

野村DC・JPX日経400ファンド

運用報告書(全体版)

第3期(決算日2017年9月6日)

作成対象期間(2016年9月7日～2017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	2015年4月27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DC・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	野村DC・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	基準価額 (分配落)	標準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税分配分	込み金	期中騰落	JPX日経インデックス400	期中騰落			
(設定日) 2015年4月27日	円 10,000		円	%		%	%	%	百万円 1
1期(2015年9月7日)	8,847		0	△11.5	12,977.78	△11.6	97.3	2.7	0.884658
2期(2016年9月6日)	8,430		0	△4.7	12,160.56	△6.3	98.2	1.8	52
3期(2017年9月6日)	9,968		0	18.2	14,113.10	16.1	98.3	1.7	187

*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DC・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「野村DC・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		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	J P X 日 経 インデックス400	騰 落 率		
(期 首) 2016年9月6日	円 8,430	% —	12,160.56	% —	% 98.2	% 1.8
9月末	8,281	△ 1.8	11,846.49	△ 2.6	98.0	2.0
10月末	8,728	3.5	12,487.46	2.7	98.0	1.9
11月末	9,211	9.3	13,182.36	8.4	98.6	1.3
12月末	9,523	13.0	13,614.80	12.0	99.3	0.7
2017年1月末	9,540	13.2	13,642.35	12.2	99.1	0.8
2月末	9,618	14.1	13,748.21	13.1	98.6	1.3
3月末	9,542	13.2	13,522.45	11.2	98.0	2.0
4月末	9,660	14.6	13,691.54	12.6	97.9	2.0
5月末	9,864	17.0	13,977.01	14.9	97.9	2.0
6月末	10,140	20.3	14,353.63	18.0	99.1	0.9
7月末	10,165	20.6	14,389.93	18.3	99.1	0.9
8月末	10,119	20.0	14,324.41	17.8	97.9	2.1
(期 末) 2017年9月6日	9,968	18.2	14,113.10	16.1	98.3	1.7

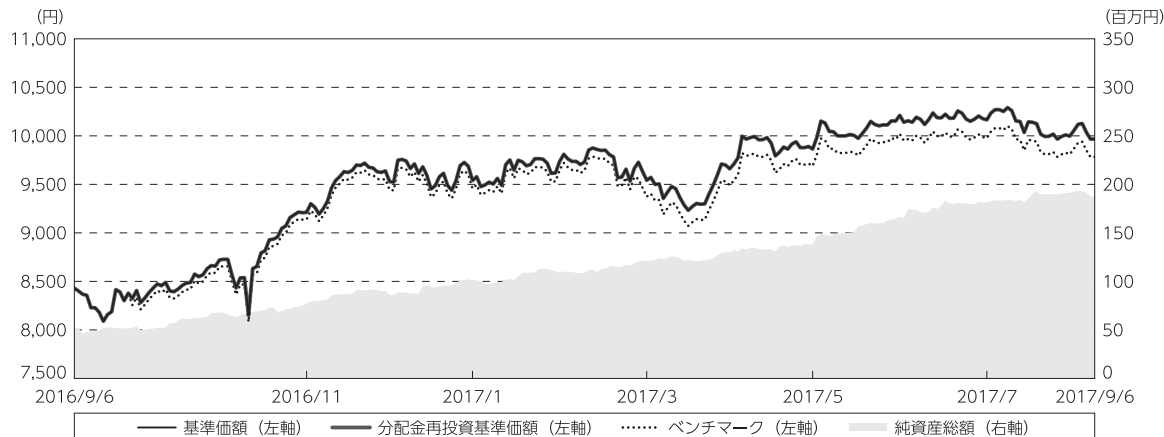
*騰落率は期首比です。

*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：8,430円

期 末：9,968円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：18.2% (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(2016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(2016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8,430円から期末9,968円に1,538円の値上がりとなりました。

米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による企業業績の改善期待などから、基準価額は上昇しました。

○投資環境

株式市場は、期首から米国の利上げ観測や米国大統領選挙の行方を巡り、一進一退の展開となりました。2016年11月中旬以降は、米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による業績改善期待、世界的に株式市場が好調だったことを受けて、上昇しました。その後、米国新政権への期待と不安により一進一退の展開となりました。

2017年4月に入り、北朝鮮やシリア情勢など地政学リスクが高まったことや、外国為替市場で円高が進んだことなどを背景に下落しましたが、4月中旬以降は、米国の税制改革案への期待やフランス大統領選の結果に対し安堵感が広がったことなどを背景に上昇しました。その後も米国の経済指標が堅調だったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが決定されたことをきっかけに円高ドル安が一服したことなどから、株式市場は上昇しましたが、8月以降は、北朝鮮の情勢が緊迫化したことを受けて下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村DC・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+18.2%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+16.1%を2.1ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

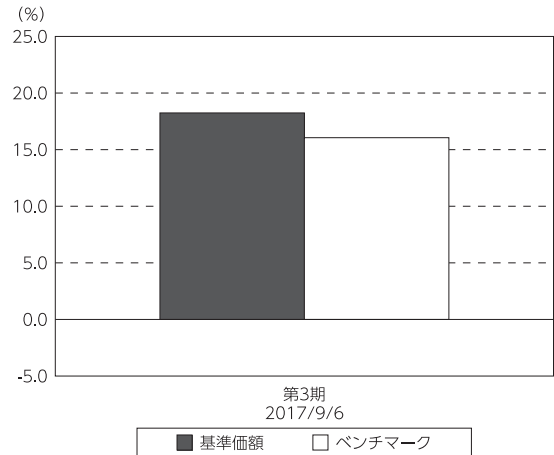
(プラス要因)

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3期
	2016年9月7日～ 2017年9月6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	690

(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DC・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

(2016年9月7日～2017年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 26	% 0.270	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(13)	(0.140)	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)	(9)	(0.097)	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)	(3)	(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	1	0.014	(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)	(1)	(0.014)	
(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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	27	0.287	
期中の平均基準価額は、9,532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

(2016年9月7日～2017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 144,111	千円 188,821	千口 52,420	千円 67,616

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年9月7日～2017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	11,058,081千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,593,967千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.70

*(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

(2016年9月7日～2017年9月6日)

利害関係人との取引状況

<野村DC・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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 3,301	百万円 6	% 0.2	百万円 7,756	百万円 15	% 0.2

平均保有割合 0.8%

※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 26	百万円 56	百万円 97

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)	16千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.006千円
(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証券株式会社です。

○ 自社による当ファンドの設定、解約状況

(2016年9月7日～2017年9月6日)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○ 組入資産の明細

(2017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 45,043	千口 136,734	千円 187,477

*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

(2017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 187,477	% 98.2
コール・ローン等、その他	3,383	1.8
投資信託財産総額	190,860	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 (2017年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	190,860,522
コール・ローン等	585,569
JPX日経400マザーファンド(評価額)	187,477,018
未収入金	2,797,935
(B) 負債	3,364,774
未払解約金	3,157,007
未払信託報酬	205,366
その他未払費用	2,401
(C) 純資産総額(A-B)	187,495,748
元本	188,091,711
次期繰越損益金	△ 595,963
(D) 受益権総口数	188,091,711口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,968円

(注) 期首元本額は61,789,693円、期中追加設定元本額は243,875,982円、期中一部解約元本額は117,573,964円、1口当たり純資産額は0.9968円です。

○損益の状況 (2016年9月7日～2017年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 131
支払利息	△ 131
(B) 有価証券売買損益	8,235,539
売買益	13,453,850
売買損	△ 5,218,311
(C) 信託報酬等	△ 314,399
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,921,009
(E) 前期繰越損益金	450,689
(F) 追加信託差損益金	△ 8,967,661
(配当等相当額)	(4,258,348)
(売買損益相当額)	(△13,226,009)
(G) 計(D+E+F)	△ 595,963
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 595,963
追加信託差損益金	△ 8,967,661
(配当等相当額)	(4,611,081)
(売買損益相当額)	(△13,578,742)
分配準備積立金	8,371,698

*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(2016年9月7日～2017年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年9月7日～ 2017年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,983,350円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	5,937,659円
c. 信託約款に定める収益調整金	4,611,081円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	450,689円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	12,982,779円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	690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
------------------	----

○お知らせ

①スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2017年3月31日>

②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2017年3月31日>

JPX日経400マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日2017年9月6日）

作成対象期間（2016年9月7日～2017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		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	期中率	JPX日経インデックス400	騰落率			
(設定日) 2014年1月31日	円 10,000	% -	11,063.66	% -	% -	% -	百万円 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

* 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

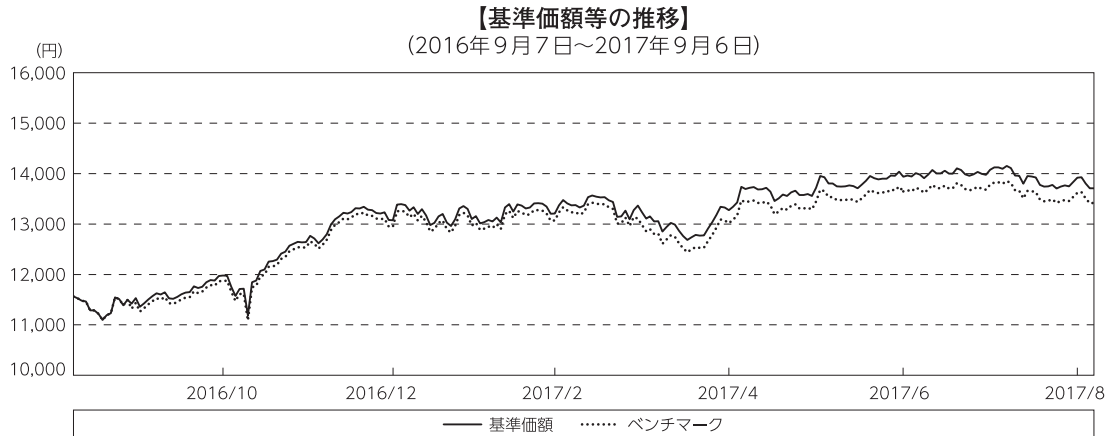
年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落	騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期首) 2016年9月6日	円 11,563	% -	12,160.56	% -	% 98.2	% 1.8
9月末	11,361	△ 1.7	11,846.49	△ 2.6	98.0	2.0
10月末	11,977	3.6	12,487.46	2.7	98.0	1.9
11月末	12,643	9.3	13,182.36	8.4	98.6	1.3
12月末	13,074	13.1	13,614.80	12.0	99.3	0.7
2017年1月末	13,101	13.3	13,642.35	12.2	99.1	0.8
2月末	13,210	14.2	13,748.21	13.1	98.6	1.3
3月末	13,109	13.4	13,522.45	11.2	98.0	2.0
4月末	13,274	14.8	13,691.54	12.6	97.9	2.0
5月末	13,558	17.3	13,977.01	14.9	98.0	2.0
6月末	13,940	20.6	14,353.63	18.0	99.1	0.9
7月末	13,977	20.9	14,389.93	18.3	99.1	0.9
8月末	13,917	20.4	14,324.41	17.8	97.9	2.1
(期末) 2017年9月6日	13,711	18.6	14,113.10	16.1	98.3	1.7

* 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11,563円から期末13,711円に2,148円の値上がりとなりました。

米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による企業業績の改善期待などから、基準価額は上昇しました。

○投資環境

株式市場は、期首から米国の利上げ観測や米国大統領選挙の行方を巡り、一進一退の展開となりました。2016年11月中旬以降は、米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による業績改善期待、世界的に株式市場が好調だったことなどをを受けて、上昇しました。その後、米国新政権への期待と不安により一進一退の展開となりました。

2017年4月に入り、北朝鮮やシリア情勢など地政学リスクが高まったことや、外国為替市場で円高が進んだことなどを背景に下落しましたが、4月中旬以降は、米国の税制改革案への期待やフランス大統領選の結果に対し安堵感が広がったことなどを背景に上昇しました。その後も米国の経済指標が堅調だったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが決定されたことをきっかけに円高ドル安が一服したことなどから、株式市場は上昇しましたが、8月以降は、北朝鮮の情勢が緊迫化したことをを受けて下落しました。

○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

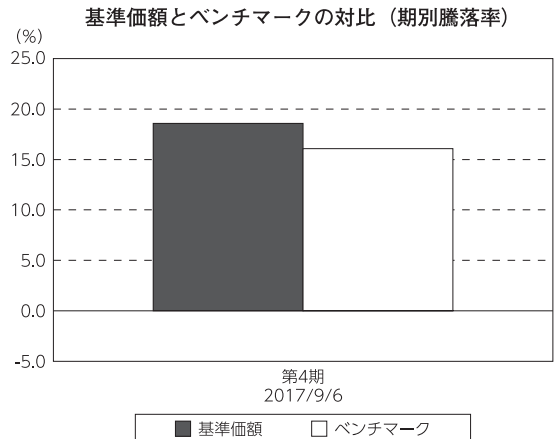
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。

○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+18.6%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+16.1%を2.5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

(2016年9月7日～2017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 (株 式) (先物・オプション)	円 2 (0) (2)	% 0.014 (0.000) (0.014)	(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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.014	
期中の平均基準価額は、13,095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

(2016年9月7日～2017年9月6日)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		1,967	3,301,168	5,037	7,756,912
		(△ 663)	(-)		

*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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	9,217	9,313	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年9月7日～2017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	11,058,081千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,593,967千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.70

* (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

(2016年9月7日～2017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 3,301	百万円 6	% 0.2	百万円 7,756	百万円 15	% 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 26	百万円 56	百万円 97

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)	2,216千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(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です。

○組入資産の明細

(2017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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)				
日本水産	15.7	12.1		7,356
鉱業 (0.4%)				
国際石油開発帝石	64.7	49.1		51,898
建設業 (3.4%)				
安藤・間	8.2	6.7		5,145
東急建設	4	3.3		2,887
コムシスホールディングス	5.3	3.6		8,913
大成建設	64	47		52,734
大林組	36.8	28		36,232
清水建設	38	28.5		32,233
長谷工コーポレーション	14.3	10.9		15,238
鹿島建設	58	41		41,820
三井住友建設	47.1	35.7		4,391
前田建設工業	—	6		8,022
戸田建設	—	11		8,679
熊谷組	18	15		4,965
大東建託	4.5	3.4		64,464
N I P P O	3	2		4,320
前田道路	4	3		6,636
五洋建設	—	10.3		6,602
住友林業	8.5	6.4		10,681
大和ハウス工業	36.3	27.6		102,064
積水ハウス	41.1	28.6		53,682
協和エクシオ	4.8	3.7		7,644
九電工	2.2	1.8		7,902
日揮	12.3	—		—
食料品 (4.7%)				
江崎グリコ	2.8	2.3		13,455
カルビー	4.6	3.8		14,326
ヤクルト本社	6.6	5		38,650
明治ホールディングス	7.3	5.5		47,355
日本ハム	9	7		21,665
アサヒグループホールディングス	23	17.5		82,687
キリンホールディングス	52.9	40.2		100,660

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サントリー食品インターナショナル	—	6.4		32,192
伊藤園	3.6	—		—
キッコーマン	9	6.5		22,425
味の素	25.8	19.2		40,848
キュービー	6.2	4.7		12,271
ニチレイ	13	4.3		12,272
東洋水産	6	4.6		18,584
日清食品ホールディングス	5.2	3.6		24,480
日本たばこ産業	51.7	51.7		191,393
繊維製品 (0.6%)				
帝人	—	7.1		15,442
東レ	83	63.3		64,755
パルプ・紙 (0.2%)				
王子ホールディングス	45	34		19,176
大王製紙	5.1	3.5		4,606
化学 (7.5%)				
クラレ	19.3	14.7		29,929
旭化成	72	54		68,715
住友化学	84	64		41,408
日産化学工業	6.9	4.7		17,789
東ソー	31	25		31,725
デンカ	24	17		12,206
信越化学工業	20.6	15.6		151,242
エア・ウォーター	9	7.2		14,335
大陽日酸	8.8	6.7		8,274
日本パーカライジング	5.9	4.5		7,150
三菱瓦斯化学	20	8.1		21,537
三井化学	—	40		25,640
J S R	10.8	8.8		18,383
三菱ケミカルホールディングス	76.9	58.7		59,110
ダイセル	15.5	11.8		15,918
積水化学工業	26.1	19.4		39,343
日本ゼオン	10	7		9,534
アイカ工業	3.4	2.8		9,982
宇部興産	61	44		13,508

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立化成	5.7	4.8	13,996
ダイキョーニシカワ	—	1.5	2,515
日本化薬	7	6	10,326
日油	9	7	11,025
花王	29.2	20.5	139,010
日本ペイントホールディングス	8.9	6.7	24,723
関西ペイント	13	9.2	25,070
D I C	4.5	3.4	12,886
富士フイルムホールディングス	26.3	—	—
資生堂	21.8	15.5	70,757
ライオン	—	11.6	25,056
コーセー	1.9	1.4	19,152
シーズ・ホールディングス	1.5	1.1	4,724
小林製薬	3.5	2.3	15,180
日東電工	8.9	6.3	59,503
ニフコ	2.2	1.5	9,675
ユニ・チャーム	23.2	17.7	45,285
医薬品 (5.4%)			
協和発酵キリン	13.7	10.4	19,364
武田薬品工業	45.7	32.7	194,499
アステラス製薬	124.6	85.6	117,614
大日本住友製薬	—	6.2	8,996
塩野義製薬	16.7	11.1	63,603
田辺三菱製薬	13.4	10.2	26,275
中外製薬	11.4	8.7	37,671
科研製薬	2	1.6	9,072
エーザイ	14.1	10.7	60,701
小野薬品工業	26.1	19.8	43,718
久光製薬	3.6	2.5	12,950
参天製薬	21.1	15.7	27,019
ツムラ	3.6	2.9	11,687
沢井製薬	1.9	1.5	8,925
第一三共	38.6	25.7	65,175
キョーリン製薬ホールディングス	3.1	—	—
大塚ホールディングス	24.7	17.3	74,822
大正製薬ホールディングス	2.8	—	—
ゴム製品 (1.2%)			
横浜ゴム	6.9	4.8	9,921
東洋ゴム工業	6.1	4.9	10,794
ブリヂストン	38.7	29.4	137,033

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友ゴム工業	10.7	8.2	14,915
ガラス・土石製品 (0.9%)			
旭硝子	57	8.5	35,402
住友大阪セメント	23	16	7,840
太平洋セメント	73	53	22,419
T O T O	8.4	6.4	25,952
日本碍子	14.5	11	22,165
日本特殊陶業	9.9	7.5	15,795
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	51.7	39.3	103,083
神戸製鋼所	211	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	31.4	23.8	53,002
東京製鐵	—	4.4	4,039
日立金属	13.1	8.9	13,109
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	—	22.4	7,235
三菱マテリアル	72	5.4	21,465
住友金属鉱山	32	23	43,079
DOWAホールディングス	15	10	8,230
住友電気工業	45.9	32.8	55,186
金属製品 (0.2%)			
三和ホールディングス	11.4	8.6	10,457
三協立山	1.5	—	—
リンナイ	2.1	1.5	14,205
日本発條	10.8	8.2	9,249
機械 (5.4%)			
アマダホールディングス	—	11.7	14,238
オーエスジー	5.2	3.7	8,484
DMG 森精機	6.8	4.6	8,201
ディスコ	1.5	1	19,770
ニューフレアテクノロジー	0.2	0.2	1,184
ナブテスコ	6	4.5	17,347
SMC	3.4	2.6	96,486
小松製作所	56.2	40.2	121,404
住友重機械工業	33	25	20,150
日立建機	5.1	3.9	12,285
ハーモニック・ドライブ・システムズ	—	1.2	5,754
クボタ	55.1	44.9	85,759
荏原製作所	25	3.9	13,474
ダイキン工業	16	11.4	123,405

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
椿本チエイン	7	5	4,280
ダイフク	5.9	4.2	20,076
タダノ	5.3	4.4	5,460
平和	3.4	2.6	5,577
竹内製作所	2.2	1.5	2,992
T P R	1.3	0.9	3,001
ホシザキ	3.2	2.6	24,830
日本精工	22.5	17.1	22,503
ジェイテクト	11.7	8.9	12,869
不二越	11	—	—
THK	7.3	5.9	21,240
イーグル工業	1.4	0.9	1,701
マキタ	7.1	10.9	47,960
三菱重工業	195	140	58,604
I H I	84	—	—
電気機器 (15.8%)			
コニカミノルタ	27.4	19.5	16,555
ブラザー工業	14.2	10.2	25,438
ミネベアミツミ	17.7	15.1	26,500
日立製作所	280	200	148,160
三菱電機	117	88.8	144,433
富士電機	33	25	14,775
安川電機	13.6	9.7	31,864
日本電産	13.2	10.8	130,194
オムロン	12.4	8.8	47,960
日本電気	151	114	32,946
富士通	106	80	62,296
沖電気工業	47	—	—
ルネサスエレクトロニクス	5.7	4.3	4,618
セイコーエプソン	16.3	12.4	33,938
アルバック	—	1.4	8,162
エレコム	0.9	0.7	1,574
パナソニック	125.2	95.6	139,767
富士通ゼネラル	3	2.8	6,378
日立国際電気	2.5	2.2	6,135
ソニー	—	51.4	220,146
T D K	6.6	4.7	33,840
アルプス電気	9.4	7.7	22,360
クラリオン	—	4	1,708
ヒロセ電機	1.8	1.3	19,435

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本航空電子工業	3	2	3,492
横河電機	11	9	16,065
日本光電工業	4.6	3.5	8,715
堀場製作所	2.2	1.6	10,112
アドバンテスト	—	5.7	10,681
キーエンス	2.5	3.8	214,662
シスメックス	8.5	6.5	44,525
O B A R A G R O U P	—	0.5	2,925
スタンレー電気	7.8	5.9	21,151
カシオ計算機	11	6.7	10,311
ファナック	11.1	8.4	177,618
エンプラス	0.6	—	—
浜松ホトニクス	8.6	6.1	20,465
京セラ	18	13.7	89,173
村田製作所	11.6	8.7	142,419
小糸製作所	6.6	5	34,050
ミツバ	1.9	1.5	2,353
S C R E E Nホールディングス	11	1.7	12,104
キャノン	59	44.8	169,926
リコー	35.5	25	27,250
東京エレクトロン	9	5.6	84,448
輸送用機器 (8.1%)			
トヨタ紡織	—	2.9	6,229
豊田自動織機	10	7.6	43,852
デンソー	27.1	20.5	106,210
川崎重工業	85	65	22,100
名村造船所	3.3	—	—
日産自動車	149.4	98.2	106,645
いすゞ自動車	31.8	24.1	34,270
トヨタ自動車	45.9	37.3	229,954
日野自動車	15.6	11.9	15,386
日信工業	2.4	1.9	3,570
N O K	5.3	4	9,756
カルソニックカンセイ	8	—	—
アイシン精機	11.2	7.6	43,016
マツダ	34.7	26.4	41,025
本田技研工業	88	71.8	217,984
スズキ	20	16.5	91,575
S U B A R U	34.6	25.8	98,143
ヤマハ発動機	15.5	11.8	36,049

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
豊田合成	4	2.7	6,809
シマノ	4.4	3.4	49,198
テイ・エス テック	2.5	1.9	6,384
精密機器 (1.7%)			
テルモ	16.8	12.8	55,552
島津製作所	14	10.7	21,753
ニコン	20.5	—	—
トプコン	3.7	—	—
オリンパス	16.3	13.3	50,473
HOYA	24.8	17.1	103,814
朝日インテック	2.6	2	11,420
セイコーホールディングス	7	6	2,880
その他製品 (0.7%)			
バンダイナムコホールディングス	11.3	9.2	33,672
パイロットコーポレーション	1.9	1.5	7,327
アシックス	10.9	8.3	13,479
ヤマハ	8.1	5.6	21,392
ビジョン	6.2	5	20,075
電気・ガス業 (1.7%)			
中部電力	33.5	27.4	38,469
関西電力	—	34	52,037
東北電力	27.4	20.8	30,992
電源開発	9.3	6.6	19,008
東京瓦斯	122	89	50,552
大阪瓦斯	113	81	34,303
東邦瓦斯	28	21	14,637
陸運業 (5.0%)			
東武鉄道	59	44	26,180
相鉄ホールディングス	25	18	9,522
東京急行電鉄	64	22.6	35,685
小田急電鉄	35	13.3	27,983
京王電鉄	31	23	20,861
京成電鉄	16	6.2	18,693
東日本旅客鉄道	19.9	15.9	159,556
西日本旅客鉄道	10.5	8	63,512
東海旅客鉄道	9.8	6.9	128,754
西武ホールディングス	—	11.5	21,344
西日本鉄道	19	13	6,877
近鉄グループホールディングス	110	84	34,860
阪急阪神ホールディングス	14.7	10.5	43,260

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
南海電気鉄道	33	23	12,788
京阪ホールディングス	33	25	16,425
名古屋鉄道	53	40	19,800
日本通運	42	31	22,816
ヤマトホールディングス	19.6	14.9	33,741
山九	14	11	9,295
日立物流	—	1.7	4,299
海運業 (—%)			
日本郵船	98	—	—
空運業 (0.8%)			
日本航空	21	14.6	53,596
ANAホールディングス	203	155	64,340
情報・通信業 (7.5%)			
新日鉄住金ソリューションズ	—	1.3	2,995
グリー	6.6	—	—
ネクソン	11.9	9.1	24,169
コロプラ	3	2.6	3,257
ティーガイア	1.1	0.8	1,652
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25.2	22.1	6,917
野村総合研究所	7.3	6.1	25,498
オービック	3.7	2.8	18,872
ヤフー	77.5	58.9	29,214
トレンドマイクロ	5.7	4	20,000
日本オラクル	1.7	1.3	10,361
伊藤忠テクノソリューションズ	2.4	1.9	7,467
大塚商会	2.9	2.5	17,325
USEN	4.9	—	—
日本テレビホールディングス	9.9	7.5	14,392
日本電信電話	47.2	41.4	216,604
KDDI	72.8	74	218,559
光通信	1.3	1	13,450
NTTドコモ	80.8	60.5	152,460
GMOインターネット	3.9	3	4,140
東宝	7.7	5.4	20,979
エヌ・ティ・ティ・データ	6.7	25.4	29,337
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	3.2	12,384
S C S K	2.6	2.2	10,142
コナミホールディングス	—	3.7	20,757
ソフトバンクグループ	39.1	24.2	207,611

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	68.1	48.5	14,065
アルフレッサ ホールディングス	13.6	9.7	19,749
神戸物産	—	0.5	2,800
シップヘルスケアホールディングス	2.2	1.6	5,256
第一興商	2.5	1.8	9,504
メディパルホールディングス	10.8	8.2	15,432
伊藤忠商事	84.9	60.2	106,403
丸紅	106.4	80.9	58,045
豊田通商	12	9.2	31,464
兼松	23	17	4,505
三井物産	97.8	74.3	121,517
日立ハイテクノロジーズ	3.7	2.8	10,920
住友商事	68.1	51.7	80,703
三菱商事	81.2	61.6	155,355
阪和興業	11	8	5,840
岩谷産業	13	9	5,832
東邦ホールディングス	3.5	2.6	5,462
サンリオ	3.3	2.5	5,010
日鉄住金物産	9	0.7	4,109
ミスミグループ本社	12.1	9.5	26,372
小売業 (4.4%)			
ローソン	4.1	2.6	18,980
エービーシー・マート	1.4	1.5	8,415
ゲオホールディングス	1.8	—	—
アダストリア	—	1.3	3,068
セリア	1.2	2	12,280
ビックカメラ	—	4.7	5,828
MonotaRO	3.8	2.9	9,599
J. フロント リテイリング	13.7	10.4	15,527
マツモトキヨシホールディングス	2.2	1.6	11,632
スタートトゥデイ	3.3	7.2	23,832
ウエルシアホールディングス	1.2	2.2	9,251
クリエイトSDホールディングス	1.6	1.2	3,316
コスモス薬品	0.5	0.4	10,088
セブン&アイ・ホールディングス	45.2	34.4	146,819
ツルハホールディングス	2.5	1.6	20,800
クスリのアオキ	1	—	—
クスリのアオキホールディングス	—	0.7	4,508
ノジマ	1.7	1.3	2,719

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	1.2	1.1	33,880
ドンキホーテホールディングス	7	5.3	22,233
V Tホールディングス	4.9	—	—
ユナイテッドアローズ	1.5	1.1	4,147
スギホールディングス	1.9	1.8	10,386
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3.3	3.6	21,024
日本瓦斯	1.7	1.5	5,197
しまむら	1.3	1	13,130
高島屋	16	14	14,126
イオン	44.5	33.8	54,130
イズミ	2.1	1.5	8,595
ヤオコー	1.2	0.9	4,770
ケーズホールディングス	4.6	3.5	8,463
アインホールディングス	1.3	1.2	9,468
ニトリホールディングス	4.7	3.5	59,780
パローホールディングス	2.3	1.8	4,165
ファーストリテイリング	1.8	1.4	42,798
サンドラッグ	2.3	3.1	13,934
銀行業 (6.4%)			
めぶきフィナンシャルグループ	—	39.6	15,087
東京T Yフィナンシャルグループ	1.5	1.2	3,037
九州フィナンシャルグループ	22.1	18	11,502
コンコルディア・フィナンシャルグループ	75.4	53.2	27,993
新生銀行	94	78	13,416
あおぞら銀行	68	52	21,268
三菱UF Jフィナンシャル・グループ	496.8	288.7	189,935
りそなホールディングス	126.5	96.1	51,375
三井住友トラスト・ホールディングス	226	17.2	64,310
三井住友フィナンシャルグループ	77.4	50.3	202,407
千葉銀行	42	32	23,104
群馬銀行	24	17.9	11,115
ふくおかフィナンシャルグループ	47	—	—
静岡銀行	32	22	20,724
スルガ銀行	10.3	8.4	18,732
八十二銀行	26.1	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	74	5.5	8,921
広島銀行	32	24	10,200
中国銀行	10.2	7.6	10,784
セブン銀行	40.5	30.8	12,289
みずほフィナンシャルグループ	1,548	1,071.5	199,727

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山口フィナンシャルグループ	13	10	12,160
北洋銀行	16.3	—	—
証券、商品先物取引業 (1.2%)			
F P G	3.9	2.9	3,424
S B I ホールディングス	13	9.3	14,005
ジャフコ	1.8	1.4	6,825
大和証券グループ本社	101	75	44,775
野村ホールディングス	208.1	168	97,322
岡三証券グループ	9	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12.4	9.4	5,668
松井証券	5.3	4.7	3,877
カブドットコム証券	9.2	6.1	1,970
保険業 (3.1%)			
S O M P O ホールディングス	24	17.2	73,100
MS & A D インシュアランスグループホール	32.3	23	81,650
ソニーフィナンシャルホールディングス	10.4	7.9	13,453
第一生命ホールディングス	69.3	49.5	85,437
東京海上ホールディングス	43.8	33.1	142,396
T & D ホールディングス	39.4	29.9	44,281
その他金融業 (1.4%)			
全国保証	2.8	2.3	10,074
芙蓉総合リース	1.2	0.9	5,904
興銀リース	2	1.5	4,080
東京センチュリー	2.5	1.7	7,871
イオンフィナンシャルサービス	7.1	5.2	11,986
オリエントコーポレーション	46.8	17.8	3,079
日立キャピタル	2.5	1.9	4,757
オリックス	76.6	58.2	99,958
三菱UFJリース	27.4	20.8	11,148
日本取引所グループ	31.8	25.5	45,849
不動産業 (2.7%)			
いちご	12	7.8	2,691
ヒューリック	22.5	17.1	18,262
野村不動産ホールディングス	7.2	5.5	11,891
プレサンスコーポレーション	0.4	1.3	1,838
オープンハウス	—	1.3	4,335
東急不動産ホールディングス	26.2	19.9	12,517
飯田グループホールディングス	10	6.8	12,505
パーク24	5.5	4.5	11,821
三井不動産	57	43.6	101,021

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	80	61.1	113,371	
東京建物	12.6	9	12,060	
住友不動産	26	20	64,880	
大京	20	—	—	
レオパレス21	12.7	10.2	7,854	
スターツコーポレーション	1.7	1.1	2,962	
住友不動産販売	0.8	—	—	
タカラレーベン	4.7	—	—	
イオンモール	7	5.3	10,213	
エヌ・ティ・ティ都市開発	6.7	5.1	5,370	
サービス業 (2.7%)				
ミクシィ	2.3	2.3	12,834	
日本M&Aセンター	1.8	2.5	12,750	
パーソルホールディングス	8	6.7	14,592	
クックパッド	2.6	—	—	
総合警備保障	3.8	3.2	15,136	
カカコム	8.2	6.1	8,204	
ディップ	1.3	1.1	2,445	
エムスリー	9.9	7.5	20,782	
ディー・エヌ・エー	5.1	3.9	8,966	
博報堂DYホールディングス	15.9	12.1	17,605	
ぐるなび	1.3	—	—	
電通	12.8	—	—	
オリエンタルランド	12.4	9.4	77,136	
リゾートトラスト	4.8	3.4	6,908	
ユー・エス・エス	13.9	10.5	22,543	
サイバーエージェント	3	5.2	17,654	
楽天	58.5	40.8	52,897	
リログループ	0.6	4.3	9,945	
エイチ・アイ・エス	1.9	—	—	
カナモト	1.6	1.2	4,644	
セコム	11.9	9	72,432	
メイテック	—	1	4,965	
イオンディライト	1.1	1	3,895	
合 計	株 数 ・ 金 額	12,074	8,340	14,422,624
	銘柄数 < 比率 >	400	400	< 98.3% >

*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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	J P X日経400	百万円 244	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年9月6日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 14,422,624	% 97.7
コール・ローン等、その他	337,707	2.3
投資信託財産総額	14,760,331	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 (2017年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,760,309,393
コール・ローン等	320,886,789
株式(評価額)	14,422,624,980
未収入金	19,584
未収配当金	7,070,540
差入委託証拠金	9,707,500
(B) 負債	86,321,360
未払金	3,290,035
未払解約金	83,030,807
未払利息	518
(C) 純資産総額(A-B)	14,673,988,033
元本	10,702,295,189
次期繰越損益金	3,971,692,844
(D) 受益権総口数	10,702,295,189口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,711円

(注) 期首元本額は14,389,874,915円、期中追加設定元本額は3,235,360,750円、期中一部解約元本額は6,922,940,476円、1口当たり純資産額は1.3711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 5,469,228,770円
 ・JPX日経400ファンド 3,772,519,628円
 ・ノムラPOF3用インデックスファンド・JPX日経400(適格機関投資家専用) 1,323,812,039円
 ・野村DC・JPX日経400ファンド 136,734,752円

○損益の状況 (2016年9月7日～2017年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	352,542,567
受取配当金	352,282,228
その他収益金	364,782
支払利息	△ 104,443
(B) 有価証券売買損益	2,543,331,592
売買益	2,826,840,938
売買損	△ 283,509,346
(C) 先物取引等取引損益	42,598,106
取引益	81,526,651
取引損	△ 38,928,545
(D) 保管費用等	△ 54,777
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,938,417,488
(F) 前期繰越損益金	2,249,091,387
(G) 追加信託差損益金	987,991,574
(H) 解約差損益金	△2,203,807,605
(I) 計(E+F+G+H)	3,971,692,844
次期繰越損益金(I)	3,971,692,844

*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(G)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(H)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スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞