

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第34期 (決算日2021年2月17日)

作成対象期間 (2020年2月18日～2021年2月17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)	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	%	円	%	%	%	百万円	
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	
33期(2020年2月17日)	8,542	85	12.1	23,523	10.5	97.7	2.2	25,387	
34期(2021年2月17日)	11,032	110	30.4	30,292	28.8	97.7	2.2	28,412	

*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		ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率
	騰 落	率	日 経	マ ー ク		
	円	%	円	%	%	%
(期首) 2020年2月17日	8,542	—	23,523	—	97.7	2.2
2月末	7,682	△10.1	21,143	△10.1	97.6	2.3
3月末	6,938	△18.8	18,917	△19.6	96.7	3.3
4月末	7,399	△13.4	20,194	△14.2	96.1	3.8
5月末	8,012	△6.2	21,878	△7.0	96.8	3.2
6月末	8,168	△4.4	22,288	△5.3	95.1	4.8
7月末	7,952	△6.9	21,710	△7.7	97.6	2.4
8月末	8,472	△0.8	23,140	△1.6	98.2	1.7
9月末	8,535	△0.1	23,185	△1.4	97.0	2.9
10月末	8,455	△1.0	22,977	△2.3	97.9	2.1
11月末	9,724	13.8	26,434	12.4	97.8	2.1
12月末	10,102	18.3	27,444	16.7	97.0	2.9
2021年1月末	10,178	19.2	27,663	17.6	98.4	1.6
(期末) 2021年2月17日	11,142	30.4	30,292	28.8	97.7	2.2

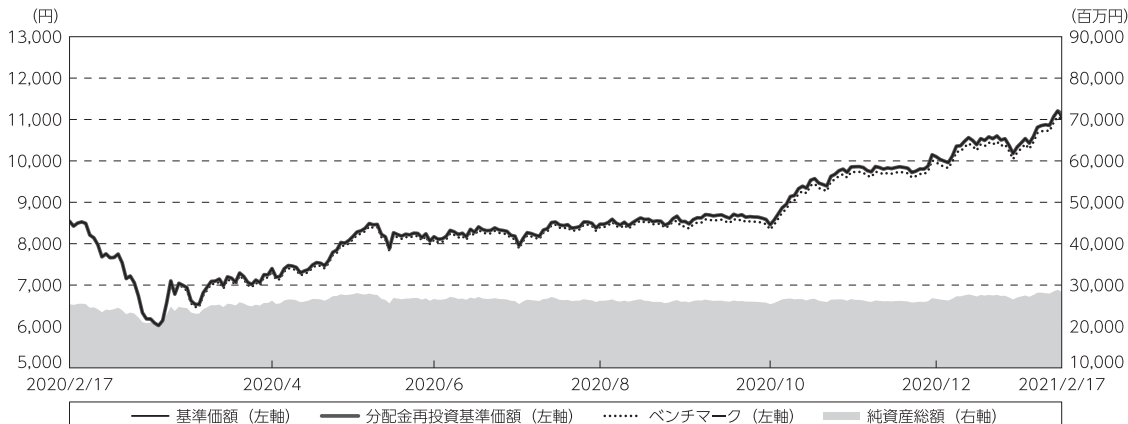
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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



- (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2月17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(2020年2月17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、期首から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、大きく下落しました。2020年3月下旬には、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月下旬には、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。その後は、新型コロナウイルスのワクチン供給への期待感や菅新政権の政策継続への安心感などから堅調に推移しました。

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1月以降は、米国の大型経済対策への期待感などから一段と上昇し、期を通じても上昇しました。

○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みなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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+30.4%となり、ベンチマークである日経平均株価の+28.8%を1.6ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

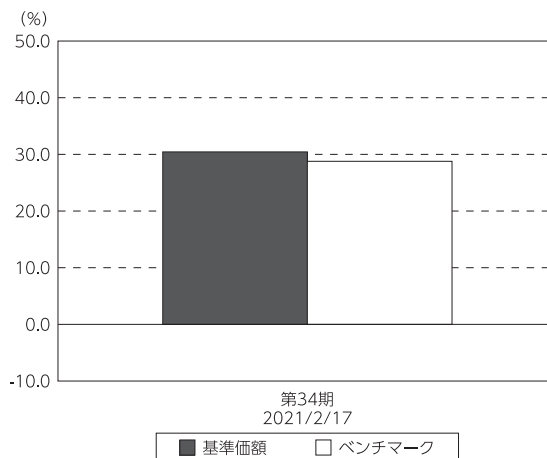
（プラス要因）

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、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34期
	2020年2月18日～ 2021年2月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	110 0.987%
当期の収益	110
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	12,245

(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

(2020年2月18日～2021年2月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	58	0.682	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(25)	(0.297)	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 ）	(28)	(0.330)	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)	(0.055)	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)	(0.003)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	58	0.688	
期中の平均基準価額は、8,468円です。			

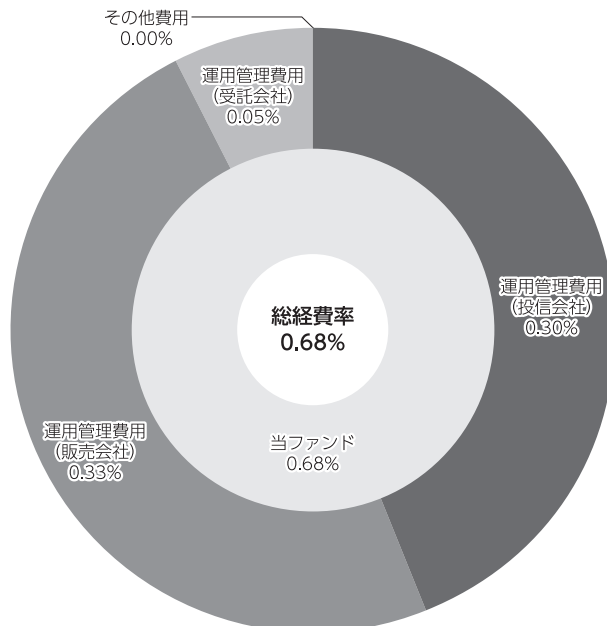
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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。

(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0.68%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) 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2月18日～2021年2月17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		1,449 (89)	4,131,923 (ー)	2,374	8,573,631

*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		16,178	16,259	ー	ー

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年2月18日～2021年2月17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	12,705,555千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	25,179,866千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.50

* (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2月18日～2021年2月17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 4,131	百万円 48	1.2	百万円 8,573	百万円 13	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 未 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	3	6	21

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

(2021年2月17日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)					繊維製品 (0.2%)				
日本水産	38	33	16,698		東洋紡	3.8	3.3	4,521	
マルハニチロ	3.8	3.3	8,157		ユニチカ	3.8	3.3	1,564	
鉱業 (0.0%)					帝人	7.6	6.6	12,414	
国際石油開発帝石	15.2	13.2	10,718		東レ	38	33	23,387	
建設業 (1.6%)					パルプ・紙 (0.1%)				
コムシスホールディングス	38	33	108,240		王子ホールディングス	38	33	23,364	
大成建設	7.6	6.6	25,212		日本製紙	3.8	3.3	4,629	
大林組	38	33	30,888		化学 (7.5%)				
清水建設	38	33	26,895		クラレ	38	33	40,161	
長谷工コーポレーション	7.6	6.6	9,094		旭化成	38	33	38,989	
鹿島建設	19	16.5	23,908		昭和電工	3.8	3.3	8,870	
大和ハウス工業	38	33	109,659		住友化学	38	33	17,061	
積水ハウス	38	33	70,092		日産化学	38	33	198,660	
日揮ホールディングス	38	33	45,771		東ソー	19	16.5	33,033	
食料品 (3.3%)					トクヤマ	7.6	6.6	17,622	
日清製粉グループ本社	38	33	58,641		デンカ	7.6	6.6	27,984	
明治ホールディングス	7.6	6.6	46,794		信越化学工業	38	33	618,750	
日本ハム	19	16.5	77,467		三井化学	7.6	6.6	21,813	
サッポロホールディングス	7.6	6.6	14,764		三菱ケミカルホールディングス	19	16.5	12,200	
アサヒグループホールディングス	38	33	155,199		宇部興産	3.8	3.3	6,956	
麒麟ホールディングス	38	33	71,115		日本化薬	38	—	—	
宝ホールディングス	38	33	52,371		花王	38	33	244,200	
キッコーマン	38	33	250,470		D I C	3.8	3.3	9,150	
味の素	38	33	76,081		富士フイルムホールディングス	38	33	207,933	
ニチレイ	19	16.5	46,843		資生堂	38	33	271,359	
日本たばこ産業	38	33	64,647		日東電工	38	33	317,790	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
医薬品 (7.3%)			
協和キリン	38	33	108,075
武田薬品工業	38	33	122,529
アステラス製薬	190	165	293,782
大日本住友製薬	38	33	56,826
塩野義製薬	38	33	199,551
中外製薬	38	99	519,552
エーザイ	38	33	254,595
第一三共	38	99	326,898
大塚ホールディングス	38	33	148,665
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	15.2	13.2	37,831
E N E O Sホールディングス	38	33	15,582
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	19	16.5	29,997
ブリヂストン	38	33	140,943
ガラス・土石製品 (1.1%)			
A G C	7.6	6.6	24,816
日本板硝子	3.8	3.3	1,890
日本電気硝子	11.4	9.9	24,383
住友大阪セメント	3.8	3.3	11,731
太平洋セメント	3.8	3.3	8,550
東海カーボン	38	33	50,061
T O T O	19	16.5	115,995
日本碍子	38	33	63,756
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3.8	3.3	5,233
神戸製鋼所	3.8	3.3	2,187
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.8	3.3	3,768
大平洋金属	3.8	3.3	7,966
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	38	3.3	7,088
三井金属鉱業	3.8	3.3	12,903
東邦亜鉛	3.8	3.3	8,111
三菱マテリアル	3.8	3.3	8,481
住友金属鉱山	19	16.5	89,116
D O W Aホールディングス	7.6	6.6	27,357
古河電気工業	3.8	3.3	9,797
住友電気工業	38	33	52,552
フジクラ	38	33	17,325
金属製品 (0.2%)			
S U M C O	3.8	3.3	8,385
東洋製鐵グループホールディングス	38	33	44,121

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (4.8%)			
日本製鋼所	7.6	6.6	19,456
オークマ	7.6	6.6	41,580
アマダ	38	33	42,768
小松製作所	38	33	108,273
住友重機械工業	7.6	6.6	19,899
日立建機	38	33	110,715
クボタ	38	33	80,041
荏原製作所	7.6	6.6	27,060
ダイキン工業	38	33	767,250
日本精工	38	33	34,386
N T N	38	33	10,758
ジェイテクト	38	33	39,633
日立造船	7.6	6.6	4,395
三菱重工業	3.8	3.3	10,474
I H I	3.8	3.3	6,834
電気機器 (22.0%)			
日清紡ホールディングス	38	33	27,324
コニカミノルタ	38	33	19,800
ミネベアミツミ	38	33	88,605
日立製作所	7.6	6.6	32,821
三菱電機	38	33	55,819
富士電機	7.6	6.6	30,591
安川電機	38	33	192,720
オムロン	38	33	316,470
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.6	6.6	23,100
日本電気	3.8	3.3	20,988
富士通	3.8	3.3	52,173
沖電気工業	3.8	3.3	3,514
セイコーエプソン	76	66	119,064
パナソニック	38	33	49,434
シャープ	—	33	77,088
ソニー	38	33	402,600
T D K	38	33	533,940
アルプスアルパイン	38	33	48,741
横河電機	38	33	75,405
アドバンテスト	76	66	628,980
カシオ計算機	38	33	65,241
ファナック	38	33	957,000
京セラ	76	66	468,996
太陽誘電	38	33	187,440
S C R E E Nホールディングス	7.6	6.6	61,446
キヤノン	57	49.5	118,008

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
リコー	38	33	31,977	
東京エレクトロン	38	33	1,423,620	
輸送用機器 (4.0%)				
デンソー	38	33	222,717	
三井E&Sホールディングス	3.8	3.3	1,547	
川崎重工業	3.8	3.3	8,098	
日産自動車	38	33	20,390	
いすゞ自動車	19	16.5	19,305	
トヨタ自動車	38	33	272,151	
日野自動車	38	33	35,244	
三菱自動車工業	3.8	3.3	1,039	
マツダ	7.6	6.6	6,098	
本田技研工業	76	66	203,808	
スズキ	38	33	171,270	
SUBARU	38	33	68,953	
ヤマハ発動機	38	33	80,025	
精密機器 (3.4%)				
テルモ	152	132	596,112	
ニコン	38	33	30,954	
オリンパス	152	132	305,580	
シチズン時計	38	33	13,068	
その他製品 (2.0%)				
バンダイナムコホールディングス	38	33	297,891	
凸版印刷	19	16.5	27,390	
大日本印刷	19	16.5	32,092	
ヤマハ	38	33	195,360	
電気・ガス業 (0.1%)				
東京電力ホールディングス	3.8	3.3	1,240	
中部電力	3.8	3.3	4,370	
関西電力	3.8	3.3	3,547	
東京瓦斯	7.6	6.6	14,836	
大阪瓦斯	7.6	6.6	12,975	
陸運業 (1.6%)				
東武鉄道	7.6	6.6	20,955	
東急	19	16.5	24,420	
小田急電鉄	19	16.5	56,760	
京王電鉄	7.6	6.6	57,486	
京成電鉄	19	16.5	64,350	
東日本旅客鉄道	3.8	3.3	25,443	
西日本旅客鉄道	3.8	3.3	21,120	
東海旅客鉄道	3.8	3.3	58,492	
日本通運	3.8	3.3	25,971	
ヤマトホールディングス	38	33	94,512	

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
海運業 (0.1%)				
日本郵船	3.8	3.3	9,553	
商船三井	3.8	3.3	10,461	
川崎汽船	3.8	3.3	6,619	
空運業 (0.0%)				
ANAホールディングス	3.8	3.3	8,246	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	19	16.5	55,275	
情報・通信業 (13.7%)				
ネクソン	—	66	231,990	
Zホールディングス	15.2	13.2	8,735	
トレンドマイクロ	38	33	201,630	
スカパーJ S A Tホールディングス	3.8	3.3	1,524	
日本電信電話	15.2	13.2	38,049	
KDD I	228	198	664,884	
ソフトバンク	—	33	48,279	
NTTドコモ	3.8	—	—	
東宝	3.8	3.3	13,942	
エヌ・ティ・ティ・データ	190	165	275,055	
コナミホールディングス	38	33	245,850	
ソフトバンクグループ	228	198	2,060,190	
卸売業 (1.9%)				
双日	3.8	3.3	933	
伊藤忠商事	38	33	105,831	
丸紅	38	33	26,076	
豊田通商	38	33	158,730	
三井物産	38	33	72,105	
住友商事	38	33	51,282	
三菱商事	38	33	98,472	
小売業 (13.6%)				
J. フロント リテイリング	19	16.5	17,127	
三越伊勢丹ホールディングス	38	33	24,981	
セブン&アイ・ホールディングス	38	33	140,547	
ファミリーマート	152	—	—	
高島屋	19	16.5	17,770	
丸井グループ	38	33	68,607	
イオン	38	33	119,592	
ファーストリテイリング	38	33	3,387,450	
銀行業 (0.5%)				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	38	33	14,058	
新生銀行	3.8	3.3	4,834	
あおぞら銀行	3.8	3.3	7,708	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	38	33	18,681	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
りそなホールディングス	3.8	3.3	1,477
三井住友トラスト・ホールディングス	3.8	3.3	11,866
三井住友フィナンシャルグループ	3.8	3.3	12,592
千葉銀行	38	33	22,704
ふくおかフィナンシャルグループ	7.6	6.6	13,681
静岡銀行	38	33	26,796
みずほフィナンシャルグループ	38	3.3	5,299
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	38	33	18,140
野村ホールディングス	38	33	21,489
松井証券	38	33	30,690
保険業 (0.6%)			
SOMPOホールディングス	9.5	8.3	35,714
MS&ADインシュアランスグループホール	11.4	9.9	31,343
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.6	—	—
第一生命ホールディングス	3.8	3.3	6,352
東京海上ホールディングス	19	16.5	90,948
T&Dホールディングス	7.6	6.6	9,682
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	38	33	45,672
日本取引所グループ	—	33	81,345

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	38	33	22,638	
三井不動産	38	33	80,899	
三菱地所	38	33	61,479	
東京建物	19	16.5	26,136	
住友不動産	38	33	119,592	
サービス業 (6.5%)				
エムスリー	91.2	79.2	700,920	
ディー・エヌ・エー	11.4	9.9	21,225	
電通グループ	38	33	123,915	
サイバーエージェント	7.6	6.6	45,408	
楽天	38	33	37,422	
リクルートホールディングス	114	99	525,195	
日本郵政	38	33	30,211	
セコム	38	33	328,812	
合 計	株 数 ・ 金 額	6,822	5,987	27,759,279
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 97.7% >

*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 638	百万円 —
	日経225		

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年2月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 27,759,279	% 96.0
コール・ローン等、その他	1,149,335	4.0
投資信託財産総額	28,908,614	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2月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	28,908,614,788
コール・ローン等	1,069,326,393
株式(評価額)	27,759,279,890
未収入金	29,576,605
未収配当金	35,371,900
差入委託証拠金	15,060,000
(B) 負債	496,066,493
未払収益分配金	283,295,970
未払解約金	121,516,163
未払信託報酬	90,814,076
未払利息	925
その他未払費用	439,359
(C) 純資産総額(A-B)	28,412,548,295
元本	25,754,179,092
次期繰越損益金	2,658,369,203
(D) 受益権総口数	25,754,179,092口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,032円

(注) 期首元本額は29,720,547,869円、期中追加設定元本額は12,968,450,044円、期中一部解約元本額は16,934,818,821円、1口当たり純資産額は1.1032円です。

○損益の状況 (2020年2月18日～2021年2月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	359,698,178
受取配当金	359,907,325
受取利息	37
その他収益金	12,208
支払利息	△ 221,392
(B) 有価証券売買損益	6,839,978,704
売買益	8,437,922,744
売買損	△ 1,597,944,040
(C) 先物取引等取引損益	163,646,655
取引益	491,683,807
取引損	△ 328,037,152
(D) 信託報酬等	△ 178,400,842
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	7,184,922,695
(F) 前期繰越損益金	2,391,504,945
(G) 追加信託差損益金	△ 6,634,762,467
(配当等相当額)	(22,243,737,779)
(売買損益相当額)	(△28,878,500,246)
(H) 計(E+F+G)	2,941,665,173
(I) 収益分配金	△ 283,295,970
次期繰越損益金(H+I)	2,658,369,203
追加信託差損益金	△ 6,634,762,467
(配当等相当額)	(22,243,737,779)
(売買損益相当額)	(△28,878,500,246)
分配準備積立金	9,293,131,670

* 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(2020年2月18日～2021年2月17日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年2月18日～ 2021年2月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	350,992,217円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	6,833,930,478円
c. 信託約款に定める収益調整金	22,243,737,779円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	2,391,504,945円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	31,820,165,419円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,355円
g. 分配金	283,295,970円
h. 分配金(1万口当たり)	110円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	110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。