

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7期（決算日2020年9月7日）

作成対象期間（2019年9月7日～2020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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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 (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 分	込 配	み 金	期 騰 落	中 率			
	円			円		%	%	%	百万円
3期(2016年9月6日)	11,345			0	△ 4.9	12,160.56	△ 6.3	98.2	7,419
4期(2017年9月6日)	13,394			0	18.1	14,113.10	16.1	98.3	7,499
5期(2018年9月6日)	14,440			0	7.8	14,960.51	6.0	97.1	7,817
6期(2019年9月6日)	13,536			0	△ 6.3	13,748.91	△ 8.1	97.9	8,395
7期(2020年9月7日)	14,630			0	8.1	14,546.93	5.8	98.2	7,509

*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	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) 2019年9月6日	円 13,536	% —	13,748.91	% —	% 97.9	% 2.1
9月末	14,109	4.2	14,201.08	3.3	98.0	2.0
10月末	14,811	9.4	14,913.13	8.5	98.1	1.8
11月末	15,078	11.4	15,183.29	10.4	98.6	1.4
12月末	15,289	13.0	15,376.38	11.8	98.4	1.6
2020年1月末	15,000	10.8	15,091.79	9.8	98.5	1.5
2月末	13,503	△ 0.2	13,584.28	△ 1.2	97.9	2.1
3月末	12,652	△ 6.5	12,573.18	△ 8.6	97.4	2.6
4月末	13,203	△ 2.5	13,127.34	△ 4.5	97.1	2.8
5月末	14,155	4.6	14,078.89	2.4	98.0	2.0
6月末	14,143	4.5	14,049.87	2.2	97.8	2.1
7月末	13,583	0.3	13,498.21	△ 1.8	97.9	2.0
8月末	14,697	8.6	14,611.26	6.3	98.8	1.2
(期 末) 2020年9月7日	14,630	8.1	14,546.93	5.8	98.2	1.8

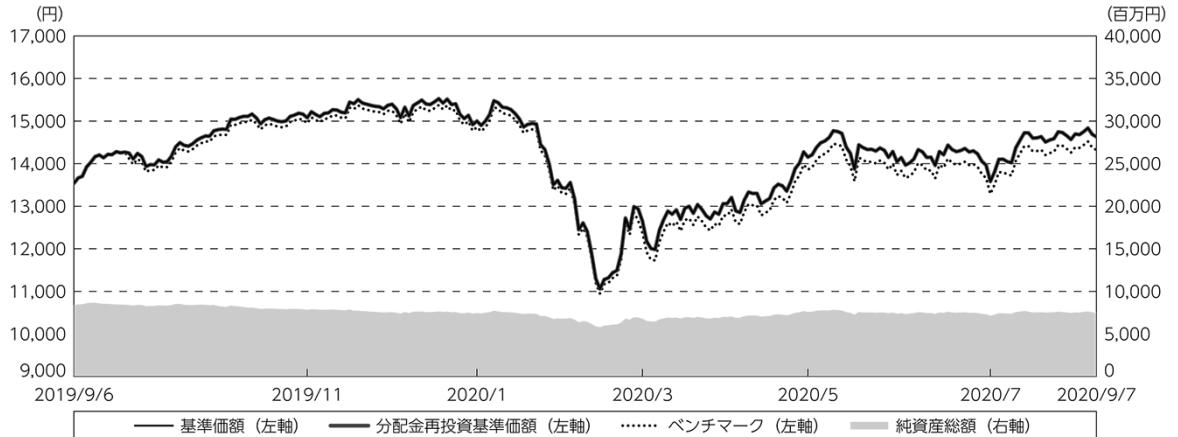
*騰落率は期首比です。

*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



- (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(2019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(2019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

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて、国内株式市場は下落しましたが、ワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから上昇したことにより、基準価額は上昇しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首より米中貿易協議において歩み寄りが見られたことや、日米企業の2019年7-9月期決算が事前予想に対して良好な滑り出しとなったことなどから上昇しました。その後も米中貿易協議の進展への期待が続いたこと、英国の総選挙において保守党が大勝し英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が薄らいだことなどから堅調に推移しました。

2020年1月中旬以降、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大が世界景気に悪影響をもたらすとの見方から軟調に推移し、2月下旬以降は、世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて大きく下落しました。3月下旬に、各国中央銀行が金融市場への大規模な下支え策を発表したことで先行きに対する過度な不安が和らいだことなどを受けて上昇に転じました。5月下旬以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから一段と上昇しました。

○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+8.1%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+5.8%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。

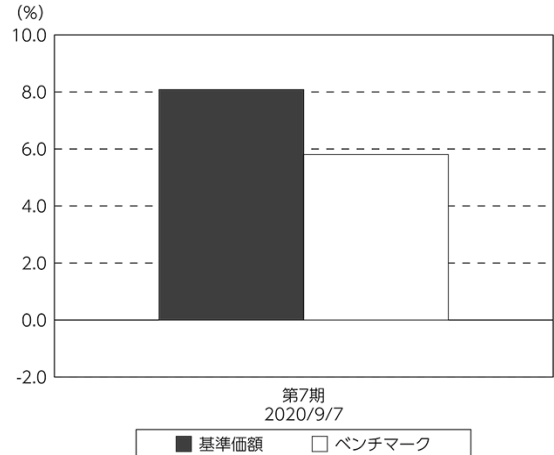
(プラス要因)

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

(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7期
	2019年9月7日～ 2020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	4,629

(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

(2019年 9 月 7 日～2020年 9 月 7 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 63	% 0.441	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(29)	(0.204)	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)	(29)	(0.204)	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)	(5)	(0.033)	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	65	0.455	
期中の平均基準価額は、14,185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。

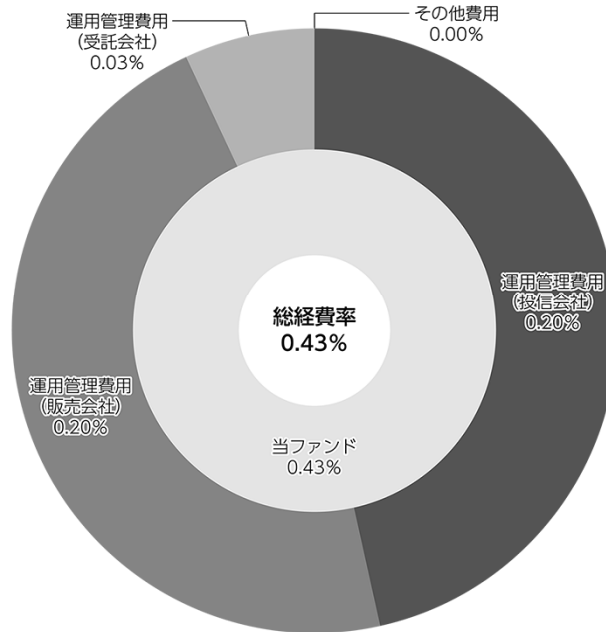
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.43%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年9月7日～2020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	1,016,073	1,422,218	2,073,616	3,142,196

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年9月7日～2020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	5,030,062千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,004,265千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45

* (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

(2019年9月7日～2020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			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	1,213	4	0.3	3,816	16	0.4

平均保有割合 66.7%

※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 5	百万円 16	百万円 57

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

(2020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
JPX日経400マザーファンド	千口 6,005,830	千口 4,948,287	千円 7,509,026

*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

(2020年9月7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 7,509,026	% 99.3
コール・ローン等、その他	54,809	0.7
投資信託財産総額	7,563,835	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 (2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,563,835,065
コール・ローン等	31,724,249
JPX日経400マザーファンド(評価額)	7,509,026,278
未収入金	23,084,538
(B) 負債	54,056,109
未払解約金	37,958,354
未払信託報酬	15,977,940
未払利息	45
その他未払費用	119,770
(C) 純資産総額(A－B)	7,509,778,956
元本	5,133,153,332
次期繰越損益金	2,376,625,624
(D) 受益権総口数	5,133,153,332口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,630円

(注) 期首元本額は6,202,540,939円、期中追加設定元本額は2,023,439,788円、期中一部解約元本額は3,092,827,395円、1口当たり純資産額は1.4630円です。

○損益の状況 (2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 7,515
支払利息	△ 7,515
(B) 有価証券売買損益	550,442,873
売買益	816,171,505
売買損	△ 265,728,632
(C) 信託報酬等	△ 33,425,377
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	517,009,981
(E) 前期繰越損益金	△ 44,644,448
(F) 追加信託差損益金	1,904,260,091
(配当等相当額)	(878,398,132)
(売買損益相当額)	(1,025,861,959)
(G) 計(D＋E＋F)	2,376,625,624
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	2,376,625,624
追加信託差損益金	1,904,260,091
(配当等相当額)	(887,703,084)
(売買損益相当額)	(1,016,557,007)
分配準備積立金	472,365,533

*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(2019年9月7日～2020年9月7日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2019年9月7日～ 2020年9月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	171,203,408円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	10,919,478円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,904,260,091円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	290,242,647円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	2,376,625,624円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,629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

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7期（決算日2020年9月7日）

作成対象期間（2019年9月7日～2020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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

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
		騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
6期(2019年9月6日)	13,978	△ 5.9	13,748.91	△ 8.1	97.9	2.1	12,785
7期(2020年9月7日)	15,175	8.6	14,546.93	5.8	98.2	1.8	11,065

*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

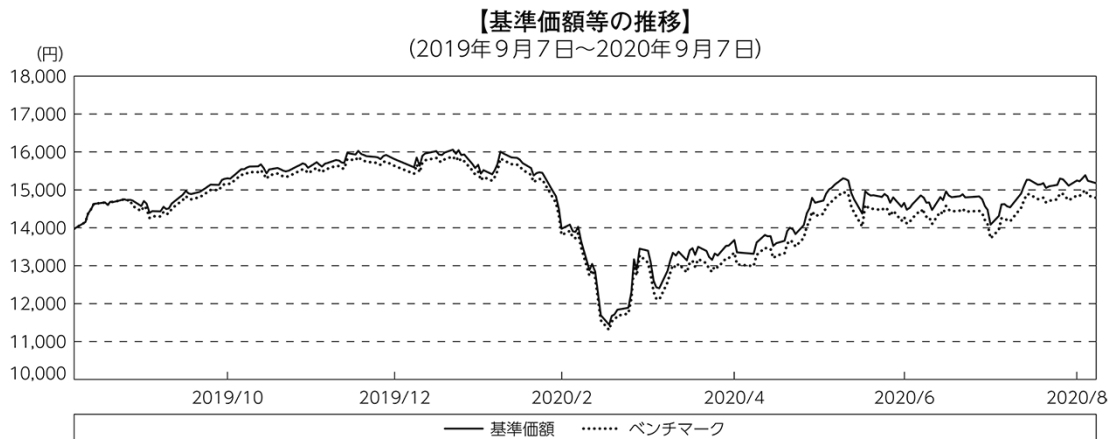
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
		騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2019年9月6日	13,978	—	13,748.91	—	97.9	2.1
9月末	14,574	4.3	14,201.08	3.3	98.0	2.0
10月末	15,305	9.5	14,913.13	8.5	98.1	1.8
11月末	15,586	11.5	15,183.29	10.4	98.6	1.4
12月末	15,810	13.1	15,376.38	11.8	98.4	1.6
2020年1月末	15,518	11.0	15,091.79	9.8	98.5	1.5
2月末	13,973	△ 0.0	13,584.28	△ 1.2	97.9	2.1
3月末	13,098	△ 6.3	12,573.18	△ 8.6	97.4	2.6
4月末	13,673	△ 2.2	13,127.34	△ 4.5	97.1	2.8
5月末	14,664	4.9	14,078.89	2.4	98.0	2.0
6月末	14,658	4.9	14,049.87	2.2	97.8	2.1
7月末	14,082	0.7	13,498.21	△ 1.8	97.9	2.0
8月末	15,243	9.0	14,611.26	6.3	98.8	1.2
(期 末)						
2020年9月7日	15,175	8.6	14,546.93	5.8	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

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて、国内株式市場は下落しましたが、ワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから上昇したことにより、基準価額は上昇しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首より米中貿易協議において歩み寄りが見られたことや、日米企業の2019年7～9月期決算が事前予想に対して良好な滑り出しとなったことなどから上昇しました。その後も米中貿易協議の進展への期待が続いたこと、英国の総選挙において保守党が大勝し英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が薄らいだことなどから堅調に推移しました。

2020年1月中旬以降、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大が世界景気に悪影響をもたらすとの見方から軟調に推移し、2月下旬以降は、世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて大きく下落しました。3月下旬に、各国中央銀行が金融市場への大規模な下支え策を発表したことで先行きに対する過度な不安が和らいだことなどを受けて上昇に転じました。5月下旬以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから一段と上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

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

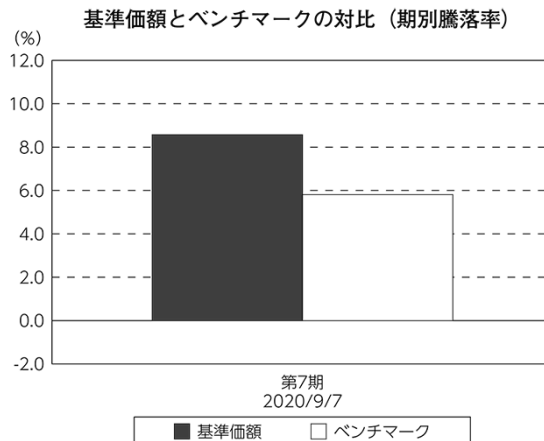
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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+8.6%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+5.8%を2.8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



（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

(2019年 9 月 7 日～2020年 9 月 7 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.011	(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)	(0.011)	
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、14,682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

(2019年 9 月 7 日～2020年 9 月 7 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 658 (63)	千円 1,213,787 ()	千株 1,699	千円 3,816,274

*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 5,349	百万円 5,456	百万円 －	百万円 －

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年9月7日～2020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	5,030,062千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,004,265千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.45

* (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

(2019年9月7日～2020年9月7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 1,213	百万円 4	% 0.3	百万円 3,816	百万円 16	% 0.4

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 5	百万円 16	百万円 57

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

(2020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
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	10	8.4	3,813
マルハニチロ	1.4	1.2	2,803
鉱業 (0.2%)			
国際石油開発帝石	40.1	30.9	19,779
建設業 (2.4%)			
安藤・間	6.4	5	3,530
東急建設	2.9	2.5	1,192
コムシスホールディングス	3.5	3	8,526
大成建設	8.2	6.5	23,367
大林組	24.7	19.4	19,361
清水建設	25.2	19.7	15,720
長谷工コーポレーション	10.3	7.5	10,822
鹿島建設	19.3	15.2	19,744
西松建設	1.8	1.5	2,980
三井住友建設	5.9	4.7	2,006
前田建設工業	5.9	4.9	3,572
戸田建設	9.6	8.1	5,475
熊谷組	1.2	0.9	2,390
大東建託	2.9	2.1	19,748
N I P P O	2.2	1.6	4,334
五洋建設	9.8	7.7	5,274
住友林業	5.8	4.9	8,094
大和ハウス工業	22.8	19.2	54,470
積水ハウス	25.2	21	43,092
協和エクシオ	3.2	2.9	7,685
九電工	1.6	1.4	4,183
食料品 (3.6%)			
森永製菓	1.9	1.5	5,767
江崎グリコ	2.2	1.7	7,624
カルビー	3.4	2.8	9,156
ヤクルト本社	5.5	4.3	24,123
明治ホールディングス	5.2	4.1	32,677
日本ハム	3.1	2.4	11,280
アサヒグループホールディングス	15.5	13	44,993

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	31.3	26.3	52,718
サントリー食品インターナショナル	4.9	4.2	15,981
キッコーマン	4.9	4.5	25,830
味の素	16.3	13.7	27,105
キュービー	4.1	3.5	6,986
アリアケジャパン	0.7	0.6	4,398
ニチレイ	3.8	3	8,112
東洋水産	3.8	3.2	18,208
日清食品ホールディングス	3.1	2.6	26,468
日本たばこ産業	42.6	33.3	65,384
繊維製品 (0.4%)			
帝人	5.9	4.9	8,138
東レ	55.9	43.9	22,015
ゴールドウイン	0.7	1.1	8,569
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	32.4	25.3	12,321
化学 (7.3%)			
クラレ	11.3	9.5	10,412
旭化成	51.3	40.2	37,313
昭和電工	5.1	4.6	9,236
住友化学	56.7	44.5	16,020
日産化学	4.4	3.4	18,904
東ソー	11.1	9.4	15,669
トクヤマ	2.1	1.7	4,363
デンカ	2.8	2.2	6,809
信越化学工業	12.7	10.4	140,296
エア・ウォーター	5.9	5.6	8,170
大陽日酸	5.9	5.8	10,260
三菱瓦斯化学	7.3	5.6	10,780
三井化学	6.5	5.5	14,498
J S R	7.2	5.6	13,445
三菱ケミカルホールディングス	48.2	40.5	26,466
ダイセル	10.6	7.9	6,217
積水化学工業	15.5	12.8	21,568
アイカ工業	2.2	1.8	6,534

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宇部興産	3.6	3.1	5,945
日立化成	3.3	—	—
ダイキョーニシカワ	1.5	1.3	743
日油	2.7	2.3	9,338
花王	17.6	14.8	116,328
日本ペイントホールディングス	5.9	5	45,300
関西ペイント	8.1	6.8	17,510
D I C	3	2.6	6,531
資生堂	14.6	12.3	73,959
ライオン	9.6	8	17,560
コーセー	1.2	1.2	14,676
ポーラ・オルビスホールディングス	3.1	2.6	5,057
小林製薬	2.1	1.7	15,929
日東電工	5.1	4.3	27,907
ニフコ	2.9	2.3	6,598
ユニ・チャーム	14.2	13.1	58,373
医薬品 (7.4%)			
協和キリン	7.4	6.2	17,415
武田薬品工業	49.3	39.5	150,100
アステラス製薬	64.7	53.7	86,913
大日本住友製薬	5.5	4.6	5,957
塩野義製薬	9.4	7.8	45,060
田辺三菱製薬	7.7	—	—
日本新薬	1.9	1.6	13,344
中外製薬	7.7	19.4	91,335
科研製薬	1.3	1.1	5,307
エーザイ	8.8	7.4	69,597
小野薬品工業	17.4	14.2	44,573
久光製薬	2.2	1.6	7,720
参天製薬	13.7	11.5	22,517
沢井製薬	1.5	1.3	7,124
第一三共	21	17.7	164,503
大塚ホールディングス	14	12.9	57,456
ベプチドリーム	3.7	3.1	13,128
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	8.5	6.9	15,994
E N E O Sホールディングス	121.7	93.1	38,003
コスモエネルギーホールディングス	2.1	1.8	2,881
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	4.3	3.6	6,231

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	22.6	16.5	55,572
住友ゴム工業	6.6	5.6	5,712
ガラス・土石製品 (0.7%)			
A G C	7.3	5.7	17,185
太平洋セメント	4.6	3.9	11,052
東海カーボン	7.7	6.1	6,319
T O T O	5.7	4.4	20,856
日本碍子	9	7.4	11,240
日本特殊陶業	6.2	4.7	8,784
ニチアス	2	1.7	4,149
鉄鋼 (0.5%)			
日本製鉄	33.8	27.4	30,359
ジェイ エフ イー ホールディングス	19.6	16.5	14,041
日立金属	7.8	6.6	10,784
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	19.8	15.5	2,960
住友金属鉱山	10	7.8	26,863
DOWAホールディングス	1.7	1.5	5,017
古河電気工業	2.1	1.9	4,746
住友電気工業	27.2	22.9	28,247
金属製品 (0.3%)			
S U M C O	8.7	7.8	11,037
三和ホールディングス	7.5	5.8	6,612
リンナイ	1.3	1.2	11,412
東プレ	1.4	1.1	1,348
機械 (5.5%)			
アマダ	10.9	7.6	7,516
オーエスジー	3.4	3	4,929
DMG森精機	4.6	3.9	5,889
ディスコ	1	0.8	18,888
ナブテスコ	4.3	3.6	12,150
三井海洋開発	0.8	0.7	1,245
SMC	2.2	1.9	109,649
小松製作所	33.3	28	65,142
住友重機械工業	4.2	3.5	8,379
日立建機	2.9	2.5	9,287
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1.3	1.3	7,150
クボタ	39.4	32.8	63,271
ダイキン工業	10	7.9	157,210
ダイフク	4	3.2	29,504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
竹内製作所	1.2	1	2,245
T P R	1	0.8	1,092
日本精工	15.1	11.7	9,980
ジェイテクト	7.1	5.9	5,103
T H K	4.3	3.9	9,956
マキタ	9	8.1	39,973
三菱重工業	12.3	10.4	27,092
I H I	5.7	4.5	7,074
電気機器 (16.5%)			
コニカミノルタ	16.1	13.5	4,441
ブラザー工業	9.6	7.6	13,011
ミネベアミツミ	13.7	11.5	21,631
日立製作所	33.1	29.7	105,880
三菱電機	73.6	61.9	90,838
富士電機	4.8	3.7	12,524
安川電機	8.5	6.7	26,498
東芝テック	0.9	0.8	3,636
日本電産	8.9	14.9	132,550
日新電機	1.7	1.5	1,659
オムロン	7.8	5.5	43,560
日本電気	9.5	7.5	39,525
富士通	7.1	6	80,940
ルネサスエレクトロニクス	35	26.5	18,258
セイコーエプソン	9.1	7.7	9,632
アルパック	1.5	1.1	4,246
エレコム	0.7	0.7	3,416
パナソニック	84	70.7	67,271
富士通ゼネラル	2.2	1.7	4,863
ソニー	33.4	26.2	214,787
T D K	3.8	3	34,050
アルプスアルパイン	7.7	5.5	9,086
ヒロセ電機	1.1	1	12,270
横河電機	7.4	5.7	10,003
アズビル	4.6	3.9	13,182
日本光電工業	3.2	2.6	9,048
堀場製作所	1.5	1.2	6,984
アドバンテス	5	4.6	23,092
キーエンス	2.9	4.4	191,268
シスメックス	5.7	4.4	40,202
O B A R A G R O U P	0.4	0.4	1,466

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レーザーテック	1.5	2.7	20,763
スタンレー電気	5.2	4.3	13,115
カシオ計算機	6.5	5.5	9,696
ファナック	7	5.8	119,712
浜松ホトニクス	5.3	4.4	21,582
京セラ	11.2	8.7	53,200
太陽誘電	3.3	2.8	8,355
村田製作所	23.2	18.2	118,427
小糸製作所	4.4	3.7	19,795
S C R E E Nホールディングス	1.3	1.1	5,698
キヤノン	39.6	30.8	53,900
東京エレクトロン	4.9	3.9	102,960
輸送用機器 (5.8%)			
トヨタ紡織	2.6	1.8	2,712
豊田自動織機	6	5	31,650
デンソー	16.2	13.6	61,104
川崎重工業	5.7	4.8	7,152
いすゞ自動車	23.3	17.9	18,338
トヨタ自動車	28.2	23.7	165,094
日野自動車	9.2	7.7	5,390
アイシン精機	6.1	5.1	18,589
マツダ	23.1	18.2	12,376
本田技研工業	62.1	48.7	133,608
スズキ	13.5	12.3	57,416
S U B A R U	22.8	19.2	43,152
ヤマハ発動機	9.6	8.7	14,790
豊田合成	2.4	2	4,752
シマノ	2.8	2.3	50,117
テイ・エス テック	1.7	1.4	4,529
精密機器 (3.1%)			
テルモ	20.8	17.5	75,162
島津製作所	9.5	7.4	24,420
プイ・テクノロジー	0.3	0.3	1,180
東京精密	1.3	1.1	3,492
ニコン	12.8	9.4	7,360
オリンパス	43.8	34.2	70,161
H O Y A	14.8	12.3	129,150
朝日インテック	8.3	7	21,385
その他製品 (2.9%)			
パンダイナムコホールディングス	7.6	6.4	42,297

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パイロットコーポレーション	1.3	1.1	3,393
タカラトミー	3.1	2.8	2,366
ヤマハ	4.4	3.7	18,500
ビジョン	4.4	4	19,420
任天堂	4.2	3.8	224,010
電気・ガス業 (1.3%)			
中部電力	22.5	18.9	24,626
関西電力	30	23.4	24,511
東北電力	17.2	15.5	16,538
九州電力	15.2	12.8	12,108
電源開発	5.9	4.9	7,840
東京瓦斯	14.4	11.9	27,732
大阪瓦斯	14.3	12	24,336
陸運業 (4.1%)			
東武鉄道	7.8	6.5	21,742
相鉄ホールディングス	3.4	2.6	7,592
東急	20	15.6	22,198
小田急電鉄	11.8	9.2	23,929
京王電鉄	4.1	3.2	20,640
京成電鉄	5.5	4.3	13,330
東日本旅客鉄道	13.1	10.9	74,839
西日本旅客鉄道	6.6	5.5	30,877
東海旅客鉄道	6.6	5.1	80,656
西武ホールディングス	9.1	8.1	10,181
近鉄グループホールディングス	7	5.9	27,671
阪急阪神ホールディングス	9.3	7.8	26,871
京阪ホールディングス	4.1	3.5	16,012
名古屋鉄道	7.6	6.4	19,046
日本通運	2.7	2	12,380
ヤマトホールディングス	12.2	10.3	28,067
山九	1.9	1.6	6,912
日立物流	1.5	1.1	4,004
空運業 (0.5%)			
日本航空	12.8	10.4	23,129
A N Aホールディングス	12.7	10.7	28,991
情報・通信業 (8.6%)			
日鉄ソリューションズ	1.1	0.9	2,749
T I S	2.4	6.1	12,578
ネクソン	20.5	15.3	38,341
コロブラ	2.4	2	1,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティーガイア	0.5	0.5	1,027
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.7	1.5	3,253
GMOペイメントゲートウェイ	1.2	1.3	13,442
アカツキ	0.3	0.2	810
野村総合研究所	13.8	8.6	23,770
オービック	2.5	2.1	38,661
Zホールディングス	47.1	83.4	54,877
トレンドマイクロ	3.2	3.2	20,736
日本オラクル	1.5	1.2	14,076
伊藤忠テクノソリューションズ	3.3	2.8	10,514
大塚商会	3.9	3.3	16,665
デジタルガレージ	1.4	1.1	3,498
日本ユニシス	2.3	1.9	5,595
日本テレビホールディングス	6.6	5.1	6,104
日本電信電話	37.6	61.8	146,496
KDD I	59.2	44.3	128,913
光通信	0.9	0.6	14,730
NTTドコモ	45.7	43.4	122,605
東宝	4.7	3.6	14,778
エヌ・ティ・ティ・データ	19.2	16.2	19,699
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.4	2.6	17,940
カブコン	3.1	2.9	15,167
S C S K	1.9	1.4	7,854
コナミホールディングス	2.9	2.2	9,251
ソフトバンクグループ	34.7	29.2	171,725
卸売業 (5.0%)			
双日	40	33.7	8,088
アルフレッサ ホールディングス	8.1	6.8	14,633
神戸物産	1.2	2.1	12,138
ダイワボウホールディングス	0.7	0.5	3,085
T O K A I ホールディングス	3.8	3.2	3,254
シップヘルスケアホールディングス	1.5	1	4,940
コメダホールディングス	1.7	1.3	2,427
第一興商	1.4	1.2	4,122
メディアバルホールディングス	7.8	6.6	13,530
日本ライフライン	2.1	1.8	2,548
伊藤忠商事	50.7	42.6	119,365
丸紅	71.4	63.4	41,355
豊田通商	8.1	6.8	21,488
兼松	2.9	2.3	3,098

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井物産	59.7	52.8	103,118
日立ハイテク	2.2	—	—
住友商事	42.8	38.5	53,130
三菱商事	50.8	40	103,560
岩谷産業	1.6	1.4	5,656
PALTAC	1.3	1	5,790
日鉄物産	0.5	0.4	1,256
ミスミグループ本社	9.1	7.6	21,264
小売業 (4.8%)			
ローソン	1.8	1.5	7,680
エービーシー・マート	1.1	1	5,430
日本マクドナルドホールディングス	3	2.6	13,364
セリア	1.9	1.5	7,147
ビックカメラ	4.3	3.6	3,999
Monotaro	5.1	4.3	18,060
J. フロント リテイリング	9.3	7.3	5,307
マツモトキヨシホールディングス	3	2.5	9,025
ZOZO	7.8	4.2	11,915
ウエルシアホールディングス	1.9	3.6	15,084
クリエイトSDホールディングス	1.1	1	3,600
すかいらーくホールディングス	8.1	6.8	11,206
コスモス薬品	0.3	0.5	8,640
セブン&アイ・ホールディングス	30.4	23.8	79,325
ツルハホールディングス	1.6	1.3	18,421
クスリのアオキホールディングス	0.7	0.5	4,435
ノジマ	1.3	1.1	3,311
良品計画	10.3	8.1	14,401
パン・パシフィック・インターナショナルホ	17.4	13.4	32,160
ゼンショーホールディングス	3.5	2.9	7,313
ワークマン	0.7	0.6	5,220
ユナイテッドアローズ	0.8	0.6	940
スギホールディングス	1.6	1.2	9,012
ファミリーマート	8.1	4.9	11,583
しまむら	0.8	0.7	5,985
丸井グループ	6.1	5.6	10,556
イオン	27.9	23.5	62,192
イズミ	1.5	1.2	4,608
ヤオコー	0.8	0.7	5,439
ケーズホールディングス	7.5	5.9	8,513
アインホールディングス	1	0.7	4,718

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニトリホールディングス	3.1	2.6	55,445
ファーストリテイリング	1	0.8	52,856
サンドラッグ	2.7	2.3	8,855
銀行業 (4.6%)			
めぶきフィナンシャルグループ	37.7	31.7	8,210
コンコルディア・フィナンシャルグループ	45.5	34.9	13,017
新生銀行	5.3	4.5	6,052
あおぞら銀行	4.1	3.6	6,876
三菱UFJフィナンシャル・グループ	368.3	307.9	136,522
りそなホールディングス	79.6	66.4	26,201
三井住友トラスト・ホールディングス	14.3	11.5	35,201
三井住友フィナンシャルグループ	49.5	40.9	128,426
千葉銀行	25	20.4	11,791
セブン銀行	24.5	20.4	5,324
みずほフィナンシャルグループ	985.8	829.4	118,604
証券、商品先物取引業 (1.0%)			
FPG	2.3	1.9	1,149
SBIホールディングス	8.6	6.8	18,244
大和証券グループ本社	58.2	49	23,064
野村ホールディングス	127.7	107.4	57,963
松井証券	3.6	3.5	3,335
保険業 (2.5%)			
SOMPOホールディングス	12.8	11.5	44,585
MS&ADインシュアランスグループホール	19	16	46,864
ソニーフィナンシャルホールディングス	6	—	—
第一生命ホールディングス	41	34.5	54,389
東京海上ホールディングス	25.9	21.6	104,047
T&Dホールディングス	22.4	18.2	20,384
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	2	1.7	6,655
芙蓉総合リース	0.8	0.6	3,972
東京センチュリー	1.5	1.2	6,768
イオンフィナンシャルサービス	4.6	3.7	3,526
オリエントコーポレーション	19.6	16.5	1,930
オリックス	48.4	37.9	51,714
三菱UFJリース	16.4	15.5	7,905
日本取引所グループ	19.6	17.5	48,912
不動産業 (2.3%)			
いちご	9.2	7.8	2,215
ヒューリック	15.1	12.7	12,357

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村不動産ホールディングス	4.8	3.7	7,644
ブレサンスコーポレーション	1.2	1	1,391
オープンハウス	1.1	1.9	6,678
東急不動産ホールディングス	19.5	16.6	7,768
飯田グループホールディングス	6.1	5.1	10,633
パーク24	3.9	3.3	5,973
三井不動産	38.5	30.1	57,987
三菱地所	50.8	42.8	70,641
東京建物	7.9	6	7,962
住友不動産	16.3	13.7	43,497
スターツコーポレーション	1	0.8	1,790
イオンモール	3.6	3.1	4,349
日本空港ビルデング	2.3	1.9	9,253
サービス業 (5.6%)			
ミクシィ	2	1.5	3,853
ジェイエイシーリクルートメント	0.5	0.4	511
日本M&Aセンター	5.3	4.5	23,400
UTグループ	1.1	0.9	2,979
エス・エム・エス	2.6	1.8	5,193
パーソルホールディングス	7	5.9	10,106
総合警備保障	2.8	2.4	12,000
カカクコム	5.3	4.4	11,677
ディップ	1.1	0.8	1,870

銘柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
ベネフィット・ワン		2.6	2.2	5,392
エムスリー		14.8	13	82,420
アウトソーシング		4	3.4	3,230
ディー・エヌ・エー		3.8	2.5	4,405
博報堂D Yホールディングス		9.8	8.2	11,152
電通グループ		7.2	6.6	19,483
オリエンタルランド		8.3	6.3	91,129
リゾートトラスト		3	2.7	4,158
ユー・エス・エス		8.6	6.6	11,820
サイバーエージェント		4	3.6	20,088
楽天		32.8	27.6	27,103
エン・ジャパン		1	1.1	3,259
テクノプロ・ホールディングス		1.4	1.2	6,996
リクルートホールディングス		50.4	42.4	168,370
リログループ		3.8	3.2	7,433
カナモト		1.2	1	2,263
セコム		7.5	6.3	61,960
メイテック		0.9	0.7	3,654
合 計	株 数 ・ 金 額	6,125	5,148	10,866,665
	銘柄数<比率>	400	396	<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 195	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	10,866,665	97.4
コール・ローン等、その他	288,933	2.6
投資信託財産総額	11,155,598	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 (2020年9月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,155,569,240
コール・ローン等	154,767,213
株式(評価額)	10,866,665,200
未収入金	118,452,495
未収配当金	5,812,332
差入委託証拠金	9,872,000
(B) 負債	90,383,782
未払金	1,571,035
未払解約金	88,812,527
未払利息	220
(C) 純資産総額(A－B)	11,065,185,458
元本	7,291,689,170
次期繰越損益金	3,773,496,288
(D) 受益権総口数	7,291,689,170口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,175円

(注) 期首元本額は9,146,648,437円、期中追加設定元本額は1,416,880,644円、期中一部解約元本額は3,271,839,911円、1口当たり純資産額は1.5175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 4,948,287,498円
- ・JPX日経400ファンド 1,819,699,373円
- ・野村DC・JPX日経400ファンド 523,702,299円

○損益の状況 (2019年9月7日～2020年9月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	282,102,586
受取配当金	281,959,483
その他収益金	217,714
支払利息	△ 74,611
(B) 有価証券売買損益	953,310,125
売買益	1,667,420,957
売買損	△ 714,110,832
(C) 先物取引等取引損益	37,340,865
取引益	111,374,687
取引損	△ 74,033,822
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	1,272,753,576
(E) 前期繰越損益金	3,638,899,550
(F) 追加信託差損益金	564,204,209
(G) 解約差損益金	△1,702,361,047
(H) 計(D＋E＋F＋G)	3,773,496,288
次期繰越損益金(H)	3,773,496,288

*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。