

野村DC・JPX日経400ファンド

運用報告書(全体版)

第7期(決算日2021年9月6日)

作成対象期間(2020年9月8日～2021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	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円		円	%		%	%	%	百万円
3期(2017年9月6日)	9,968		0	18.2	14,113.10	16.1	98.3	1.7	187
4期(2018年9月6日)	10,760		5	8.0	14,960.51	6.0	97.1	2.8	396
5期(2019年9月6日)	10,097		5	△ 6.1	13,748.91	△ 8.1	97.9	2.1	581
6期(2020年9月7日)	10,927		5	8.3	14,546.93	5.8	98.2	1.8	794
7期(2021年9月6日)	14,129		5	29.3	18,474.37	27.0	98.4	1.5	1,224

*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「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) 2020年9月7日	円 10,927	% —	14,546.93	% —	% 98.2	% 1.8
9月末	11,069	1.3	14,617.28	0.5	97.7	2.3
10月末	10,760	△ 1.5	14,210.19	△ 2.3	98.2	1.7
11月末	12,083	10.6	15,954.48	9.7	98.8	1.2
12月末	12,392	13.4	16,341.80	12.3	97.9	2.1
2021年1月末	12,441	13.9	16,410.28	12.8	98.3	1.7
2月末	12,795	17.1	16,871.64	16.0	97.9	2.1
3月末	13,468	23.3	17,622.89	21.1	97.5	2.5
4月末	13,071	19.6	17,101.14	17.6	97.2	2.7
5月末	13,292	21.6	17,385.08	19.5	96.9	3.0
6月末	13,396	22.6	17,508.84	20.4	97.9	2.1
7月末	13,048	19.4	17,058.38	17.3	98.0	2.0
8月末	13,508	23.6	17,656.56	21.4	98.1	1.9
(期 末) 2021年9月6日	14,134	29.3	18,474.37	27.0	98.4	1.5

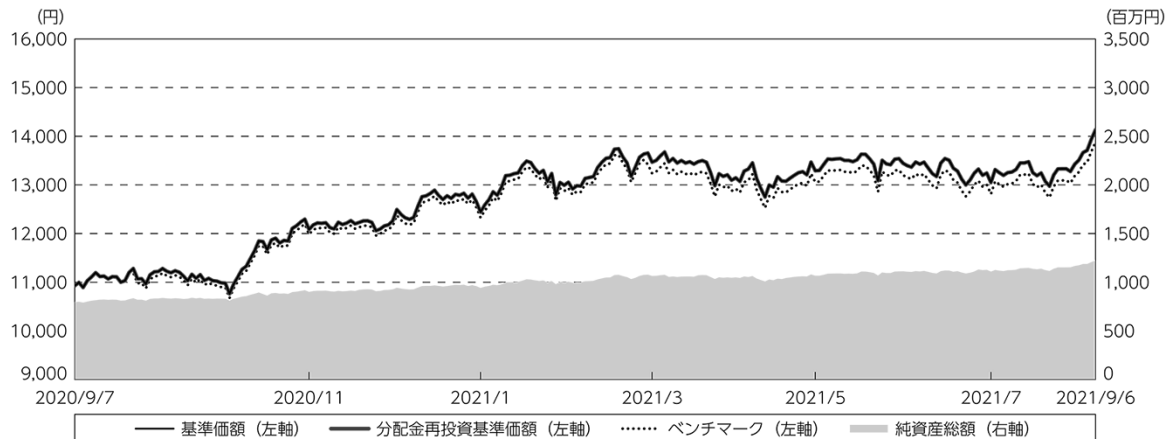
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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：10,927円

期 末：14,129円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 29.3% (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(2020年9月7日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。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(2020年9月7日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

国内株式の株価の変動

○投資環境

国内株式市場は、期首より菅新政権の政策継続が好感された一方、欧州など海外での新型コロナウイルスの新規感染者数増加を受けて景気の先行きへの懸念が高まり、一進一退の展開となりました。2020年11月以降は、米国大統領選挙の結果を受けて政治的な不透明感が和らぎ米国株式市場が上昇したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどから上昇しました。

2021年2月以降は、米国の追加経済対策の早期成立への期待や、国内企業の2020年度業績予想の上方修正が相次いだことなどが好感された一方、米長期金利の上昇や、国内での新型コロナウイルス新規感染者数増加への懸念などから一進一退の展開となりました。9月以降は菅首相の自民党総裁選出馬見送りが報道され、新首相の下で内閣が一新されることから、内閣支持率の回復期待が浮上したことなどにより上昇しました。

○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なってまいりました。

○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+29.3%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+27.0%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。

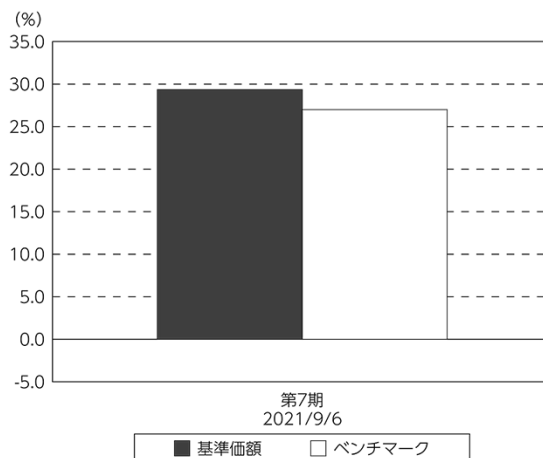
(プラス要因)

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、基準価額水準等を勘案し、経費控除後の配当等収益から決定さ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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第7期
	2020年9月8日～ 2021年9月6日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.035%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,128

(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

(2020年9月8日～2021年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.274	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(18)	(0.143)	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)	(12)	(0.099)	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)	(0.033)	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	1	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)	(1)	(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	36	0.288	
期中の平均基準価額は、12,610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。

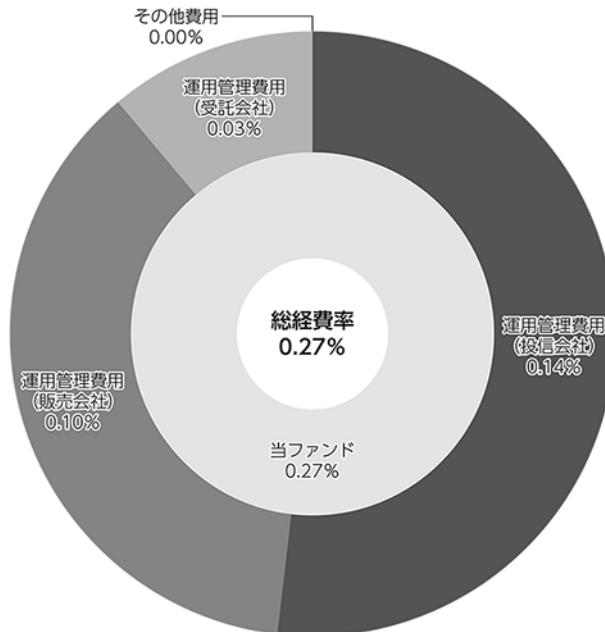
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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0.27%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

(2020年9月8日～2021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 180,124	千円 320,230	千口 81,966	千円 143,341

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年9月8日～2021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	7,385,463千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,740,305千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68

*(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

(2020年9月8日～2021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	$\frac{B}{A}$	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 2,981	百万円 3	% 0.1	百万円 4,403	百万円 0.2289	% 0.0

平均保有割合 9.1%

※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 9	百万円 18	百万円 51

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

(2020年9月8日～2021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 1	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2021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 523,702	千口 621,859	千円 1,224,068

*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

(2021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 1,224,068	% 99.4
コール・ローン等、その他	7,901	0.6
投資信託財産総額	1,231,969	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 (2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,231,969,271
コール・ローン等	3,090,214
JPX日経400マザーファンド(評価額)	1,224,068,729
未収入金	4,810,328
(B) 負債	7,780,092
未払収益分配金	433,229
未払解約金	5,839,537
未払信託報酬	1,489,511
未払利息	2
その他未払費用	17,813
(C) 純資産総額(A-B)	1,224,189,179
元本	866,459,383
次期繰越損益金	357,729,796
(D) 受益権総口数	866,459,383口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,129円

(注) 期首元本額は727,394,555円、期中追加設定元本額は344,719,334円、期中一部解約元本額は205,654,506円、1口当たり純資産額は14,129円です。

○損益の状況 (2020年9月8日～2021年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 429
支払利息	△ 429
(B) 有価証券売買損益	222,121,374
売買益	251,591,559
売買損	△ 29,470,185
(C) 信託報酬等	△ 2,761,051
(D) 当期損益金(A+B+C)	219,359,894
(E) 前期繰越損益金	32,115,805
(F) 追加信託差損益金	106,687,326
(配当等相当額)	(94,932,339)
(売買損益相当額)	(11,754,987)
(G) 計(D+E+F)	358,163,025
(H) 収益分配金	△ 433,229
次期繰越損益金(G+H)	357,729,796
追加信託差損益金	106,687,326
(配当等相当額)	(95,773,827)
(売買損益相当額)	(10,913,499)
分配準備積立金	251,042,470

* 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(2020年9月8日～2021年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年9月8日～ 2021年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	19,978,733円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	199,381,161円
c. 信託約款に定める収益調整金	106,687,326円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	32,115,805円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	358,163,025円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,133円
g. 分配金	433,229円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	5円
----------------	----

○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8期（決算日2021年9月6日）

作成対象期間（2020年9月8日～2021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	騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
8期(2021年9月6日)	19,684	29.7	18,474.37	27.0	98.4	1.5	12,267

*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

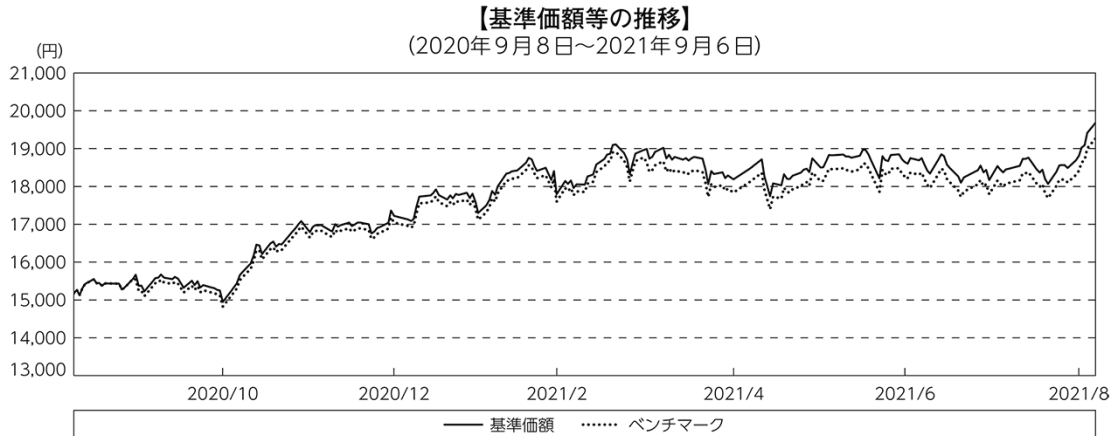
年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落率	騰落率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2020年9月7日	15,175	—	14,546.93	—	98.2	1.8
9月末	15,376	1.3	14,617.28	0.5	97.7	2.3
10月末	14,949	△ 1.5	14,210.19	△ 2.3	98.2	1.7
11月末	16,792	10.7	15,954.48	9.7	98.8	1.2
12月末	17,225	13.5	16,341.80	12.3	97.9	2.1
2021年1月末	17,298	14.0	16,410.28	12.8	98.3	1.7
2月末	17,793	17.3	16,871.64	16.0	97.9	2.1
3月末	18,734	23.5	17,622.89	21.1	97.5	2.5
4月末	18,186	19.8	17,101.14	17.6	97.2	2.7
5月末	18,498	21.9	17,385.08	19.5	96.9	3.0
6月末	18,647	22.9	17,508.84	20.4	97.9	2.1
7月末	18,167	19.7	17,058.38	17.3	98.0	2.0
8月末	18,811	24.0	17,656.56	21.4	98.1	1.9
(期末)						
2021年9月6日	19,684	29.7	18,474.37	27.0	98.4	1.5

*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

国内株式の株価の変動

○投資環境

国内株式市場は、期首より菅新政権の政策継続が好感された一方、欧州など海外での新型コロナウイルスの新規感染者数増加を受けて景気の先行きへの懸念が高まり、一進一退の展開となりました。2020年11月以降は、米国大統領選挙の結果を受けて政治的な不透明感が和らぎ米国株式市場が上昇したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどから上昇しました。

2021年2月以降は、米国の追加経済対策の早期成立への期待や、国内企業の2020年度業績予想の上方修正が相次いだことなどが好感された一方、米長期金利の上昇や、国内での新型コロナウイルス新規感染者数増加への懸念などから一進一退の展開となりました。9月以降は菅首相の自民党総裁選出馬見送りが報道され、新首相の下で内閣が一新されることから、内閣支持率の回復期待が浮上したことなどにより上昇しました。

○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

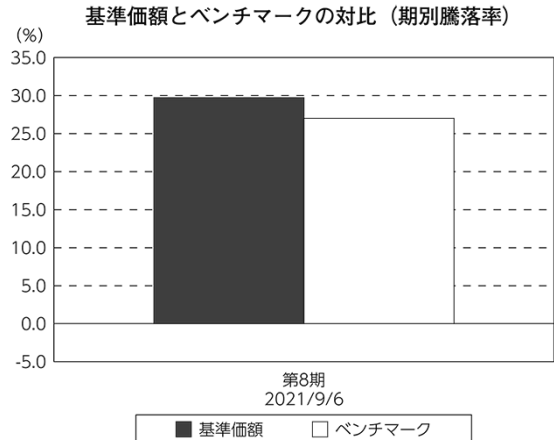
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。

○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+29.7%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+27.0%を2.7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

(2020年9月8日～2021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	%	(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、17,539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

(2020年9月8日～2021年9月6日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		1,112	2,981,808	1,622	4,403,655
		(△ 688)	(-)		

*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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		6,008	6,086	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年9月8日～2021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	7,385,463千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,740,305千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68

*(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

(2020年9月8日～2021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 2,981	百万円 3	% 0.1	百万円 4,403	百万円 0.2289	% 0.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 9	百万円 18	百万円 51

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。

(2021年9月6日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)			
日本水産	8.4	7.5	4,687
マルハニチロ	1.2	—	—
鉱業 (0.2%)			
I N P E X	30.9	32.3	24,644
建設業 (2.5%)			
ミライト・ホールディングス	—	2.8	6,398
安藤・間	5	5.2	4,388
東急建設	2.5	2.4	1,900
コムシスホールディングス	3	2.9	9,048
東建コーポレーション	—	0.2	2,182
大成建設	6.5	5.8	20,909
大林組	19.4	18.6	17,632
清水建設	19.7	17.4	14,181
長谷工コーポレーション	7.5	6.1	9,595
鹿島建設	15.2	13.6	20,304
西松建設	1.5	1.3	4,686
三井住友建設	4.7	4.5	2,173
前田建設工業	4.9	4.7	3,915
戸田建設	8.1	7.7	6,391
熊谷組	0.9	0.9	2,484
大東建託	2.1	2	25,080
N I P P O	1.6	1.5	5,272
五洋建設	7.7	7.9	5,798
住友林業	4.9	4.8	10,440
大和ハウス工業	19.2	17.2	60,888
積水ハウス	21	20.2	46,217
関電工	—	3	2,853
協和エクシオ	2.9	2.8	7,963
九電工	1.4	1.3	5,369
食料品 (3.8%)			
森永製菓	1.5	1.4	5,579
江崎グリコ	1.7	—	—
カルビー	2.8	2.7	7,560
森永乳業	—	1.1	7,865

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤクルト本社	4.3	4.1	26,035
明治ホールディングス	4.1	3.9	26,988
プリマハム	—	0.8	2,436
日本ハム	2.4	2.3	10,166
アサヒグループホールディングス	13	14	75,362
キリンホールディングス	26.3	21.9	45,409
サントリー食品インターナショナル	4.2	4	18,100
伊藤園	—	1.8	12,600
キッコーマン	4.5	4.3	38,829
味の素	13.7	14.1	48,292
キュービー	3.5	3.3	8,946
カゴメ	—	2.3	6,860
アリアケジャパン	0.6	0.5	3,190
ニチレイ	3	2.8	8,038
東洋水産	3.2	3.1	14,461
日清食品ホールディングス	2.6	2.3	19,849
日本たばこ産業	33.3	31.9	69,542
繊維製品 (0.4%)			
帝人	4.9	5.5	8,910
東レ	43.9	42	31,588
ゴールドウイン	1.1	1	7,070
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	25.3	26.1	15,555
大王製紙	—	2.8	6,003
レンゴー	—	6	5,430
化学 (8.1%)			
クラレ	9.5	8.5	9,001
旭化成	40.2	38.5	44,544
昭和電工	4.6	4.1	10,422
住友化学	44.5	45.7	26,597
日産化学	3.4	3.2	21,184
東ソー	9.4	9	18,936
トクヤマ	1.7	1.7	3,821
デンカ	2.2	2.1	8,484
信越化学工業	10.4	9.2	179,170

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エア・ウォーター	5.6	5.9	10,838
日本酸素ホールディングス	5.8	4.8	13,838
三菱瓦斯化学	5.6	5.8	13,154
三井化学	5.5	5	19,150
J S R	5.6	—	—
三菱ケミカルホールディングス	40.5	38.8	38,256
ダイセル	7.9	7.8	7,004
積水化学工業	12.8	12.1	23,691
日本ゼオン	—	5.2	8,268
アイカ工業	1.8	1.6	6,024
宇部興産	3.1	2.9	6,643
ダイキョーニシカワ	1.3	—	—
日油	2.3	2.2	14,454
花王	14.8	13.1	89,761
日本ペイントホールディングス	5	21.8	30,498
関西ペイント	6.8	6.5	19,097
D I C	2.6	2.5	8,087
富士フィルムホールディングス	—	10.4	99,309
資生堂	12.3	11	85,404
ライオン	8	7.2	13,701
ファンケル	—	2.2	8,404
コーセー	1.2	1.1	14,421
ポーラ・オルビスホールディングス	2.6	2.5	6,235
小林製薬	1.7	1.7	15,351
日東電工	4.3	3.6	31,788
エフビコ	—	1.1	4,702
ニフコ	2.3	2.2	7,821
ユニ・チャーム	13.1	11.4	55,860
医薬品 (6.7%)			
協和キリン	6.2	7	27,755
武田薬品工業	39.5	46.2	172,187
アステラス製薬	53.7	51.4	97,994
大日本住友製薬	4.6	4.4	9,160
塩野義製薬	7.8	7.5	54,600
日本新薬	1.6	1.7	15,742
中外製薬	19.4	18.5	82,269
科研製薬	1.1	1	5,120
エーザイ	7.4	6.5	59,930
ロート製薬	—	2.8	9,856
小野薬品工業	14.2	13.6	37,379

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
久光製薬	1.6	—	—
参天製薬	11.5	10.3	17,355
J C Rファーマ	—	1.7	4,964
東和薬品	—	0.9	2,862
沢井製薬	1.3	—	—
第一三共	17.7	46.6	130,014
大塚ホールディングス	12.9	12.3	60,171
ペプチドリーム	3.1	3.1	12,415
サワイグループホールディングス	—	1.3	6,799
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	6.9	6.6	17,846
ENEOSホールディングス	93.1	89.1	39,141
コスモエネルギーホールディングス	1.8	1.9	4,229
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	3.6	3.4	6,643
TOYO TIRE	—	3.1	6,373
ブリヂストン	16.5	17.1	89,518
住友ゴム工業	5.6	5.3	7,298
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	5.7	5.4	30,618
太平洋セメント	3.9	3.4	8,935
東海カーボン	6.1	5	7,995
TOTO	4.4	4.2	27,006
日本碍子	7.4	6.5	12,356
日本特殊陶業	4.7	4.5	7,834
ニチアス	1.7	1.5	4,359
鉄鋼 (—%)			
日本製鉄	27.4	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	16.5	—	—
日立金属	6.6	—	—
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	15.5	—	—
三井金属鉱業	—	1.6	5,512
住友金属鉱山	7.8	7.5	32,347
DOWAホールディングス	1.5	—	—
古河電気工業	1.9	—	—
住友電気工業	22.9	20.4	30,977
アサヒホールディングス	—	2.2	5,016
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	7.8	7.5	18,832

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三和ホールディングス	5.8	5.5	8,415
リンナイ	1.2	1.1	13,717
東プレ	1.1	—	—
機械 (6.5%)			
日本製鋼所	—	1.8	5,254
三浦工業	—	2.5	12,437
アマダ	7.6	8.6	10,363
F U J I	—	2.3	6,879
オーエスジー	3	2.7	5,643
DMG森精機	3.9	3.5	7,381
ディスコ	0.8	0.8	26,920
オプトラン	—	0.7	1,663
ナブテスコ	3.6	3.3	15,708
三井海洋開発	0.7	—	—
SMC	1.9	1.7	130,543
小松製作所	28	26.8	76,621
住友重機械工業	3.5	3.4	10,455
日立建機	2.5	2.8	9,450
ハーモニック・ドライブ・システムズ	1.3	—	—
クボタ	32.8	28.9	71,368
荏原製作所	—	2.5	15,550
ダイキン工業	7.9	7.5	218,137
ダイフク	3.2	3.3	35,838
竹内製作所	1	1	2,766
T P R	0.8	—	—
ホシザキ	—	1.7	18,139
日本精工	11.7	12.2	9,406
ジェイテクト	5.9	—	—
THK	3.9	—	—
マキタ	8.1	7.7	52,283
三菱重工業	10.4	9.3	27,895
I H I	4.5	4	10,436
電気機器 (18.6%)			
コニカミノルタ	13.5	—	—
ブラザー工業	7.6	7.2	17,517
ミネベアミツミ	11.5	10.2	30,304
日立製作所	29.7	27	178,389
三菱電機	61.9	59.3	91,055
富士電機	3.7	3.6	17,838
安川電機	6.7	6.4	37,632

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東芝テック	0.8	—	—
日本電産	14.9	13.3	173,432
日新電機	1.5	—	—
オムロン	5.5	4.9	55,223
MC J	—	1.9	2,470
日本電気	7.5	7.5	45,600
富士通	6	5.3	113,870
ルネサスエレクトロニクス	26.5	32	41,280
セイコーエプソン	7.7	7.4	16,479
ワコム	—	4.3	3,130
アルバック	1.1	1.1	6,985
エレコム	0.7	1.4	2,671
パナソニック	70.7	63.2	86,868
アンリツ	—	3.6	7,200
富士通ゼネラル	1.7	—	—
ソニーグループ	26.2	15.9	190,005
TDK	3	2.9	35,641
アルプスアルパイン	5.5	—	—
ヒロセ電機	1	—	—
横河電機	5.7	5.9	11,139
アズビル	3.9	4	20,520
日本光電工業	2.6	2.4	9,216
堀場製作所	1.2	1.1	8,877
アドバンテスト	4.6	4.4	45,760
キーエンス	4.4	3.1	214,706
シスメックス	4.4	4.6	64,906
OBARA GROUP	0.4	—	—
レーザーテック	2.7	2.6	71,552
スタンレー電気	4.3	4.1	11,488
カシオ計算機	5.5	4.8	8,558
ファナック	5.8	5.2	135,356
浜松ホトニクス	4.4	4.3	29,326
京セラ	8.7	9	65,970
太陽誘電	2.8	2.6	18,278
村田製作所	18.2	17.4	169,876
小糸製作所	3.7	3.5	24,150
S C R E E Nホールディングス	1.1	1	10,110
キヤノン	30.8	—	—
東京エレクトロン	3.9	3.5	175,630

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (6.2%)			
トヨタ紡織	1.8	1.7	3,583
豊田自動織機	5	4.8	47,184
デンソー	13.6	13	103,155
川崎重工業	4.8	—	—
いすゞ自動車	17.9	15.7	23,031
トヨタ自動車	23.7	17.7	176,327
日野自動車	7.7	7.4	7,407
アイシン	5.1	4.3	18,640
マツダ	18.2	—	—
本田技研工業	48.7	46.7	157,939
スズキ	12.3	11.7	57,622
SUBARU	19.2	17	35,079
ヤマハ発動機	8.7	7.7	22,545
豊田合成	2	1.9	4,495
シマノ	2.3	2.4	80,208
テイ・エス テック	1.4	2.8	4,326
精密機器 (3.7%)			
テルモ	17.5	18.2	91,728
島津製作所	7.4	7.6	40,052
ブイ・テクノロジー	0.3	0.3	1,461
東京精密	1.1	1	5,040
ニコン	9.4	—	—
オリンパス	34.2	31.1	75,479
HOYA	12.3	11.6	208,568
朝日インテック	7	6.5	21,547
その他製品 (1.9%)			
バンダイナムコホールディングス	6.4	4.9	40,910
パイロットコーポレーション	1.1	1	4,345
タカラトミー	2.8	—	—
ヤマハ	3.7	3.5	25,060
ビジョン	4	3.6	11,646
任天堂	3.8	2.7	148,878
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	18.9	18.1	23,973
関西電力	23.4	22.5	24,153
中国電力	—	8.5	8,746
東北電力	15.5	13.9	11,634
九州電力	12.8	13.1	11,004
北海道電力	—	5.5	2,810

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電源開発	4.9	4.7	7,670
イーレックス	—	0.9	2,218
レノバ	—	1	4,900
東京瓦斯	11.9	11.4	24,766
大阪瓦斯	12	10.7	22,577
陸運業 (1.7%)			
東武鉄道	6.5	—	—
相鉄ホールディングス	2.6	—	—
東急	15.6	—	—
小田急電鉄	9.2	—	—
京王電鉄	3.2	—	—
京成電鉄	4.3	—	—
東日本旅客鉄道	10.9	—	—
西日本旅客鉄道	5.5	—	—
東海旅客鉄道	5.1	4.9	76,807
西武ホールディングス	8.1	—	—
近鉄グループホールディングス	5.9	—	—
阪急阪神ホールディングス	7.8	7.5	25,350
京阪ホールディングス	3.5	—	—
名古屋鉄道	6.4	—	—
日本通運	2	1.9	15,105
ヤマトホールディングス	10.3	7.9	22,491
山九	1.6	1.4	7,336
センコーグループホールディングス	—	3.1	3,137
日立物流	1.1	1.2	5,592
丸和運輸機関	—	1.2	2,000
九州旅客鉄道	—	4.3	10,707
S Gホールディングス	—	10.6	32,330
海運業 (0.6%)			
日本郵船	—	4.7	46,201
商船三井	—	3.3	29,634
空運業 (—%)			
日本航空	10.4	—	—
ANAホールディングス	10.7	—	—
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
近鉄エクスプレス	—	1.1	3,025
情報・通信業 (7.9%)			
NECネットエスアイ	—	1.9	4,105
システナ	—	2.1	4,867
日鉄ソリューションズ	0.9	0.8	3,136

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T I S	6.1	5.8	18,705
コーエーテックホールディングス	—	1.5	7,785
ネクソン	15.3	13.1	29,055
コロブラ	2	—	—
ティーガイア	0.5	0.6	1,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.5	1.6	3,563
GMOペイメントゲートウェイ	1.3	1.1	16,467
ラクス	—	2.3	9,004
アカツキ	0.2	0.2	658
野村総合研究所	8.6	10.1	43,783
インフォコム	—	0.5	1,260
オービック	2.1	1.8	39,960
ジャストシステム	—	0.8	5,384
Zホールディングス	83.4	79.9	59,149
トレンドマイクロ	3.2	3.1	19,468
日本オラクル	1.2	1.2	11,364
伊藤忠テクノソリューションズ	2.8	2.6	9,178
大塚商会	3.3	3.1	18,414
電通国際情報サービス	—	0.8	3,572
東映アニメーション	—	0.2	3,992
デジタルガレージ	1.1	1	5,120
日本ユニシス	1.9	2	6,180
日本テレビホールディングス	5.1	—	—
USEN-NEXT HOLDINGS	—	0.6	1,872
日本電信電話	61.8	59.3	191,005
KDDI	44.3	46.6	170,975
光通信	0.6	0.7	14,420
NTTドコモ	43.4	—	—
東宝	3.6	3.4	17,374
エヌ・ティ・ティ・データ	16.2	15.5	33,418
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.6	2.5	16,700
カブコン	2.9	5	16,700
S C S K	1.4	1.3	9,451
コナミホールディングス	2.2	2.1	15,561
ソフトバンクグループ	29.2	22.1	139,672
卸売業 (5.3%)			
双日	33.7	32.2	10,948
アルフレッサ ホールディングス	6.8	6.1	10,967
神戸物産	2.1	4.5	19,575
ダイワボウホールディングス	0.5	2.7	5,637

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TOKAIホールディングス	3.2	2.8	2,567
シブヘルスケアホールディングス	1	2.1	6,069
コマダホールディングス	1.3	1.3	2,678
第一興商	1.2	—	—
メディバルホールディングス	6.6	5.8	12,609
日本ライフライン	1.8	1.9	2,620
伊藤忠商事	42.6	40.8	138,475
丸紅	63.4	57.6	51,880
豊田通商	6.8	5.9	29,677
兼松	2.3	2.3	3,302
三井物産	52.8	46.6	116,779
住友商事	38.5	36.8	58,604
三菱商事	40	35.5	122,013
岩谷産業	1.4	1.4	8,946
PALTAC	1	0.9	4,311
日鉄物産	0.4	0.4	2,052
ミスミグループ本社	7.6	7.3	33,908
小売業 (4.0%)			
ローソン	1.5	1.5	8,280
エービーシー・マート	1	0.9	5,346
日本マクドナルドホールディングス	2.6	2.7	14,175
セリア	1.5	1.4	5,656
ビックカメラ	3.6	3.5	3,780
MonotaRO	4.3	7.4	18,492
J. フロント リテイリング	7.3	—	—
マツモトキヨシホールディングス	2.5	2.4	12,528
ZOZO	4.2	3.4	14,433
ウエルシアホールディングス	3.6	3.1	12,167
クリエイトSDホールディングス	1	0.9	3,537
すかいらーくホールディングス	6.8	—	—
コスモス薬品	0.5	0.6	11,844
セブン&アイ・ホールディングス	23.8	22.8	112,905
ツルハホールディングス	1.3	1.3	17,992
クスリのアオキホールディングス	0.5	0.6	4,752
FOOD & LIFE COMPANIE	—	3.4	16,881
ノジマ	1.1	1	2,821
良品計画	8.1	6.7	16,649
コーナン商事	—	0.8	3,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	13.4	11.7	24,885
ゼンショーホールディングス	2.9	3.1	8,602

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワークマン	0.6	0.8	5,400
ユナイテッドアローズ	0.6	—	—
スギホールディングス	1.2	1.2	9,912
ファミリーマート	4.9	—	—
ライフコーポレーション	—	0.5	2,305
しまむら	0.7	—	—
丸井グループ	5.6	4.9	10,177
イオン	23.5	—	—
イズミ	1.2	1.2	4,356
ヤオコー	0.7	0.7	5,082
ケーズホールディングス	5.9	5	6,095
アインホールディングス	0.7	0.8	5,776
ニトリホールディングス	2.6	2.3	48,530
ファーストリテイリング	0.8	0.8	61,296
サンドラッグ	2.3	2.2	8,151
銀行業 (5.0%)			
めぶきフィナンシャルグループ	31.7	30.4	7,569
コンコルディア・フィナンシャルグループ	34.9	35.6	15,628
新生銀行	4.5	4.8	6,787
あおぞら銀行	3.6	3.5	9,299
三菱UFJフィナンシャル・グループ	307.9	286.1	175,808
りそなホールディングス	66.4	67.4	29,406
三井住友トラスト・ホールディングス	11.5	11	41,063
三井住友フィナンシャルグループ	40.9	40.4	157,398
千葉銀行	20.4	19.5	13,435
ふくおかフィナンシャルグループ	—	5.3	11,082
セブン銀行	20.4	19.5	5,011
みずほフィナンシャルグループ	829.4	79.4	126,007
証券、商品先物取引業 (0.9%)			
F P G	1.9	2	1,414
GMOフィナンシャルホールディングス	—	1.1	948
S B Iホールディングス	6.8	7.2	20,462
ジャフコ グループ	—	0.7	4,921
大和証券グループ本社	49	43.8	28,886
野村ホールディングス	107.4	89.2	51,816
松井証券	3.5	—	—
保険業 (2.5%)			
S O M P Oホールディングス	11.5	10.3	51,613
MS&ADインシュアランスグループホール	16	14.2	53,519
第一生命ホールディングス	34.5	28.8	67,464

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京海上ホールディングス	21.6	19.2	107,212
T & Dホールディングス	18.2	17.5	24,990
その他金融業 (1.4%)			
全国保証	1.7	1.5	8,325
芙蓉総合リース	0.6	0.6	4,632
みずほリース	—	0.9	3,258
東京センチュリー	1.2	1.4	8,988
イオンフィナンシャルサービス	3.7	3.6	4,719
アコム	—	11.5	4,922
オリエントコーポレーション	16.5	15.8	2,338
オリックス	37.9	35.5	76,573
三菱HCキャピタル	15.5	20.2	12,079
日本取引所グループ	17.5	15.8	45,077
不動産業 (2.3%)			
いちご	7.8	6.5	2,255
ヒューリック	12.7	12.4	16,653
野村不動産ホールディングス	3.7	3.4	10,217
サムティ	—	0.8	1,848
プレサンスコーポレーション	1	1	1,835
オープンハウス	1.9	1.9	10,279
東急不動産ホールディングス	16.6	15.9	10,668
飯田グループホールディングス	5.1	4.9	13,803
パーク24	3.3	—	—
三井不動産	30.1	26.6	71,460
三菱地所	42.8	38.4	68,812
東京建物	6	5.8	9,894
住友不動産	13.7	13.1	50,670
スターツコーポレーション	0.8	0.7	2,082
日本エスコ	—	1.1	889
イオンモール	3.1	2.9	4,935
カチタス	—	1.4	5,607
日本空港ビルデング	1.9	—	—
サービス業 (5.3%)			
ミクシィ	1.5	1.4	3,771
ジェイエイシーリクルートメント	0.4	—	—
日本M&Aセンター	4.5	9.3	31,480
UTグループ	0.9	0.8	2,540
エス・エム・エス	1.8	1.9	7,647
パーソルホールディングス	5.9	5.7	15,310
総合警備保障	2.4	2.3	11,523

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カカクコム	4.4	4.2	15,792
ディップ	0.8	0.9	3,456
ベネフィット・ワン	2.2	2.1	10,384
エムスリー	13	10	80,720
アウトソーシング	3.4	3.2	6,480
ディー・エヌ・エー	2.5	—	—
博報堂DYホールディングス	8.2	7.9	14,899
電通グループ	6.6	—	—
オリエンタルランド	6.3	6	100,530
リゾートトラスト	2.7	—	—
ユー・エス・エス	6.6	6.3	11,951
サイバーエージェント	3.6	—	—
楽天グループ	27.6	—	—
ブルキャストホールディングス	—	0.5	1,122
エン・ジャパン	1.1	1	3,820
テクノプロ・ホールディングス	1.2	3.4	10,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.2	2,620	
ジャパンマテリアル	—	1.7	2,242	
リクルートホールディングス	42.4	31.4	207,993	
ベルシステム24ホールディングス	—	0.9	1,500	
ペイカレント・コンサルティング	—	0.4	21,040	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	—	1.6	4,451	
リログループ	3.2	3.1	7,402	
カナモト	1	1	2,638	
セコム	6.3	5.6	47,947	
メイテック	0.7	0.7	4,662	
イオンディライト	—	0.7	2,555	
合 計	株 数 ・ 金 額	5,148	3,950	12,075,613
	銘柄数 < 比率 >	396	400	< 98.4% >

*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 189	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 12,075,613	% 97.0
コール・ローン等、その他	372,397	3.0
投資信託財産総額	12,448,010	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 (2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,448,010,574
コール・ローン等	183,947,498
株式(評価額)	12,075,613,070
未収入金	178,640,323
未収配当金	6,839,183
差入委託証拠金	2,970,500
(B) 負債	180,883,555
未払解約金	180,883,411
未払利息	144
(C) 純資産総額(A-B)	12,267,127,019
元本	6,232,070,393
次期繰越損益金	6,035,056,626
(D) 受益権総口数	6,232,070,393口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,684円

(注) 期首元本額は7,291,689,170円、期中追加設定元本額は1,627,049,953円、期中一部解約元本額は2,686,668,730円、1口当たり純資産額は1,9684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	4,300,192,001円
・JPX日経400ファンド	1,310,018,643円
・野村DC・JPX日経400ファンド	621,859,749円

○損益の状況 (2020年9月8日～2021年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	233,865,499
受取配当金	233,846,997
その他収益金	80,101
支払利息	△ 61,599
(B) 有価証券売買損益	2,630,794,491
売買益	2,829,476,356
売買損	△ 198,681,865
(C) 先物取引等取引損益	70,854,236
取引益	90,095,686
取引損	△ 19,241,450
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,935,514,226
(E) 前期繰越損益金	3,773,496,288
(F) 追加信託差損益金	1,287,694,712
(G) 解約差損益金	△1,961,648,600
(H) 計(D+E+F+G)	6,035,056,626
次期繰越損益金(H)	6,035,056,626

*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。