	(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）	(4)	(0.028)	
合計	4	0.028	
期中の平均基準価額は、12,648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

(2014年９月９日～2015年９月７日)

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	9,651 (71)	13,691,134 (－)	3,732	5,214,849

＊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 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	15,051	14,736	－	－

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

（2014年９月９日～2015年９月７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	18,905,983千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,659,832千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.18

＊(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９月９日～2015年９月７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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	13,691	438	3.2	5,214	242	4.6

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	122	44	111

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)	2,431千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) ／ (A)	0.1%

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９月７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
鉱業（0.4%）			
国際石油開発帝石	12.8	45.6	51,984
建設業（2.8%）			
安藤・間	1.8	5.8	4,280
コムシスホールディングス	1.3	3.9	5,561
ミサワホーム	0.3	1	780
大成建設	13	45	34,740
大林組	－	26	26,416
清水建設	－	26	29,016
長谷工コーポレーション	3.5	10.8	14,353
鹿島建設	12	38	25,346
三井住友建設	－	35.1	5,159
大東建託	1	3.2	37,568
ＮＩＰＰＯ	1	2	3,970
住友林業	1.8	6.4	8,128
大和ハウス工業	7.2	25.5	69,768
積水ハウス	7.1	27.2	45,818
協和エクシオ	1	3.7	4,292
日揮	3	9	15,354
東芝プラントシステム	0.4	－	－
千代田化工建設	2	6	5,040
食料品（4.7%）			
日清製粉グループ本社	2.6	－	－
カルビー	1	3.2	13,136
ヤクルト本社	1.5	4.6	27,508
明治ホールディングス	0.8	2.6	46,124
日本ハム	2	6	15,564
アサヒグループホールディングス	5.3	16.2	58,951
キリンホールディングス	11.2	35.1	59,178
伊藤園	0.7	2.6	6,357
キッコーマン	2	7	24,360
味の素	6	20	50,680
キユーピー	1.3	4.4	10,665
ニチレイ	3	9	6,138
東洋水産	1	4.5	19,732
日清食品ホールディングス	1	3.7	19,314
日本たばこ産業	12.6	50.3	207,638
繊維製品（0.5%）			
東レ	18	63	63,220
パルプ・紙（0.2%）			
王子ホールディングス	11	33	17,622
大王製紙	－	4	4,160
化学（6.3%）			
クラレ	3.9	12.8	17,408
旭化成	15	50	43,940
昭和電工	16	－	－
住友化学	－	60	34,080
日産化学工業	1.6	5.2	13,478
東ソー	7	22	11,968
東亞合成	3	－	－
電気化学工業	5	17	8,075
信越化学工業	4.4	14.5	89,900
エア・ウォーター	2	7	12,327
大陽日酸	3	10.4	13,041
日本パーカライジング	0.6	3.8	3,705
日本触媒	2	－	－
ＪＳＲ	2.3	8	14,208
三菱ケミカルホールディングス	15.3	50.6	32,125
日本合成化学工業	1	2	1,514
ダイセル	3	11.4	16,473
積水化学工業	5	19	24,168
日本ゼオン	2	7	6,258
アイカ工業	0.7	2.4	5,522
宇部興産	12	41	8,569
日立化成	1.1	4	6,860
日本化薬	2	5	6,490
日油	－	7	5,761
花王	6.8	21.8	112,967

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ペイントホールディングス	2	7	15,960
関西ペイント	3	10	17,000
ＤＩＣ	10	32	8,480
東洋インキＳＣホールディングス	2	－	－
富士フイルムホールディングス	5.6	18.5	86,774
資生堂	4.4	14.4	33,444
コーセー	－	1.3	13,767
ドクターシーラボ	0.2	1.1	2,230
小林製薬	0.4	1.3	11,063
日東電工	2	6.3	47,010
エフピコ	0.3	－	－
ニフコ	0.5	1.8	7,452
ユニ・チャーム	1.5	16.4	36,514
医薬品（6.8%）			
協和発酵キリン	3	10	19,170
武田薬品工業	9.2	30.3	172,104
アステラス製薬	28	90.6	151,755
塩野義製薬	3.8	12.6	59,283
田辺三菱製薬	2	9.4	19,711
中外製薬	2.4	8.1	34,303
科研製薬	1	3	17,280
エーザイ	3	10.7	84,166
ロート製薬	1	3.7	6,882
小野薬品工業	1.1	3.7	57,350
久光製薬	0.8	2.3	9,637
持田製薬	0.2	0.6	4,512
参天製薬	0.9	14.9	26,507
ツムラ	0.7	2.5	6,817
沢井製薬	0.4	1.3	9,347
第一三共	7.7	27.2	59,540
キョーリン製薬ホールディングス	0.7	2.2	4,393
大塚ホールディングス	4.9	17.4	69,008
大正製薬ホールディングス	0.6	1.9	14,098
石油・石炭製品（0.1%）			
昭和シェル石油	2.2	8.1	7,751
東燃ゼネラル石油	4	－	－
出光興産	1.2	－	－
ＪＸホールディングス	27.2	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゴム製品（1.1%）			
横浜ゴム	3	4.9	9,947
東洋ゴム工業	1.1	3.7	8,920
ブリヂストン	7.7	27.3	105,883
住友ゴム工業	1.9	7.6	12,061
ガラス・土石製品（0.9%）			
旭硝子	12	43	29,584
日本電気硝子	5	－	－
太平洋セメント	14	50	19,700
ＴＯＴＯ	4	12	19,296
日本碍子	－	10	24,290
日本特殊陶業	2.1	7	19,320
ニチアス	1	－	－
鉄鋼（1.3%）			
新日鐵住金	104	345	82,489
神戸製鋼所	－	140	21,280
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	6.3	20.6	36,173
大同特殊鋼	4	－	－
日立金属	2	8.2	11,857
非鉄金属（0.9%）			
三井金属鉱業	6	22	5,082
三菱マテリアル	15	50	18,350
住友金属鉱山	6	22	31,207
ＤＯＷＡホールディングス	3	10	9,840
住友電気工業	9.2	30.5	47,153
アサヒホールディングス	0.4	1.2	2,140
金属製品（0.2%）			
三和ホールディングス	－	7.6	6,520
三協立山	－	1.1	1,896
ＬＩＸＩＬグループ	3.4	－	－
リンナイ	0.4	1.5	13,305
ジーテクト	0.2	－	－
日本発條	2	7	7,742
機械（4.6%）			
日本製鋼所	4	－	－
オーエスジー	1.1	3.7	7,995
ディスコ	0.3	0.9	7,749
ニューフレアテクノロジー	－	0.1	443

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ナブテスコ	1.1	4.9	11,216
ＳＭＣ	0.7	2.4	63,960
小松製作所	11.4	39.6	78,111
住友重機械工業	7	22	11,506
日立建機	1.3	3.6	6,181
クボタ	13	39	71,604
荏原製作所	5	17	7,854
ダイキン工業	3.2	11.3	77,066
栗田工業	1.5	－	－
椿本チエイン	1	4	3,508
タダノ	1	4	5,768
平和	0.5	2.3	4,979
ＳＡＮＫＹＯ	0.7	－	－
ユニバーサルエンターテインメント	0.2	0.8	1,689
セガサミーホールディングス	2.5	8.3	9,976
ＴＰＲ	0.3	0.9	2,346
ホシザキ電機	0.7	2.3	17,135
日本精工	5	15.9	21,401
ジェイテクト	2.5	8.2	13,464
不二越	2	7	3,689
ＴＨＫ	1.5	5.1	10,337
イーグル工業	－	1.1	2,401
マキタ	1.5	5	33,050
三菱重工業	42	130	70,161
ＩＨＩ	17	56	19,488
電気機器（12.5%）			
コニカミノルタ	6.2	18.1	22,570
ブラザー工業	3	10	15,750
ミネベア	3	11	15,598
日立製作所	56	186	117,552
東芝	46	－	－
三菱電機	23	77	87,587
富士電機	7	21	9,513
安川電機	2.6	9.5	12,103
日本電産	2.5	8.5	76,814
オムロン	2.6	8.3	32,909
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5	－	－
日本電気	－	100	38,000
富士通	23	74	42,017
沖電気工業	10	27	5,400
セイコーエプソン	1.6	10.5	19,215
ワコム	1.8	6.1	2,580
パナソニック	26.8	94.6	118,108
アンリツ	1.4	4.6	3,468
富士通ゼネラル	1	2	2,808
日立国際電気	－	2	2,830
ＴＤＫ	1.4	4.7	33,088
アルプス電気	－	6.3	22,806
ヒロセ電機	0.4	1.3	16,874
日本航空電子工業	－	2	3,832
横河電機	2.5	7.7	10,271
日本光電工業	0.5	3.2	6,745
堀場製作所	0.4	1.4	5,544
キーエンス	0.5	1.8	94,806
シスメックス	2	6	41,400
スタンレー電気	1.7	5.5	11,825
カシオ計算機	2.3	7.7	16,724
ファナック	2.6	8	157,840
エンプラス	－	0.3	1,200
浜松ホトニクス	1	6	17,202
京セラ	4.1	12.7	73,190
村田製作所	2.5	8.1	128,911
小糸製作所	1.3	4.6	17,066
ミツバ	0.4	1.4	2,557
キヤノン	13.6	41.6	153,296
リコー	7	23.2	28,744
東京エレクトロン	－	6.5	40,592
輸送用機器（9.0%）			
トヨタ紡織	0.8	2.7	5,143
ユニプレス	0.4	1.5	3,015
豊田自動織機	2.1	7	39,970
デンソー	5.8	19.1	98,899
東海理化電機製作所	－	2	4,766
三井造船	9	30	5,250
川崎重工業	18	56	24,192
名村造船所	0.5	2.2	1,740

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産自動車	32.9	108.5	115,010
いすゞ自動車	14	24.4	30,914
トヨタ自動車	7.6	25.1	177,933
日野自動車	2.9	11	13,915
三菱自動車工業	8.4	28.3	26,092
ＮＯＫ	1.1	3.7	9,927
カヤバ工業	2	－	－
カルソニックカンセイ	2	6	4,620
アイシン精機	2.1	7.1	28,222
マツダ	7	23	41,883
ダイハツ工業	2.5	9.2	12,990
本田技研工業	13.1	51.9	189,383
スズキ	4.9	16.2	62,159
富士重工業	8	26.3	106,067
ヤマハ発動機	3.6	10.9	24,426
エクセディ	0.3	1	2,600
豊田合成	0.8	2.5	5,672
日本精機	－	2	4,412
エフ・シー・シー	0.4	－	－
シマノ	1	3.1	48,825
テイ・エス　テック	0.5	1.6	4,848
精密機器（1.6%）			
テルモ	3.6	11.8	37,052
ニコン	4.4	14.4	21,096
トプコン	－	2.3	3,988
オリンパス	－	11.5	46,920
ＨＯＹＡ	5.7	18.4	78,641
セイコーホールディングス	－	5	3,545
その他製品（0.7%）			
バンダイナムコホールディングス	2.6	8.5	23,094
パイロットコーポレーション	－	1.3	6,643
アシックス	2.3	7.2	24,084
ヤマハ	－	5.7	14,643
ピジョン	0.4	4.4	13,164
電気・ガス業（0.9%）			
電源開発	1.5	5.6	20,636
東京瓦斯	27	94	57,593
大阪瓦斯	24	80	36,336

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
陸運業（5.3%）			
東武鉄道	13	41	20,910
相鉄ホールディングス	5	18	11,682
東京急行電鉄	14	42	35,280
小田急電鉄	8	25	26,450
京王電鉄	7	22	18,678
京成電鉄	4	12	14,844
東日本旅客鉄道	4.3	14.2	148,177
西日本旅客鉄道	2.1	7.4	57,150
東海旅客鉄道	2.1	6.9	130,375
西日本鉄道	4	13	7,631
近鉄グループホールディングス	24	78	33,072
阪急阪神ホールディングス	16	52	38,584
南海電気鉄道	－	23	13,294
京阪電気鉄道	7	23	17,388
名古屋鉄道	11	38	17,632
日本通運	9	30	17,310
ヤマトホールディングス	4.3	13.6	30,804
山九	3	9	5,193
日立物流	0.5	－	－
海運業（0.2%）			
日本郵船	－	65	19,565
空運業（0.4%）			
ＡＮＡホールディングス	46	152	51,208
倉庫・運輸関連業（0.0%）			
上組	3	－	－
近鉄エクスプレス	0.2	0.7	2,992
情報・通信業（7.8%）			
グリー	1.4	4.6	2,484
ネクソン	－	7.2	11,383
ティーガイア	0.2	0.8	1,474
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5.9	17.8	6,105
インターネットイニシアティブ	0.3	－	－
野村総合研究所	1.3	4.3	20,575
フジ・メディア・ホールディングス	2.2	7.9	11,044
オービック	0.8	2.6	12,987
ヤフー	16.6	54.7	25,599
トレンドマイクロ	1.2	3.7	15,817

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本オラクル	0.4	1.2	5,802
伊藤忠テクノソリューションズ	0.3	1.7	4,231
大塚商会	0.6	2.1	13,083
ＵＳＥＮ	1.4	3.5	1,057
エイベックス・グループ・ホールディングス	0.4	1.5	2,179
日本テレビホールディングス	2.3	7	13,622
日本電信電話	7.4	46.4	210,980
ＫＤＤＩ	7.2	69.6	205,215
光通信	0.2	0.7	5,439
ＮＴＴドコモ	19.1	58.8	143,060
ＧＭＯインターネット	0.8	2.8	4,233
東宝	1.7	5.4	14,245
エヌ・ティ・ティ・データ	1.6	4.7	26,273
ＳＣＳＫ	0.6	1.8	7,326
コナミ	1	－	－
ソフトバンクグループ	6.2	28.5	180,234
卸売業（4.4%）			
双日	15.5	51	12,087
アルフレッサ　ホールディングス	0.7	9	19,080
シップヘルスケアホールディングス	0.3	1.4	3,523
三菱食品	0.3	－	－
第一興商	0.5	1.8	7,884
メディパルホールディングス	2.3	7.6	15,458
伊藤忠商事	18.5	63.8	87,374
丸紅	20.2	66.7	42,247
豊田通商	2.6	8.5	22,780
兼松	5	15	2,565
三井物産	20.9	64.7	98,635
日立ハイテクノロジーズ	0.7	2.6	6,632
山善	0.9	－	－
住友商事	13.7	45	55,102
三菱商事	17.7	58.4	123,808
岩谷産業	3	8	5,480
東邦ホールディングス	0.7	2.6	6,895
サンリオ	0.6	2.1	7,287
日鉄住金物産	2	7	2,674
ミスミグループ本社	0.9	8.6	11,162

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
小売業（4.8%）			
ローソン	0.9	2.9	23,751
エービーシー・マート	0.3	1.1	7,436
ゲオホールディングス	0.4	1.4	2,419
日本マクドナルドホールディングス	1	－	－
スターバックス　コーヒー　ジャパン	0.5	－	－
パル	0.1	－	－
セリア	0.3	0.9	4,536
ＭｏｎｏｔａＲＯ	0.4	1.3	6,643
Ｊ．フロント　リテイリング	2.7	9.6	16,675
マツモトキヨシホールディングス	0.5	1.7	8,687
スタートトゥデイ	0.7	2.4	8,148
三越伊勢丹ホールディングス	4.6	15.2	26,721
ウエルシアホールディングス	0.3	1	5,500
コスモス薬品	0.1	0.4	5,336
セブン&アイ・ホールディングス	9.7	31.9	158,383
ツルハホールディングス	0.5	1.6	14,800
良品計画	0.2	0.9	21,663
ドンキホーテホールディングス	0.8	4.9	20,776
ＶＴホールディングス	0.9	3.2	2,099
ユナイテッドアローズ	0.3	1	4,340
スギホールディングス	0.4	1.4	7,518
ファミリーマート	0.8	2.6	13,442
日本瓦斯	－	1.6	5,568
ＡＯＫＩホールディングス	0.4	1.8	2,476
コメリ	0.4	－	－
しまむら	0.3	0.9	9,675
高島屋	3	11	10,285
イオン	9.2	31.4	53,537
ユニーグループ・ホールディングス	2.2	－	－
イズミ	0.5	1.7	8,092
ヤオコー	－	0.9	4,896
ケーズホールディングス	0.5	1.8	6,498
アインファーマシーズ	0.1	0.9	4,572
ヤマダ電機	9.1	－	－
ニトリホールディングス	0.9	3.3	30,822
王将フードサービス	0.2	－	－
アークス	0.5	－	－

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バロー	0.5	1.6	4,684
ファーストリテイリング	0.5	1.5	69,997
サンドラッグ	0.5	1.6	9,824
銀行業（8.0%）			
新生銀行	20	73	17,812
あおぞら銀行	12	51	20,961
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	74.9	233.8	172,918
りそなホールディングス	22	89.2	50,844
三井住友トラスト・ホールディングス	45	169	76,675
三井住友フィナンシャルグループ	11	37.7	173,476
西日本シティ銀行	8	27	8,343
千葉銀行	9	29	24,331
横浜銀行	15	51	36,485
常陽銀行	8	28	17,388
群馬銀行	5	18	14,004
ふくおかフィナンシャルグループ	9	31	17,639
静岡銀行	7	22	27,830
十六銀行	4	13	6,214
スルガ銀行	2.3	8.1	18,233
八十二銀行	6	18	14,328
ほくほくフィナンシャルグループ	16	52	13,780
広島銀行	7	23	15,157
中国銀行	2.2	7.2	12,326
伊予銀行	3.3	10.9	14,180
セブン銀行	8.7	25.7	12,618
みずほフィナンシャルグループ	223.6	780.9	180,075
山口フィナンシャルグループ	3	10	14,380
北洋銀行	3.5	11.5	5,313
京葉銀行	3	8	4,824
証券、商品先物取引業（1.7%）			
ＳＢＩホールディングス	－	9.2	12,208
ジャフコ	－	1	4,890
大和証券グループ本社	23	71	55,145
野村ホールディングス	47.3	155.9	111,187
岡三証券グループ	2	6	4,188
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2.5	8.8	6,230
松井証券	1.2	3.9	3,864
カブドットコム証券	－	6.8	2,461

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
保険業（3.7%）			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	－	16.9	63,721
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	－	24.3	89,035
ソニーフィナンシャルホールディングス	2.2	7.3	15,673
第一生命保険	13.8	48.9	98,875
東京海上ホールディングス	9	30.9	140,656
Ｔ＆Ｄホールディングス	7.9	27.8	41,964
その他金融業（1.5%）			
クレディセゾン	1.9	6.2	13,826
芙蓉総合リース	0.2	0.8	3,508
興銀リース	0.4	1.4	3,285
東京センチュリーリース	0.5	1.8	6,336
Ｊトラスト	0.6	－	－
アイフル	4.2	－	－
リコーリース	0.2	－	－
イオンフィナンシャルサービス	1.4	5	12,150
アコム	4.6	15.3	7,787
日立キャピタル	0.5	1.5	4,092
オリックス	14.5	54	80,325
三菱ＵＦＪリース	5.9	19.3	10,460
日本取引所グループ	3.4	11.2	38,248
不動産業（3.5%）			
ヒューリック	3.9	15.9	15,550
野村不動産ホールディングス	1.5	4.6	9,650
プレサンスコーポレーション	－	0.3	1,306
東急不動産ホールディングス	5.1	20	15,540
飯田グループホールディングス	1	4.9	9,241
パーク２４	1.2	3.8	8,941
三井不動産	12	40	125,180
三菱地所	16	57	138,139
東京建物	－	8.3	11,395
住友不動産	6	18	66,564
大京	4	12	2,184
レオパレス２１	2.7	8.3	4,291
スターツコーポレーション	－	1.2	2,160
住友不動産販売	0.2	0.5	1,512
タカラレーベン	0.8	3.4	1,703
イオンモール	1.5	4.9	9,163

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ都市開発	1.4	4.7	4,949
サービス業（3.2%）			
ミクシィ	－	1.8	7,002
日本M&Aセンター	－	1.2	5,742
アコーディア・ゴルフ	1	－	－
テンプホールディングス	0.5	1.6	7,608
クックパッド	－	1.8	3,918
綜合警備保障	－	2.7	13,905
カカクコム	1.5	5.3	9,465
エムスリー	1.6	7	17,115
ディー・エヌ・エー	1.3	4	8,744
博報堂ＤＹホールディングス	3.4	11.2	12,611
電通	2.3	9	51,210
みらかホールディングス	0.6	2.1	10,311
オリエンタルランド	0.7	8.7	54,514
リゾートトラスト	0.8	3.1	9,048
もしもしホットライン	0.5	－	－
ユー・エス・エス	3	9.8	19,227
サイバーエージェント	0.6	2	8,470
楽天	10.6	37.7	60,131
リロ・ホールディング	0.1	0.4	4,380
エイチ・アイ・エス	0.4	1.3	4,803
カナモト	－	1.1	2,767
セコム	2.5	7.8	58,570
ベネッセホールディングス	0.8	2.9	9,135
イオンディライト	0.2	0.8	2,840
合計 株数・金額	2,450	8,440	12,119,272
合計 銘柄数＜比率＞	397	400	＜97.3%＞

＊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。
＊－印は組み入れなし。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＪＰＸ日経４００	330	－

＊単位未満は切り捨て。
＊－印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

（2015年９月７日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	12,119,272	95.4
コール・ローン等、その他	589,499	4.6
投資信託財産総額	12,708,771	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９月７日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,707,321,409
コール・ローン等	559,950,937
株式(評価額)	12,119,272,170
未収入金	224,352
未収配当金	4,857,900
未収利息	1,050
差入委託証拠金	23,015,000
(B) 負債	253,351,961
未払金	224,674,460
未払解約金	28,677,501
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	12,453,969,448
元本	10,292,035,414
次期繰越損益金	2,161,934,034
(D) 受益権総口数	10,292,035,414口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	12,101円

(注) 期首元本額2,977百万円、期中追加設定元本額12,295百万円、期中一部解約元本額4,981百万円、計算口数当たり純資産額12,101円。

(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　5,600百万円
- 野村インデックスファンド・JPX日経400　4,433百万円
- 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)　257百万円
- 野村DC・JPX日経400ファンド　0百万円

○損益の状況 (2014年９月９日～2015年９月７日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	127,088,330
受取配当金	126,828,803
受取利息	196,160
その他収益金	63,367
(B) 有価証券売買損益	452,722,097
売買益	1,112,343,830
売買損	△ 659,621,733
(C) 先物取引等取引損益	△ 10,640,684
取引益	126,316,558
取引損	△ 136,957,242
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	569,169,743
(E) 前期繰越損益金	240,687,994
(F) 追加信託差損益金	2,742,258,000
(G) 解約差損益金	△1,390,181,703
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	2,161,934,034
次期繰越損益金(Ｈ)	2,161,934,034

＊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

①書面決議の要件緩和等に関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書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用と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＞

③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２月６日＞

④信用リスク集中回避のための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２月６日＞

⑤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＞