

野村インデックスファンド・ 日経225

愛称：Funds-i 日経225

運用報告書(全体版)

第8期（決算日2018年9月6日）

作成対象期間（2017年9月7日～2018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	2010年11月26日以降、無期限とします。	
運用方針	ミリオン・インデックスマザーファンド（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、日経平均株価（日経225）と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・日経225	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	野村インデックス ファンド・日経225	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	基準価額 (分配落)	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税込分配金	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率			
4期(2014年9月8日)	円 16,419	円 0	% 14.5	円 15,705	% 13.3	% 98.5	% 1.5	百万円 7,252
5期(2015年9月7日)	18,887	0	15.0	17,860	13.7	96.2	3.8	21,030
6期(2016年9月6日)	18,311	0	△ 3.0	17,082	△ 4.4	97.4	2.5	30,309
7期(2017年9月6日)	21,057	0	15.0	19,358	13.3	97.8	2.1	31,056
8期(2018年9月6日)	24,811	0	17.8	22,488	16.2	96.8	3.2	31,593

*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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	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	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(期首) 2017年9月6日	円 21,057	% -	% -	円 19,358	% -	% 97.8	% 2.1
9月末	22,269	5.8		20,356	5.2	96.3	3.6
10月末	24,073	14.3		22,012	13.7	97.0	3.0
11月末	24,865	18.1		22,725	17.4	96.9	3.0
12月末	24,937	18.4		22,765	17.6	98.1	1.9
2018年1月末	25,297	20.1		23,098	19.3	97.9	2.0
2月末	24,167	14.8		22,068	14.0	97.9	2.1
3月末	23,662	12.4		21,454	10.8	97.0	3.0
4月末	24,779	17.7		22,468	16.1	98.3	1.7
5月末	24,478	16.2		22,202	14.7	97.5	2.5
6月末	24,619	16.9		22,305	15.2	97.6	2.3
7月末	24,883	18.2		22,554	16.5	96.9	3.0
8月末	25,230	19.8		22,865	18.1	98.7	1.3
(期末) 2018年9月6日	24,811	17.8		22,488	16.2	96.8	3.2

*騰落率は期首比です。

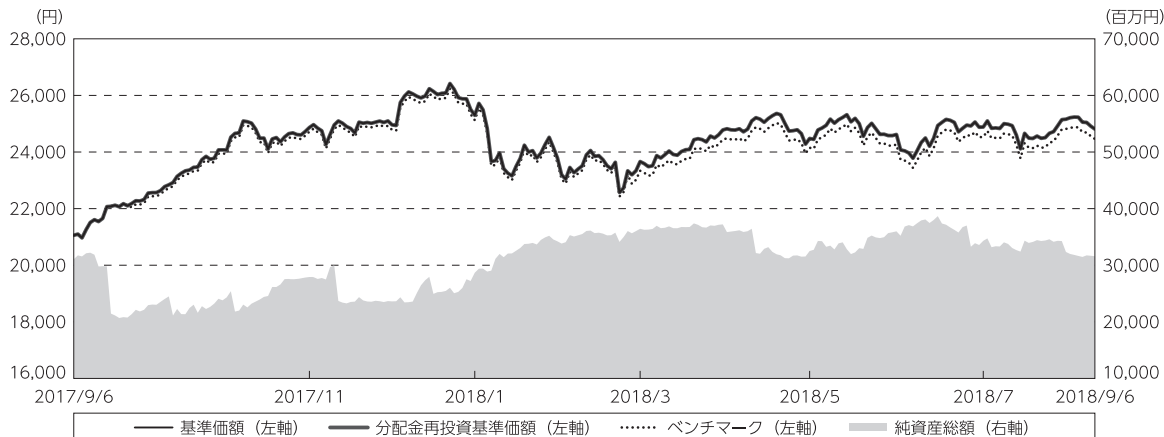
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日経平均株価（日経225）に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

◎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(2017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、日経平均株価(日経225)です。ベンチマークは、作成期首(2017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21,057円から期末24,811円に3,754円の値上がりとなりました。

衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などから上昇しました。

○投資環境

株式市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）において保有資産縮小が決定されたことなどから米国金利が上昇し外国為替市場で円安が進んだこと、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国の長期金利の上昇などから米国株式市場が下落したこと、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などの懸念などから下落しました。

3月下旬以降は、米中貿易摩擦懸念が薄れたことや、円高ドル安が一服したことなどから上昇しましたが、5月下旬以降は、米国の保護主義強化への警戒感が再度高まったことなどから下落しました。

○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・日経225]

主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド」受益証券に、期を通じてほぼ全額を投資しました。

[ミリオン・インデックスマザーファンド]

・株式組入比率

実質の株式組入比率（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

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や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更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+17.8%となり、ベンチマークである日経平均株価の+16.2%を1.6ポイント上回りました。

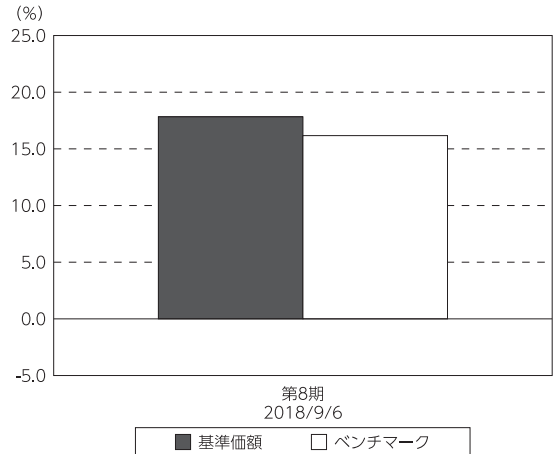
(プラス要因)

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、日経平均株価（日経225）です。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案し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8期
	2017年9月7日～ 2018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	14,811

(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・日経225]

主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド」受益証券を高位に組入れ、引き続き、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指します。

[ミリオン・インデックスマザーファンド]

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、日経平均株価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

(2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	106	0.432	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(49)	(0.200)	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 ）	(49)	(0.200)	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 ）	(8)	(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	0.006	(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)	(0.006)	
(c) そ の 他 費 用	1	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 ）	(1)	(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	108	0.441	
期中の平均基準価額は、24,438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

(2017年9月7日～2018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
ミリオン・インデックスマザーファンド	44,940,533 千口	59,508,575 千円	48,757,286 千口	63,967,008 千円

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年9月7日～2018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
	ミリオン・インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	99,383,700千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	57,193,536千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.73

*(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

(2017年9月7日～2018年9月6日)

利害関係人との取引状況

<野村インデックスファンド・日経225>

該当事項はございません。

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

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 48,677	百万円 209	% 0.4	百万円 50,705	百万円 -	% -

平均保有割合 52.4%

※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

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 50	百万円 53	百万円 50

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)	1,799千円
うち利害関係人への支払額 (B)	14千円
(B) / (A)	0.8%

*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。

○組入資産の明細

(2018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
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 27,182,499	千口 23,365,746	千円 31,590,488

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ミリオン・インデックスマザーファンド	千円 31,590,488	% 99.5
コール・ローン等、その他	148,549	0.5
投資信託財産総額	31,739,037	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 (2018年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	31,739,037,319
コール・ローン等	148,548,321
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	31,590,488,998
(B) 負債	145,378,915
未払解約金	68,858,018
未払信託報酬	75,951,100
未払利息	230
その他未払費用	569,567
(C) 純資産総額(A-B)	31,593,658,404
元本	12,733,638,567
次期繰越損益金	18,860,019,837
(D) 受益権総口数	12,733,638,567口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,811円

(注) 期首元本額は14,748,787,505円、期中追加設定元本額は34,907,838,208円、期中一部解約元本額は36,922,987,146円、1口当たり純資産額は2.4811円です。

○損益の状況 (2017年9月7日～2018年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 51,738
受取利息	42
支払利息	△ 51,780
(B) 有価証券売買損益	633,478,759
売買益	2,325,974,526
売買損	△ 1,692,495,767
(C) 信託報酬等	△ 133,383,417
(D) 当期損益金(A+B+C)	500,043,604
(E) 前期繰越損益金	△ 860,475
(F) 追加信託差損益金	18,360,836,708
(配当等相当額)	(2,339,050,818)
(売買損益相当額)	(16,021,785,890)
(G) 計(D+E+F)	18,860,019,837
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	18,860,019,837
追加信託差損益金	18,360,836,708
(配当等相当額)	(2,429,601,192)
(売買損益相当額)	(15,931,235,516)
分配準備積立金	499,183,129

*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(2017年9月7日～2018年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2017年9月7日～ 2018年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	425,656,392円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	57,186,108円
c. 信託約款に定める収益調整金	18,360,836,708円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	16,340,629円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	18,860,019,837円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	14,811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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2018年9月6日現在）

<ミリオン・インデックスマザーファンド>

下記は、ミリオン・インデックスマザーファンド全体(45,393,327千口)の内容です。

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 (0.2%)				
日本水産	104	98	61,838	
マルハニチロ	10.4	9.8	36,995	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	41.6	39.2	47,843	
建設業 (2.5%)				
コムシスホールディングス	104	98	294,490	
大成建設	104	19.6	98,392	
大林組	104	98	101,626	
清水建設	104	98	92,610	
長谷工コーポレーション	20.8	19.6	27,518	
鹿島建設	104	98	76,734	
大和ハウス工業	104	98	319,088	
積水ハウス	104	98	170,177	
日揮	104	98	214,522	
千代田化工建設	104	98	76,146	
食料品 (4.4%)				
日清製粉グループ本社	104	98	212,954	
明治ホールディングス	20.8	19.6	142,884	
日本ハム	104	49	195,020	
サッポロホールディングス	20.8	19.6	44,178	
アサヒグループホールディングス	104	98	470,302	
キリンホールディングス	104	98	264,600	
宝ホールディングス	104	98	126,910	
キッコーマン	104	98	558,600	
味の素	104	98	179,830	
ニチレイ	52	49	132,349	
日本たばこ産業	104	98	283,122	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	104	9.8	19,100	
ユニチカ	104	9.8	6,409	
帝人	20.8	19.6	41,434	
東レ	104	98	79,703	
パルプ・紙 (0.2%)				
王子ホールディングス	104	98	74,382	
日本製紙	10.4	9.8	19,237	

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
北越コーポレーション	104	—	—	
化学 (8.8%)				
クラレ	104	98	152,194	
旭化成	104	98	154,105	
昭和電工	10.4	9.8	50,568	
住友化学	104	98	59,388	
日産化学	104	98	513,520	
東ソー	104	49	81,291	
トクヤマ	104	19.6	63,406	
デンカ	104	19.6	70,658	
信越化学工業	104	98	979,902	
三井化学	104	19.6	53,782	
三菱ケミカルホールディングス	52	49	47,348	
宇部興産	104	9.8	26,538	
日本化薬	104	98	124,460	
花王	104	98	844,760	
富士フィルムホールディングス	104	98	447,468	
資生堂	104	98	742,056	
日東電工	104	98	813,302	
医薬品 (8.2%)				
協和発酵キリン	104	98	192,276	
武田薬品工業	104	98	439,824	
アステラス製薬	520	490	891,800	
大日本住友製薬	104	98	206,584	
塩野義製薬	104	98	629,160	
中外製薬	104	98	638,960	
エーザイ	104	98	966,868	
第一三共	104	98	416,598	
大塚ホールディングス	104	98	510,678	
石油・石炭製品 (0.5%)				
昭和シェル石油	104	98	214,424	
J X T Gホールディングス	104	98	72,186	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	52	49	110,936	
ブリヂストン	104	98	389,158	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.5%)			
AGC	20.8	19.6	86,338
日本板硝子	10.4	9.8	10,966
日本電気硝子	31.2	29.4	101,577
住友大阪セメント	104	98	46,354
太平洋セメント	104	9.8	32,830
東海カーボン	104	98	195,412
TOTO	52	49	225,400
日本碍子	104	98	171,402
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	10.4	9.8	21,025
神戸製鋼所	10.4	9.8	8,810
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.4	9.8	23,142
日新製鋼	10.4	9.8	14,670
大太平洋金属	104	9.8	34,202
非鉄金属 (1.1%)			
日本軽金属ホールディングス	104	98	23,324
三井金属鉱業	104	9.8	29,547
東邦亜鉛	104	9.8	36,652
三菱マテリアル	10.4	9.8	29,292
住友金属鉱山	104	49	174,342
DOWAホールディングス	104	19.6	63,700
古河機械金属	104	9.8	15,072
古河電気工業	10.4	9.8	35,966
住友電気工業	104	98	164,493
フジクラ	104	98	59,976
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	10.4	9.8	17,698
東洋製罐グループホールディングス	104	98	202,664
機械 (5.0%)			
日本製鋼所	20.8	19.6	52,410
オークマ	104	19.6	119,952
アマダホールディングス	104	98	112,798
小松製作所	104	98	300,958
住友重機械工業	104	19.6	70,560
日立建機	104	98	316,050
クボタ	104	98	165,669
荏原製作所	20.8	19.6	72,226
ダイキン工業	104	98	1,355,830
日本精工	104	98	120,442
NTN	104	98	42,434
ジェイテクト	104	98	146,804
日立造船	20.8	19.6	8,663

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱重工業	104	9.8	39,513
IHI	104	9.8	39,200
電気機器 (18.6%)			
日清紡ホールディングス	104	98	120,834
コニカミノルタ	104	98	103,978
ミネベアミツミ	104	98	201,096
日立製作所	104	98	68,982
三菱電機	104	98	143,129
富士電機	104	98	86,436
安川電機	104	98	336,630
明電舎	104	—	—
ジーエス・ユアサ コーポレーション	104	98	51,156
日本電気	104	9.8	29,743
富士通	104	98	77,224
沖電気工業	10.4	9.8	13,514
セイコーエプソン	208	196	359,268
パナソニック	104	98	126,763
ソニー	104	98	616,224
TDK	104	98	1,214,220
アルプス電気	104	98	324,870
パイオニア	104	98	12,250
横河電機	104	98	218,638
アドバンテスト	208	196	516,460
カシオ計算機	104	98	175,028
ファナック	104	98	2,073,190
京セラ	208	196	1,313,984
太陽誘電	104	98	315,070
SCREENホールディングス	20.8	19.6	155,036
キャノン	156	147	504,504
リコー	104	98	111,230
東京エレクトロン	104	98	1,762,530
輸送用機器 (5.8%)			
デンソー	104	98	510,874
三井E&Sホールディングス	104	9.8	17,591
川崎重工業	104	9.8	29,086
日産自動車	104	98	100,695
いすゞ自動車	52	49	77,273
トヨタ自動車	104	98	653,366
日野自動車	104	98	110,152
三菱自動車工業	10.4	9.8	7,418
マツダ	20.8	19.6	24,441
本田技研工業	208	196	623,868
スズキ	104	98	708,050

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SUBARU	104	98	310,268
ヤマハ発動機	104	98	270,186
精密機器 (3.2%)			
テルモ	208	196	1,207,360
ニコン	104	98	197,764
オリンパス	104	98	424,830
シチズン時計	104	98	69,776
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	104	98	83,398
大日本印刷	104	49	122,059
ヤマハ	104	98	527,240
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	10.4	9.8	4,782
中部電力	10.4	9.8	15,351
関西電力	10.4	9.8	15,234
東京瓦斯	104	19.6	50,626
大阪瓦斯	104	19.6	39,856
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	104	19.6	60,466
東京急行電鉄	52	49	89,621
小田急電鉄	52	49	120,246
京王電鉄	104	19.6	107,996
京成電鉄	52	49	180,320
東日本旅客鉄道	10.4	9.8	97,519
西日本旅客鉄道	10.4	9.8	71,628
東海旅客鉄道	10.4	9.8	212,709
日本通運	104	9.8	67,522
ヤマトホールディングス	104	98	313,208
海運業 (0.1%)			
日本郵船	104	9.8	19,756
商船三井	104	9.8	28,331
川崎汽船	104	9.8	20,413
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	104	9.8	36,554
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	104	49	128,429
情報・通信業 (11.1%)			
ヤフー	41.6	39.2	14,347
トレンドマイクロ	104	98	688,940
スカパーJ SATホールディングス	10.4	9.8	5,135
日本電信電話	20.8	19.6	92,551
KDDI	624	588	1,694,028
NTTドコモ	10.4	9.8	27,660

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東宝	10.4	9.8	32,144
エヌ・ティ・ティ・データ	520	490	691,390
コナミホールディングス	104	98	433,650
ソフトバンクグループ	312	294	2,941,470
卸売業 (2.2%)			
双日	10.4	9.8	3,753
伊藤忠商事	104	98	190,463
丸紅	104	98	88,552
豊田通商	104	98	363,580
三井物産	104	98	175,959
住友商事	104	98	173,313
三菱商事	104	98	303,310
小売業 (12.6%)			
J. フロント リテイリング	52	49	76,636
三越伊勢丹ホールディングス	104	98	121,716
セブン&アイ・ホールディングス	104	98	441,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	104	98	956,480
高島屋	104	49	87,955
丸井グループ	104	98	238,630
イオン	104	98	231,280
ファーストリテイリング	104	98	5,319,440
銀行業 (0.8%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	104	98	50,176
新生銀行	104	9.8	16,346
あおぞら銀行	104	9.8	37,730
三菱UFJフィナンシャル・グループ	104	98	65,689
りそなホールディングス	10.4	9.8	5,915
三井住友トラスト・ホールディングス	10.4	9.8	42,492
三井住友フィナンシャルグループ	10.4	9.8	42,424
千葉銀行	104	98	67,228
ふくおかフィナンシャルグループ	104	98	58,702
静岡銀行	104	98	91,728
みずほフィナンシャルグループ	104	98	18,904
証券・商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	104	98	64,366
野村ホールディングス	104	98	50,029
松井証券	104	98	113,190
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	26	24.4	108,580
MS&ADインシュアランスグループホール	31.2	29.4	94,903
ソニーフィナンシャルホールディングス	20.8	19.6	42,120
第一生命ホールディングス	10.4	9.8	19,923
東京海上ホールディングス	52	49	249,655

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T&Dホールディングス	20.8	19.6	31,732
その他金融業 (0.3%)			
クレディセゾン	104	98	169,442
不動産業 (1.5%)			
東急不動産ホールディングス	104	98	71,148
三井不動産	104	98	239,806
三菱地所	104	98	174,930
東京建物	52	49	63,945
住友不動産	104	98	367,304
サービス業 (4.5%)			
ディー・エヌ・エー	31.2	29.4	55,213
電通	104	98	494,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
楽天	104	98	78,694
リクルートホールディングス	—	294	1,002,540
日本郵政	—	98	128,478
東京ドーム	52	49	47,922
セコム	104	98	883,078
合 計	株数・金額	20,878	16,949
	銘柄数<比率>	225	225
			59,392,441
			<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、このファンドが組み入れているマザーファンドの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	1,955	—

*単位未満は切り捨て。

ミリオン・インデックス マザーファンド

運用報告書

第30期（決算日2017年11月7日）

作成対象期間（2016年11月8日～2017年11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	わが国の株式市場全体の長期的成長をとらえることを目標に、日経平均株価と連動する投資成果を目指して運用を行います。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行います。資金の流出入に伴う売買に当たっては、原則として買付の場合は高株価の銘柄から順に、売却の場合は低株価の銘柄から順に行います。株式の組入比率は高位を保ちます。
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。

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/>

○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	日経平均株価	騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
26期(2013年11月7日)	7,892	61.3	14,228	58.6	98.0	2.0	28,491
27期(2014年11月7日)	9,508	20.5	16,880	18.6	96.2	3.8	34,867
28期(2015年11月9日)	11,242	18.2	19,643	16.4	97.3	2.6	50,424
29期(2016年11月7日)	10,018	△10.9	17,177	△12.6	97.3	2.7	54,313
30期(2017年11月7日)	13,626	36.0	22,938	33.5	96.7	3.3	49,871

*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		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	日経平均株価	騰落率		
(期首) 2016年11月7日	円	%	円	%	%	%
	10,018	-	17,177	-	97.3	2.7
11月末	10,676	6.6	18,308	6.6	97.3	2.7
12月末	11,160	11.4	19,114	11.3	97.5	2.5
2017年1月末	11,118	11.0	19,041	10.9	98.2	1.8
2月末	11,172	11.5	19,119	11.3	96.3	3.7
3月末	11,131	11.1	18,909	10.1	97.0	3.0
4月末	11,302	12.8	19,197	11.8	97.7	2.2
5月末	11,575	15.5	19,651	14.4	96.8	3.2
6月末	11,815	17.9	20,033	16.6	97.9	2.0
7月末	11,752	17.3	19,925	16.0	95.7	4.3
8月末	11,595	15.7	19,646	14.4	98.2	1.8
9月末	12,085	20.6	20,356	18.5	96.3	3.6
10月末	13,069	30.5	22,012	28.1	97.0	3.0
(期末) 2017年11月7日	13,626	36.0	22,938	33.5	96.7	3.3

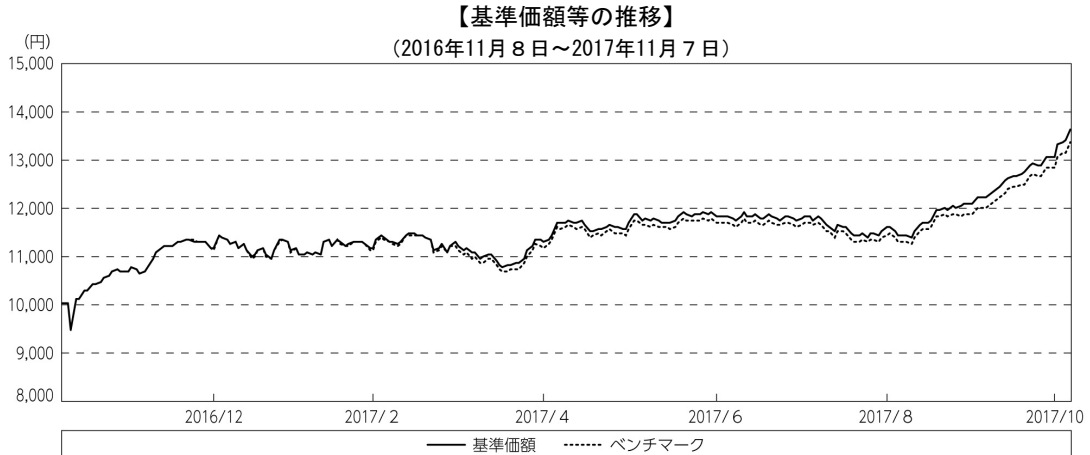
*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「日経平均」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」自体及び「日経平均」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」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「ミリオン・インデックスマザーファンド」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「ミリオン・インデックスマザーファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」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」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」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) ベンチマークは、日経平均株価です。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10,018円から期末13,626円に3,608円の値上がりとなりました。

外国為替市場で円安が進んだことや、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったこと、国内企業の好決算などを背景に、基準価額は上昇しました。

○投資環境

株式市場は、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受けて、上昇しました。

2017年に入り、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。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。

9月以降は、外国為替市場で円安が進んだことや、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったこと、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質の株式組入比率（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

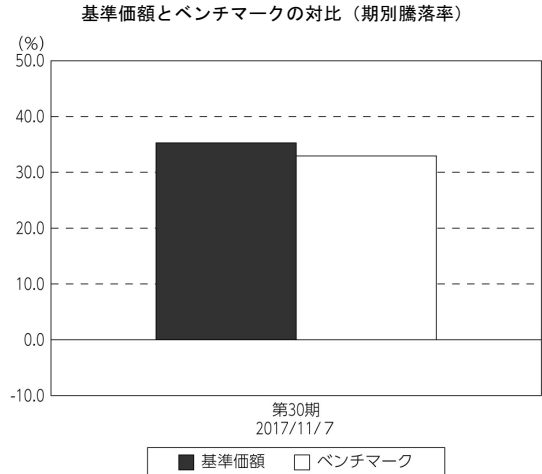
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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+36.0%となり、ベンチマークである日経平均株価の+33.5%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、日経平均株価です。

◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、日経平均株価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11月8日～2017年11月7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 1 (0) (1)	% 0.007 (0.000) (0.007)	(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	1	0.007	
期中の平均基準価額は、11,537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11月8日～2017年11月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 14,636 (△ 2,183)	千円 39,460,079 ()	千株 22,278	千円 59,103,852

*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 70,055	百万円 70,465	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

(2016年11月8日～2017年11月7日)

○株式売買比率

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	98,563,932千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,194,019千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.04

* (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11月8日～2017年11月7日)

利害関係人との取引状況

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 39,460	百万円 755	% 1.9	百万円 59,103	百万円 21	% 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 48	百万円 76	百万円 52

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)	3,631千円
うち利害関係人への支払額 (B)	152千円
(B) / (A)	4.2%

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。

(2017年11月7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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)				
日本水産	118	78	50,310	
マルハニチロ	11.8	7.8	25,116	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	47.2	31.2	41,168	
建設業 (2.9%)				
コムシスホールディングス	118	78	235,170	
大成建設	118	15.6	103,116	
大林組	118	78	121,758	
清水建設	118	78	108,342	
長谷工コーポレーション	23.6	15.6	26,270	
鹿島建設	118	78	98,280	
大和ハウス工業	118	78	333,372	
積水ハウス	118	78	169,923	
日揮	118	78	158,496	
千代田化工建設	118	78	58,110	
食料品 (4.6%)				
日清製粉グループ本社	118	78	162,630	
明治ホールディングス	23.6	15.6	146,484	
日本ハム	118	78	226,278	
サッポロホールディングス	23.6	15.6	53,196	
アサヒグループホールディングス	118	78	415,740	
キリンホールディングス	118	78	207,051	
宝ホールディングス	118	78	89,154	
キッコーマン	118	78	316,290	
味の素	118	78	180,063	
ニチレイ	59	39	119,925	
日本たばこ産業	118	78	299,520	
繊維製品 (0.3%)				
東洋紡	118	7.8	17,175	
ユニチカ	118	7.8	7,792	
帝人	23.6	15.6	38,594	
東レ	118	78	92,664	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	118	78	52,884	

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
日本製紙	11.8	7.8	18,345	
北越紀州製紙	118	—	—	
化学 (9.1%)				
クラレ	118	78	183,612	
旭化成	118	78	109,785	
昭和電工	11.8	7.8	30,732	
住友化学	118	78	64,038	
日産化学工業	118	78	350,610	
東ソー	118	39	100,035	
トクヤマ	118	15.6	54,210	
デンカ	118	15.6	60,762	
信越化学工業	118	78	975,780	
三井化学	118	15.6	53,352	
三菱ケミカルホールディングス	59	39	47,326	
宇部興産	118	7.8	26,325	
日本化薬	118	78	141,414	
花王	118	78	547,794	
富士フイルムホールディングス	118	78	360,672	
資生堂	118	78	368,238	
日東電工	118	78	911,430	
医薬品 (7.1%)				
協和発酵キリン	118	78	171,132	
武田薬品工業	118	78	501,774	
アステラス製薬	590	390	589,680	
大日本住友製薬	118	78	131,118	
塩野義製薬	118	78	488,592	
中外製薬	118	78	439,140	
エーザイ	118	78	507,936	
第一三共	118	78	210,951	
大塚ホールディングス	—	78	376,428	
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	118	78	112,320	
J X T Gホールディングス	118	78	49,186	
ゴム製品 (1.1%)				
横浜ゴム	59	39	100,659	

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	118	78	436,098
ガラス・土石製品 (1.6%)			
旭硝子	118	15.6	75,582
日本板硝子	11.8	7.8	8,073
日本電気硝子	177	23.4	110,799
住友大阪セメント	118	78	38,610
太平洋セメント	118	7.8	35,841
東海カーボン	118	78	94,068
TOTO	59	39	224,640
日本碍子	118	78	170,586
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	11.8	7.8	20,962
神戸製鋼所	11.8	7.8	8,439
ジェイ エフ イー ホールディングス	11.8	7.8	20,229
日新製鋼	11.8	7.8	12,893
大太平洋金属	118	7.8	25,974
非鉄金属 (1.5%)			
日本軽金属ホールディングス	118	78	25,662
三井金属鉱業	118	7.8	47,424
東邦亜鉛	118	7.8	47,268
三菱マテリアル	11.8	7.8	34,944
住友金属鉱山	118	39	190,710
DOWAホールディングス	118	15.6	77,454
古河機械金属	118	7.8	16,551
古河電気工業	11.8	7.8	46,878
住友電気工業	118	78	150,891
フジクラ	118	78	77,688
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	11.8	7.8	20,178
東洋製罐グループホールディングス	118	78	151,554
機械 (5.5%)			
日本製鋼所	23.6	15.6	52,728
オークマ	118	15.6	112,788
アマダホールディングス	118	78	113,568
小松製作所	118	78	298,896
住友重機械工業	118	15.6	79,560
日立建機	118	78	315,900
クボタ	118	78	169,728
荏原製作所	23.6	15.6	67,080
ダイキン工業	118	78	1,031,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	118	78	131,898
NTN	118	78	44,148
ジェイテクト	118	78	159,510
日立造船	23.6	15.6	9,781
三菱重工業	118	7.8	34,702
IHI	118	7.8	28,821
電気機器 (20.7%)			
日清紡ホールディングス	118	78	108,108
コニカミノルタ	118	78	84,630
ミネベアミツミ	118	78	169,806
日立製作所	118	78	70,184
東芝	118	—	—
三菱電機	118	78	151,047
富士電機	118	78	66,612
安川電機	118	78	335,790
明電舎	118	—	—
ジーエス・ユアサ コーポレーション	118	78	45,240
日本電気	118	7.8	23,595
富士通	118	78	67,321
沖電気工業	11.8	7.8	12,394
セイコーエプソン	—	156	425,724
パナソニック	118	78	134,901
ソニー	118	78	410,358
TDK	118	78	710,580
ミツミ電機	118	—	—
アルプス電気	118	78	288,990
パイオニア	118	78	17,940
横河電機	118	78	169,104
アドバンテスト	236	156	406,068
カシオ計算機	118	78	132,210
ファナック	118	78	2,197,260
京セラ	236	156	1,270,464
太陽誘電	118	78	157,248
SCREENホールディングス	23.6	15.6	170,820
キヤノン	177	117	509,652
リコー	118	78	79,794
東京エレクトロン	118	78	1,754,220
輸送用機器 (6.4%)			
デンソー	118	78	504,972
三井造船	118	7.8	12,573

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
川崎重工業	118	7.8	31,044	
日産自動車	118	78	86,658	
いすゞ自動車	59	39	69,088	
トヨタ自動車	118	78	560,274	
日野自動車	118	78	108,186	
三菱自動車工業	11.8	7.8	7,059	
マツダ	23.6	15.6	24,733	
本田技研工業	236	156	598,572	
スズキ	118	78	492,960	
S U B A R U	118	78	294,684	
ヤマハ発動機	118	78	276,120	
精密機器 (2.8%)				
テルモ	236	156	760,500	
ニコン	118	78	174,798	
オリンパス	118	78	340,860	
シチズン時計	118	78	66,144	
その他製品 (1.1%)				
凸版印刷	118	78	91,728	
大日本印刷	118	39	111,111	
ヤマハ	118	78	322,140	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	11.8	7.8	3,689	
中部電力	11.8	7.8	11,766	
関西電力	11.8	7.8	12,148	
東京瓦斯	118	15.6	43,680	
大阪瓦斯	118	15.6	34,795	
陸運業 (2.0%)				
東武鉄道	118	15.6	53,664	
東京急行電鉄	118	39	68,913	
小田急電鉄	59	39	90,051	
京王電鉄	118	15.6	77,922	
京成電鉄	59	39	132,600	
東日本旅客鉄道	11.8	7.8	87,711	
西日本旅客鉄道	11.8	7.8	65,067	
東海旅客鉄道	11.8	7.8	163,878	
日本通運	118	7.8	54,522	
ヤマトホールディングス	118	78	179,322	
海運業 (0.1%)				
日本郵船	118	7.8	21,606	
商船三井	118	7.8	29,211	

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
川崎汽船	118	7.8	23,306	
空運業 (0.1%)				
A N Aホールディングス	118	7.8	34,647	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	118	39	120,120	
情報・通信業 (11.4%)				
ヤフー	47.2	31.2	15,849	
トレンドマイクロ	118	78	479,700	
スカパー J S A Tホールディングス	11.8	7.8	4,056	
日本電信電話	23.6	15.6	89,700	
K D D I	708	468	1,470,456	
N T T ドコモ	11.8	7.8	21,894	
東宝	11.8	7.8	29,289	
エヌ・ティ・ティ・データ	118	390	529,620	
コナミホールディングス	118	78	484,380	
ソフトバンクグループ	354	234	2,354,040	
卸売業 (2.2%)				
双日	11.8	7.8	2,620	
伊藤忠商事	118	78	157,404	
丸紅	118	78	61,549	
豊田通商	118	78	338,910	
三井物産	118	78	135,876	
住友商事	118	78	137,358	
三菱商事	118	78	225,888	
小売業 (9.4%)				
J . フロント リテイリング	59	39	68,406	
三越伊勢丹ホールディングス	118	78	96,876	
セブン&アイ・ホールディングス	118	78	362,622	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	118	78	522,600	
高島屋	118	78	83,460	
丸井グループ	118	78	138,216	
イオン	118	78	137,748	
ファーストリテイリング	118	78	3,112,980	
銀行業 (0.9%)				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	118	78	46,488	
新生銀行	118	7.8	14,203	
あおぞら銀行	118	7.8	34,983	
三菱UF J フィナンシャル・グループ	118	78	59,865	
りそなホールディングス	11.8	7.8	4,814	
三井住友トラスト・ホールディングス	11.8	7.8	34,897	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友フィナンシャルグループ	11.8	7.8	35,451
千葉銀行	118	78	66,144
ふくおかフィナンシャルグループ	118	78	45,318
静岡銀行	118	78	85,566
みずほフィナンシャルグループ	118	78	16,091
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	118	78	56,877
野村ホールディングス	118	78	52,338
松井証券	118	78	77,844
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	29.5	19.5	89,836
MS&ADインシュアランスグループホール	35.4	23.4	89,809
ソニーフィナンシャルホールディングス	23.6	15.6	28,704
第一生命ホールディングス	11.8	7.8	16,875
東京海上ホールディングス	59	39	190,554
T&Dホールディングス	23.6	15.6	27,729
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	118	78	180,492

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 (1.7%)				
東急不動産ホールディングス	118	78	60,840	
三井不動産	118	78	214,500	
三菱地所	118	78	166,686	
東京建物	59	39	62,946	
住友不動産	118	78	302,640	
サービス業 (4.2%)				
ディー・エヌ・エー	35.4	23.4	61,074	
電通	118	78	382,200	
楽天	118	78	92,781	
リクルートホールディングス	—	234	641,862	
日本郵政	—	78	102,024	
東京ドーム	59	39	43,134	
セコム	118	78	697,866	
合 計	株数・金額	23,393	13,568	48,217,121
	銘柄数<比率>	225	225	<96.7%>

*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	日経225	百万円 1,632	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	48,217,121	94.2
コール・ローン等、その他	2,959,328	5.8
投資信託財産総額	51,176,449	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11月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,176,449,672
コール・ローン等	2,531,995,782
株式(評価額)	48,217,121,940
未収入金	98,504,950
未取配当金	328,827,000
(B) 負債	1,305,260,747
未払金	1,225,774,000
未払解約金	77,953,880
未払利息	2,867
前受金	1,530,000
(C) 純資産総額(A-B)	49,871,188,925
元本	36,598,712,762
次期繰越損益金	13,272,476,163
(D) 受益権総口数	36,598,712,762口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,626円

(注) 期首元本額は54,217,735,144円、期中追加設定元本額は44,322,828,193円、期中一部解約元本額は61,941,850,575円、1口当たり純資産額は1,3626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・日経225 16,909,433,434円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 16,212,097,351円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 1,389,479,129円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 1,382,845,288円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 567,929,930円
- ・野村FoFs用・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 134,790,356円
- ・野村つみたて日本株投信 1,274,308円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 862,966円

○損益の状況 (2016年11月8日～2017年11月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	847,159,355
受取配当金	847,993,908
受取利息	48
その他収益金	80,305
支払利息	△ 914,906
(B) 有価証券売買損益	15,035,546,036
売買益	15,550,727,130
売買損	△ 515,181,094
(C) 先物取引等取引損益	560,375,411
取引益	826,423,019
取引損	△ 266,047,608
(D) 保管費用等	△ 36,927
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	16,443,043,875
(F) 前期繰越損益金	95,858,024
(G) 追加信託差損益金	7,310,898,049
(H) 解約差損益金	△10,577,323,785
(I) 計(E+F+G+H)	13,272,476,163
次期繰越損益金(I)	13,272,476,163

* 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

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>