

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第32期 (決算日2019年2月18日)

作成対象期間 (2018年2月20日～2019年2月18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	無期限 (1987年2月18日設定)
運用方針	日経平均株価と連動する投資成果を目標として運用します。原則として日経平均株価に採用されている銘柄のうち200銘柄以上に等株数投資を行い、株式の組入比率は高位に保ちます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均株価に採用されている銘柄を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算を行い、原則として利子・配当収入等を中心として分配します。

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/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	標準 価 額			ベンチ マ ー ク		株 式 株 組 入 比 率	株 式 株 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配 金	騰 落 率	中 率	日 経 平 均 株 価 (日 経 225)	騰 落 率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円	
28期(2015年2月17日)	6,424	60	26.3	17,987	25.0	97.2	2.7	24,505	
29期(2016年2月17日)	5,672	40	△11.1	15,836	△12.0	96.9	3.1	27,094	
30期(2017年2月17日)	6,906	70	23.0	19,235	21.5	98.6	1.3	26,160	
31期(2018年2月19日)	7,969	75	16.5	22,149	15.2	96.3	3.6	23,547	
32期(2019年2月18日)	7,693	70	△2.6	21,282	△3.9	96.8	3.1	27,909	

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○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 式 株 組 入 比 率	株 式 株 先 物 比 率
			日 経 平 均 株 価 (日 経 225)	騰 落 率		
(期 首)	円	%	円	%	%	%
2018年2月19日	7,969	—	22,149	—	96.3	3.6
2月末	7,944	△0.3	22,068	△0.4	97.3	2.6
3月末	7,777	△2.4	21,454	△3.1	96.7	3.2
4月末	8,143	2.2	22,468	1.4	97.4	2.6
5月末	8,043	0.9	22,202	0.2	96.2	3.7
6月末	8,086	1.5	22,305	0.7	96.3	3.7
7月末	8,172	2.5	22,554	1.8	97.4	2.5
8月末	8,285	4.0	22,865	3.2	98.2	1.7
9月末	8,792	10.3	24,120	8.9	96.5	3.3
10月末	7,993	0.3	21,920	△1.0	95.7	4.3
11月末	8,147	2.2	22,351	0.9	97.0	2.9
12月末	7,306	△8.3	20,015	△9.6	96.4	3.6
2019年1月末	7,579	△4.9	20,773	△6.2	96.5	3.5
(期 末)						
2019年2月18日	7,693	△2.6	21,282	△3.9	96.8	3.1

*期末基準価額は分配金込み、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。

- ①「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」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「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③「株式インデックス 225」は、野村アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び「株式インデックス 225」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」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株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：7,969円

期 末：7,693円 (既払分配金(税込み)：70円)

騰落率：△2.6% (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(2018年2月19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、日経平均株価(日経225)です。ベンチマークは、作成期首(2018年2月19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7,969円から期末7,763円(分配金込み)に206円の値下がりとなりました。

米中貿易摩擦への懸念や、FOMC(米連邦公開市場委員会)の利上げ決定を受けて景気減速への警戒感が高まったことなどから米国株式市場が下落したことを受け、基準価額は下落しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首より外国為替市場で円高ドル安が進行したことや、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながる懸念などから下落しました。2018年3月下旬以降は、米通商政策の見通しや、円高ドル安が是正されたことなどから上昇し、その後は一進一退の展開となりました。

9月以降は、米中貿易摩擦への懸念が後退したこと、自民党総裁選で安倍首相が3選を果たし国内政治動向の安定が確認されたことなどから上昇しましたが、10月に入ると米国の長期金利の急上昇や、米中貿易摩擦への警戒感の高まりなどから世界的な株安となり、下落しました。さらに12月には、FOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ決定を受けて景気減速への警戒感が高まったことなどから米国株式市場の下落が続いたことを受け、下落しました。

2019年1月以降は、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が柔軟な金融政策運営方針を示したことで今後の金融引き締めへの懸念が薄らいだことなどから米国株式市場が上昇したことを受け、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

株式の実質組入比率（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

日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資をしております。期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどに応じてポートフォリオの修正を行いました。

なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○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-2.6%となり、ベンチマークである日経平均株価の-3.9%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。

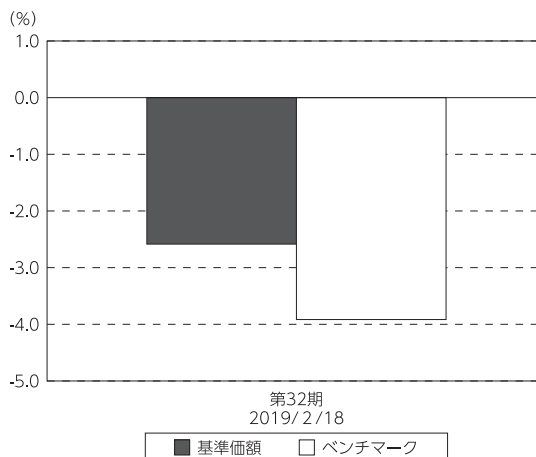
(プラス要因)

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには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、日経平均株価 (日経225) です。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の配当等収益から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32期
	2018年2月20日～ 2019年2月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	70 0.902%
当期の収益	70
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,947

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても、株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価と連動する投資成果を目指して参ります。

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

(2018年2月20日～2019年2月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	54	0.668	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(23)	(0.291)	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 ）	(26)	(0.323)	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)	(0.054)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(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 ）	(0)	(0.002)	
(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	54	0.674	
期中の平均基準価額は、8,022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。

* 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

(2018年2月20日～2019年2月18日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		2,210 (△ 268)	7,622,731 ()	701	2,523,074

*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	百万円	百万円	百万円
		14,408	14,411	—	—

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2018年2月20日～2019年2月18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	10,145,806千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	24,665,414千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

* (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

(2018年2月20日～2019年2月18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 7,622	百万円 0.568683	0.0	百万円 2,523	百万円 —	—	

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	6	2	21

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)	640千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.183千円
(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

(2019年2月18日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
水産・農林業 (0.2%)						
日本水産	38	47	34,404			
マルハニチロ	3.8	4.7	17,413			
鉱業 (0.1%)						
国際石油開発帝石	15.2	18.8	21,469			
建設業 (2.4%)						
コムシスホールディングス	38	47	133,433			
大成建設	7.6	9.4	46,718			
大林組	38	47	49,538			
清水建設	38	47	43,945			
長谷工コーポレーション	7.6	9.4	12,539			
鹿島建設	38	23.5	37,482			
大和ハウス工業	38	47	156,651			
積水ハウス	38	47	75,952			
日揮	38	47	81,780			
千代田化工建設	38	47	14,147			
食料品 (4.6%)						
日清製粉グループ本社	38	47	110,215			
明治ホールディングス	7.6	9.4	82,344			
日本ハム	38	23.5	102,225			
サッポロホールディングス	7.6	9.4	22,447			
アサヒグループホールディングス	38	47	224,143			
キリンホールディングス	38	47	121,142			
宝ホールディングス	38	47	57,387			
キッコーマン	38	47	257,090			
味の素	38	47	78,137			
ニチレイ	19	23.5	64,366			
日本たばこ産業	38	47	131,600			
繊維製品 (0.2%)						
東洋紡	3.8	4.7	7,712			
ユニチカ	3.8	4.7	2,350			
帝人	7.6	9.4	17,578			
東レ	38	47	37,454			
パルプ・紙 (0.2%)						
王子ホールディングス	38	47	31,114			
日本製紙	3.8	4.7	9,512			
化学 (8.7%)						
クラレ	38	47	72,380			
旭化成	38	47	55,060			
昭和電工	3.8	4.7	18,259			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友化学	38	47	26,320
日産化学	38	47	263,200
東ソー	19	23.5	38,751
トクヤマ	7.6	9.4	26,996
デンカ	7.6	9.4	32,806
信越化学工業	38	47	446,359
三井化学	7.6	9.4	26,310
三菱ケミカルホールディングス	19	23.5	19,293
宇部興産	3.8	4.7	12,224
日本化薬	38	47	61,053
花王	38	47	385,964
D I C	—	4.7	16,732
富士フイルムホールディングス	38	47	236,551
資生堂	38	47	340,938
日東電工	38	47	282,752
医薬品 (8.5%)			
協和発酵キリン	38	47	101,003
武田薬品工業	38	47	211,876
アステラス製薬	190	235	397,032
大日本住友製薬	38	47	126,007
塩野義製薬	38	47	326,838
中外製薬	38	47	332,760
エーザイ	38	47	411,720
第一三共	38	47	178,506
大塚ホールディングス	38	47	209,009
石油・石炭製品 (0.4%)			
昭和シェル石油	38	47	81,122
J X T Gホールディングス	38	47	26,973
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	19	23.5	55,107
ブリヂストン	38	47	206,894
ガラス・土石製品 (1.4%)			
A G C	7.6	9.4	36,895
日本板硝子	3.8	4.7	4,606
日本電気硝子	11.4	14.1	41,933
住友大阪セメント	38	4.7	22,301
太平洋セメント	3.8	4.7	17,507
東海カーボン	38	47	72,098
T O T O	19	23.5	101,990
日本碍子	38	47	78,490
鉄鋼 (0.1%)			
新日鐵住金	3.8	4.7	9,677
神戸製鋼所	3.8	4.7	4,145

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.8	4.7	9,136
日新製鋼	3.8	—	—
大平洋金属	3.8	4.7	13,310
非鉄金属 (1.0%)			
日本軽金属ホールディングス	38	47	11,468
三井金属鉱業	3.8	4.7	12,497
東邦亜鉛	3.8	4.7	14,875
三菱マテリアル	3.8	4.7	14,429
住友金属鉱山	19	23.5	71,322
DOWAホールディングス	7.6	9.4	32,994
古河機械金属	3.8	—	—
古河電気工業	3.8	4.7	16,732
住友電気工業	38	47	71,910
フジクラ	38	47	23,030
金属製品 (0.4%)			
S U M C O	3.8	4.7	7,473
東洋製罐グループホールディングス	38	47	104,481
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	7.6	9.4	19,373
オークマ	7.6	9.4	56,682
アマダホールディングス	38	47	55,460
小松製作所	38	47	129,931
住友重機械工業	7.6	9.4	35,767
日立建機	38	47	135,454
クボタ	38	47	72,027
荏原製作所	7.6	9.4	29,798
ダイキン工業	38	47	568,230
日本精工	38	47	49,585
N T N	38	47	16,591
ジェイテクト	38	47	66,411
日立造船	7.6	9.4	3,365
三菱重工業	3.8	4.7	20,242
I H I	3.8	4.7	15,416
電気機器 (17.1%)			
日清紡ホールディングス	38	47	44,932
コニカミノルタ	38	47	50,713
ミネベアミツミ	38	47	85,117
日立製作所	38	9.4	33,012
三菱電機	38	47	67,891
富士電機	38	9.4	32,336
安川電機	38	47	153,455
ジーエス・ユアサ コーポレーション	38	9.4	21,319
日本電気	3.8	4.7	17,578

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士通	38	4.7	36,382
沖電気工業	3.8	4.7	6,128
セイコーエプソン	76	94	157,450
パナソニック	38	47	48,974
ソニー	38	47	238,760
TDK	38	47	415,010
アルプスアルパイン	38	47	110,262
バイオニア	38	47	3,102
横河電機	38	47	100,674
アドバンテスト	76	94	254,834
カシオ計算機	38	47	72,239
ファナック	38	47	911,800
京セラ	76	94	587,124
太陽誘電	38	47	112,048
SCREENホールディングス	7.6	9.4	44,650
キヤノン	57	70.5	225,459
リコー	38	47	52,452
東京エレクトロン	38	47	747,065
輸送用機器 (5.5%)			
デンソー	38	47	225,647
三井E&Sホールディングス	3.8	4.7	5,691
川崎重工業	3.8	4.7	13,418
日産自動車	38	47	44,560
いすゞ自動車	19	23.5	37,106
トヨタ自動車	38	47	312,785
日野自動車	38	47	48,504
三菱自動車工業	3.8	4.7	3,008
マツダ	7.6	9.4	12,064
本田技研工業	76	94	282,282
スズキ	38	47	269,686
SUBARU	38	47	134,091
ヤマハ発動機	38	47	104,857
精密機器 (3.6%)			
テルモ	76	94	629,706
ニコン	38	47	82,438
オリンパス	38	47	224,425
シチズン時計	38	47	29,657
その他製品 (1.3%)			
凸版印刷	38	23.5	41,007
大日本印刷	19	23.5	59,220
ヤマハ	38	47	248,630
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	3.8	4.7	3,073

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中部電力	3.8	4.7	8,025
関西電力	3.8	4.7	7,496
東京瓦斯	7.6	9.4	28,059
大阪瓦斯	7.6	9.4	20,764
陸運業 (2.4%)			
東武鉄道	7.6	9.4	29,046
東京急行電鉄	19	23.5	42,535
小田急電鉄	19	23.5	57,739
京王電鉄	7.6	9.4	58,750
京成電鉄	19	23.5	87,302
東日本旅客鉄道	3.8	4.7	48,786
西日本旅客鉄道	3.8	4.7	37,971
東海旅客鉄道	3.8	4.7	113,176
日本通運	3.8	4.7	31,443
ヤマトホールディングス	38	47	138,556
海運業 (0.1%)			
日本郵船	3.8	4.7	8,445
商船三井	3.8	4.7	12,379
川崎汽船	3.8	4.7	7,520
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	3.8	4.7	19,232
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	19	23.5	64,014
情報・通信業 (11.3%)			
ヤフー	15.2	18.8	5,865
トレンドマイクロ	38	47	247,220
スカパーJ S A Tホールディングス	3.8	4.7	2,350
日本電信電話	7.6	9.4	43,456
KDD I	228	282	755,760
NTTドコモ	3.8	4.7	12,163
東宝	3.8	4.7	18,776
エヌ・ティ・ティ・データ	190	235	280,825
コナミホールディングス	38	47	212,205
ソフトバンクグループ	114	141	1,462,875
卸売業 (2.3%)			
双日	3.8	4.7	1,964
伊藤忠商事	38	47	94,916
丸紅	38	47	37,886
豊田通商	38	47	167,790
三井物産	38	47	83,542
住友商事	38	47	76,492
三菱商事	38	47	149,977

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 (13.1%)			
J. フロント リテイリング	19	23.5	29,680
三越伊勢丹ホールディングス	38	47	51,653
セブン&アイ・ホールディングス	38	47	232,932
ユニ・ファミリーマートホールディングス	38	47	594,080
高島屋	38	23.5	35,015
丸井グループ	38	47	94,799
イオン	38	47	109,815
ファーストリテイリング	38	47	2,379,140
銀行業 (0.8%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	38	47	21,338
新生銀行	3.8	4.7	7,125
あおぞら銀行	3.8	4.7	15,110
三菱UFJフィナンシャル・グループ	38	47	27,499
りそなホールディングス	3.8	4.7	2,422
三井住友トラスト・ホールディングス	3.8	4.7	19,636
三井住友フィナンシャルグループ	3.8	4.7	18,964
千葉銀行	38	47	32,289
ふくおかフィナンシャルグループ	38	9.4	23,227
静岡銀行	38	47	41,736
みずほフィナンシャルグループ	38	47	8,229
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	38	47	26,667
野村ホールディングス	38	47	21,041
松井証券	38	47	55,225
保険業 (1.0%)			
SOMPOホールディングス	9.5	11.8	48,380
MS&ADインシュアランスグループホール	11.4	14.1	46,882

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.6	9.4	19,552
第一生命ホールディングス	3.8	4.7	8,051
東京海上ホールディングス	19	23.5	128,874
T&Dホールディングス	7.6	9.4	12,957
その他金融業 (0.3%)			
クレディセゾン	38	47	73,414
不動産業 (1.7%)			
東急不動産ホールディングス	38	47	29,046
三井不動産	38	47	125,960
三菱地所	38	47	87,490
東京建物	19	23.5	30,597
住友不動産	38	47	194,439
サービス業 (4.7%)			
ディー・エヌ・エー	11.4	14.1	23,673
電通	38	47	228,185
サイバーエージェント	—	9.4	31,490
楽天	38	47	37,553
リクルートホールディングス	114	141	417,642
日本郵政	38	47	63,685
東京ドーム	19	23.5	22,701
セコム	38	47	437,006
合 計	株 数・金 額	6,610	7,851
	銘柄数<比率>	225	225
			<96.8%>

*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	百万円	百万円
	日経225	873	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年2月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	27,009,877	95.5
コール・ローン等、その他	1,277,393	4.5
投資信託財産総額	28,287,270	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 (2019年2月18日現在)

○損益の状況 (2018年2月20日～2019年2月18日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	28,287,270,147
コール・ローン等	1,163,585,879
株式(評価額)	27,009,877,830
未収入金	64,997,438
未収配当金	48,809,000
(B) 負債	377,330,973
未払収益分配金	253,969,635
未払解約金	26,999,100
未払信託報酬	88,034,264
未払利息	2,061
その他未払費用	425,913
前受金	7,900,000
(C) 純資産総額(A-B)	27,909,939,174
元本	36,281,376,498
次期繰越損益金	△ 8,371,437,324
(D) 受益権総口数	36,281,376,498口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,693円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	428,801,734
受取配当金	429,316,081
受取利息	68
その他収益金	38,345
支払利息	△ 552,760
(B) 有価証券売買損益	△ 947,235,577
売買益	1,807,986,902
売買損	△ 2,755,222,479
(C) 先物取引等取引損益	24,482,704
取引益	227,638,596
取引損	△ 203,155,892
(D) 信託報酬等	△ 170,135,801
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 664,086,940
(F) 前期繰越損益金	3,863,093,834
(G) 追加信託差損益金	△11,316,474,583
(配当等相当額)	(28,595,148,110)
(売買損益相当額)	(△39,911,622,693)
(H) 計(E+F+G)	△ 8,117,467,689
(I) 収益分配金	△ 253,969,635
次期繰越損益金(H+I)	△ 8,371,437,324
追加信託差損益金	△11,316,474,583
(配当等相当額)	(28,595,148,110)
(売買損益相当額)	(△39,911,622,693)
分配準備積立金	3,867,790,132
繰越損益金	△ 922,752,873

(注) 期首元本額は29,549,922,574円、期中追加設定元本額は14,886,179,246円、期中一部解約元本額は8,154,725,322円、1口当たり純資産額は0.7693円です。

*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(D)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(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。

(注) 分配金の計算過程 (2018年2月20日～2019年2月18日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年2月20日～ 2019年2月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	258,665,933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	28,595,148,110円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	3,863,093,834円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	32,716,907,877円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	9,017円
g. 分配金	253,969,635円
h. 分配金(1万口当たり)	70円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	70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。