

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9期（決算日2019年9月6日）

作成対象期間（2018年9月7日～2019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)	税 達 配 分		期 騰 落 中 率		ベンチマーク 日経平均株価 (日経225)		株組入比率	株先物比率	純資産額
		分	配	金	騰 落 中 率	日経平均株価 (日経225)	騰 落 中 率			
5期(2015年9月7日)	円 18,887			円 0	% 15.0	円 17,860	% 13.7	% 96.2	% 3.8	百万円 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
9期(2019年9月6日)	23,803			0	△ 4.1	21,200	△ 5.7	98.3	1.7	41,137

*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		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	日経平均株価 (日経225)	騰 落 率		
(期首) 2018年9月6日	円 24,811	% -	円 22,488	% -	% 96.8	% 3.2
9月末	26,782	7.9	24,120	7.3	97.4	2.6
10月末	24,349	△ 1.9	21,920	△ 2.5	97.1	2.9
11月末	24,823	0.0	22,351	△ 0.6	98.6	1.4
12月末	22,267	△ 10.3	20,015	△ 11.0	96.0	3.9
2019年1月末	23,105	△ 6.9	20,773	△ 7.6	98.6	1.4
2月末	23,795	△ 4.1	21,385	△ 4.9	98.5	1.5
3月末	23,777	△ 4.2	21,206	△ 5.7	96.6	3.4
4月末	24,962	0.6	22,259	△ 1.0	96.9	3.1
5月末	23,101	△ 6.9	20,601	△ 8.4	96.5	3.4
6月末	23,889	△ 3.7	21,276	△ 5.4	96.5	3.5
7月末	24,155	△ 2.6	21,522	△ 4.3	97.2	2.7
8月末	23,249	△ 6.3	20,704	△ 7.9	96.6	3.3
(期末) 2019年9月6日	23,803	△ 4.1	21,200	△ 5.7	98.3	1.7

*騰落率は期首比です。

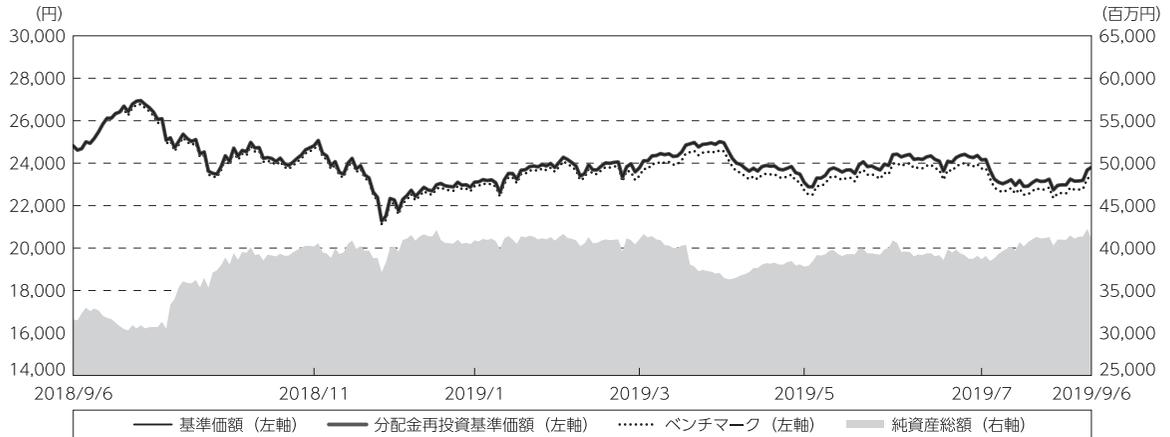
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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



期首：24,811円

期末：23,803円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 4.1% (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(2018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24,811円から期末23,803円に1,008円の値下がりとなりました。

米中貿易摩擦への懸念が高まったことや、FOMC(米連邦公開市場委員会)の利上げ決定などから景気減速への警戒感が高まり、米国株式市場が下落したことなどをを受けて、国内株式市場も下落しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首から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を受けて、上昇しました。2018年10月以降は、米中貿易摩擦への懸念が高まったことや、FOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ決定などから景気減速への警戒感が高まり、米国株式市場が下落したことなどを受けて、下落しました。

2019年1月以降は、米中貿易協議の進展が期待されたことなどから上昇しましたが、5月以降は、国内企業の2019年3月期決算発表において新年度業績見通しが慎重であったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が持続的な利下げを否定したことや、米中貿易摩擦への懸念が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-4.1%となり、ベンチマークである日経平均株価の-5.7%を1.6ポイント上回りました。

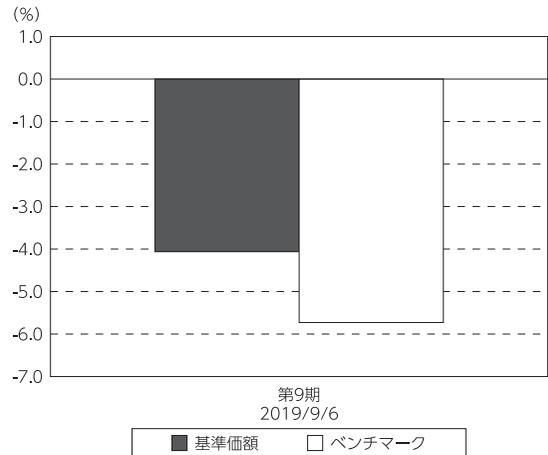
(プラス要因)

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9期
	2018年9月7日～ 2019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	13,802

(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

(2018年9月7日～2019年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	104	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 ）	(48)	(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 ）	(48)	(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	0.004	(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)	(0.004)	
(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	106	0.439	
期中の平均基準価額は、24,021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。

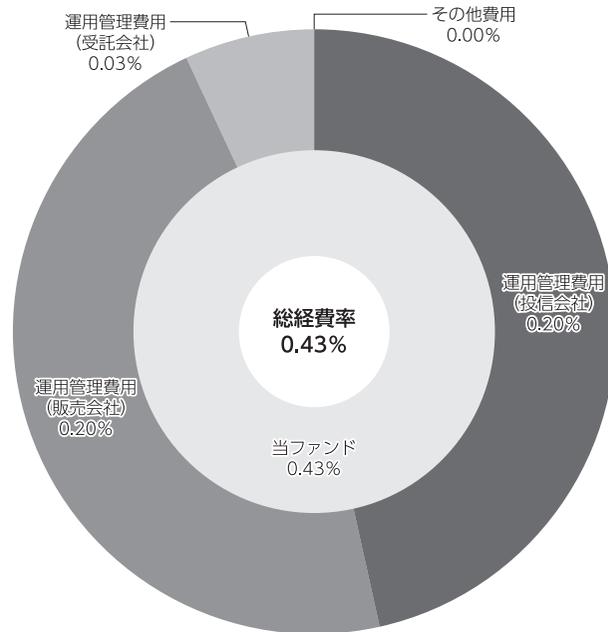
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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0.43%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

(2018年9月7日～2019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	27,551,039	36,055,877	19,341,008	25,828,261

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2018年9月7日～2019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	43,642,436千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	66,570,438千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.65	

* (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9月7日～2019年9月6日)

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 21	百万円 10	百万円 53

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

(2019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	評 価 額	口 数	評 価 額
ミリオン・インデックスマザーファンド	23,365,746	千円 41,133,765	31,575,777	千円 41,133,765

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ミリオン・インデックスマザーファンド	41,133,765	96.5
コール・ローン等、その他	1,471,074	3.5
投資信託財産総額	42,604,839	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9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	42,604,839,265
コール・ローン等	141,675,628
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	41,133,765,134
未収入金	1,329,398,503
(B) 負債	1,466,986,430
未払解約金	1,380,615,314
未払信託報酬	85,727,973
未払利息	237
その他未払費用	642,906
(C) 純資産総額(A-B)	41,137,852,835
元本	17,282,748,487
次期繰越損益金	23,855,104,348
(D) 受益権総口数	17,282,748,487口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,803円

(注) 期首元本額は12,733,638,567円、期中追加設定元本額は22,790,917,778円、期中一部解約元本額は18,241,807,858円、1口当たり純資産額は2.3803円です。

○損益の状況 (2018年9月7日～2019年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 75,754
支払利息	△ 75,754
(B) 有価証券売買損益	△ 323,648,618
売買益	1,003,099,270
売買損	△ 1,326,747,888
(C) 信託報酬等	△ 168,365,635
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 492,090,007
(E) 前期繰越損益金	154,937,755
(F) 追加信託差損益金	24,192,256,600
(配当等相当額)	(3,820,100,924)
(売買損益相当額)	(20,372,155,676)
(G) 計(D+E+F)	23,855,104,348
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	23,855,104,348
追加信託差損益金	24,192,256,600
(配当等相当額)	(3,908,734,172)
(売買損益相当額)	(20,283,522,428)
分配準備積立金	758,471,455
繰越損益金	△ 1,095,623,707

*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 (2018年9月7日～2019年9月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年9月7日～ 2019年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	603,533,700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	23,096,632,893円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	154,937,755円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	23,855,104,348円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	13,802円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(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

(2019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(54,619,961千口)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 (0.1%)				
日本水産	98	120	72,480	
マルハニチロ	9.8	12	32,412	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	39.2	48	43,516	
建設業 (2.3%)				
コムシスホールディングス	98	120	352,080	
大成建設	19.6	24	90,480	
大林組	98	120	119,520	
清水建設	98	120	108,600	
長谷工コーポレーション	19.6	24	27,720	
鹿島建設	98	60	78,840	
大和ハウス工業	98	120	404,280	
積水ハウス	98	120	237,960	
日揮	98	120	155,280	
千代田化工建設	98	—	—	
食料品 (4.2%)				
日清製粉グループ本社	98	120	235,080	
明治ホールディングス	19.6	24	177,360	
日本ハム	49	60	243,300	
サッポロホールディングス	19.6	24	60,408	
アサヒグループホールディングス	98	120	609,600	
キリンホールディングス	98	120	251,100	
宝ホールディングス	98	120	124,920	
キッコーマン	98	120	573,000	
味の素	98	120	226,920	
ニチレイ	49	60	142,380	
日本たばこ産業	98	120	264,420	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	9.8	12	16,656	
ユニチカ	9.8	12	3,804	
帝人	19.6	24	46,920	
東レ	98	120	91,248	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	98	120	60,360	
日本製紙	9.8	12	21,492	

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
化学 (8.4%)				
クラレ	98	120	150,600	
旭化成	98	120	118,068	
昭和電工	9.8	12	33,708	
住友化学	98	120	57,840	
日産化学	98	120	540,000	
東ソー	49	60	83,460	
トクヤマ	19.6	24	54,696	
デンカ	19.6	24	68,112	
信越化学工業	98	120	1,340,400	
三井化学	19.6	24	55,224	
三菱ケミカルホールディングス	49	60	46,728	
宇部興産	9.8	12	24,948	
日本化薬	98	120	144,720	
花王	98	120	925,800	
D I C	—	12	34,080	
富士フィルムホールディングス	98	120	557,160	
資生堂	98	120	1,038,960	
日東電工	98	120	627,000	
医薬品 (7.8%)				
協和キリン	98	120	238,320	
武田薬品工業	98	120	442,800	
アステラス製薬	490	600	906,000	
大日本住友製薬	98	120	216,000	
塩野義製薬	98	120	690,240	
中外製薬	98	120	933,600	
エーザイ	98	120	634,560	
第一三共	98	120	845,760	
大塚ホールディングス	98	120	531,480	
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	98	—	—	
出光興産	—	48	140,064	
J X T Gホールディングス	98	120	54,516	
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	49	60	124,800	
ブリヂストン	98	120	491,520	

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 (1.1%)			
AGC	19.6	24	76,440
日本板硝子	9.8	12	7,656
日本電気硝子	29.4	36	83,088
住友大阪セメント	98	12	53,940
太平洋セメント	9.8	12	33,144
東海カーボン	98	120	130,560
TOTO	49	60	235,200
日本硝子	98	120	176,160
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	9.8	12	17,928
神戸製鋼所	9.8	12	6,744
ジェイ エフ イー ホールディングス	9.8	12	15,252
日新製鋼	9.8	—	—
大太平洋金属	9.8	12	26,064
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	98	120	22,440
三井金属鉱業	9.8	12	28,296
東邦亜鉛	9.8	12	23,712
三菱マテリアル	9.8	12	31,380
住友金属鉱山	49	60	193,200
DOWAホールディングス	19.6	24	82,200
古河機械金属	9.8	—	—
古河電気工業	9.8	12	28,500
住友電気工業	98	120	154,860
フジクラ	98	120	42,600
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	9.8	12	17,400
東洋製罐グループホールディングス	98	120	192,480
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	19.6	24	49,896
オークマ	19.6	24	128,880
アマダホールディングス	98	120	137,760
小松製作所	98	120	279,960
住友重機械工業	19.6	24	74,880
日立建機	98	120	282,840
クボタ	98	120	187,620
荏原製作所	19.6	24	62,952
ダイキン工業	98	120	1,689,000
日本精工	98	120	108,360
NTN	98	120	35,880
ジェイテクト	98	120	142,320
日立造船	19.6	24	7,656

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	9.8	12	49,308
IHI	9.8	12	26,940
電気機器 (19.2%)			
日清紡ホールディングス	98	120	96,600
コニカミノルタ	98	120	91,680
ミネベアミツミ	98	120	208,800
日立製作所	98	24	94,152
三菱電機	98	120	160,020
富士電機	98	24	75,840
安川電機	98	120	453,600
オムロン	—	120	679,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	98	24	43,464
日本電気	9.8	12	55,560
富士通	98	12	103,140
沖電気工業	9.8	12	17,088
セイコーエプソン	196	240	347,040
パナソニック	98	120	102,036
ソニー	98	120	763,200
TDK	98	120	1,108,800
アルプスアルパイン	98	120	233,160
バイオニア	98	—	—
横河電機	98	120	233,880
アドバンテスト	196	240	1,106,400
カシオ計算機	98	120	187,800
ファナック	98	120	2,232,600
京セラ	196	240	1,571,760
太陽誘電	98	120	269,400
SCREENホールディングス	19.6	24	152,640
キヤノン	147	180	502,560
リコー	98	120	115,200
東京エレクトロン	98	120	2,400,600
輸送用機器 (4.9%)			
デンソー	98	120	551,520
三井E&Sホールディングス	9.8	12	10,032
川崎重工業	9.8	12	25,872
日産自動車	98	120	80,880
いすゞ自動車	49	60	69,360
トヨタ自動車	98	120	843,600
日野自動車	98	120	104,040
三菱自動車工業	9.8	12	5,520
マツダ	19.6	24	22,231
本田技研工業	196	240	656,160
スズキ	98	120	503,520

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SUBARU	98	120	352,200
ヤマハ発動機	98	120	214,800
精密機器 (3.4%)			
テルモ	196	480	1,495,680
ニコン	98	120	162,720
オリンパス	98	480	669,600
シチズン時計	98	120	61,560
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	—	120	768,000
凸版印刷	98	60	107,520
大日本印刷	49	60	143,400
ヤマハ	98	120	553,800
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	9.8	12	6,096
中部電力	9.8	12	18,306
関西電力	9.8	12	15,252
東京瓦斯	19.6	24	62,796
大阪瓦斯	19.6	24	45,432
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	19.6	24	79,560
東急	49	60	113,040
小田急電鉄	49	60	143,760
京王電鉄	19.6	24	155,280
京成電鉄	49	60	253,800
東日本旅客鉄道	9.8	12	120,060
西日本旅客鉄道	9.8	12	108,924
東海旅客鉄道	9.8	12	249,480
日本通運	9.8	12	65,520
ヤマトホールディングス	98	120	217,800
海運業 (0.1%)			
日本郵船	9.8	12	20,412
商船三井	9.8	12	32,496
川崎汽船	9.8	12	14,724
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	9.8	12	43,164
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	49	60	158,640
情報・通信業 (10.9%)			
ヤフー	39.2	48	13,632
トレンドマイクロ	98	120	607,200
スカパーJ SATホールディングス	9.8	12	5,040
日本電信電話	19.6	24	121,344
KDDI	588	720	2,031,480

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NTTドコモ	9.8	12	32,208
東宝	9.8	12	54,960
エヌ・ティ・ティ・データ	490	600	824,400
コナミホールディングス	98	120	603,600
ソフトバンクグループ	294	720	3,360,960
卸売業 (2.1%)			
双日	9.8	12	4,032
伊藤忠商事	98	120	262,800
丸紅	98	120	83,484
豊田通商	98	120	416,400
三井物産	98	120	206,280
住友商事	98	120	198,660
三菱商事	98	120	324,600
小売業 (14.6%)			
J. フロント リテイリング	49	60	72,660
三越伊勢丹ホールディングス	98	120	96,360
セブン&アイ・ホールディングス	98	120	462,600
ファミリーマート	98	480	1,218,240
高島屋	49	60	70,740
丸井グループ	98	120	253,800
イオン	98	120	226,620
ファーストリテイリング	98	120	7,818,000
銀行業 (0.7%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98	120	45,480
新生銀行	9.8	12	17,244
あおぞら銀行	9.8	12	29,772
三菱UFJフィナンシャル・グループ	98	120	62,376
りそなホールディングス	9.8	12	5,079
三井住友トラスト・ホールディングス	9.8	12	42,672
三井住友フィナンシャルグループ	9.8	12	42,312
千葉銀行	98	120	64,560
ふくおかフィナンシャルグループ	98	24	44,208
静岡銀行	98	120	87,840
みずほフィナンシャルグループ	98	120	19,008
証券・商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	98	120	56,928
野村ホールディングス	98	120	53,112
松井証券	98	120	106,440
保険業 (1.0%)			
SOMPOホールディングス	24.4	30	132,030
MS&ADインシュアランスグループホール	29.4	36	123,120
ソニーフィナンシャルホールディングス	19.6	24	55,632
第一生命ホールディングス	9.8	12	18,000

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	49	60	334,020
T&Dホールディングス	19.6	24	25,752
その他金融業 (0.2%)			
クレディセゾン	98	120	143,160
不動産業 (1.7%)			
東急不動産ホールディングス	98	120	79,320
三井不動産	98	120	309,000
三菱地所	98	120	243,540
東京建物	49	60	87,780
住友不動産	98	120	469,560
サービス業 (4.5%)			
ディー・エヌ・エー	29.4	36	74,124
電通	98	120	438,000

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サイバーエージェント	—	24	105,600	
楽天	98	120	118,080	
リクルートホールディングス	294	360	1,171,800	
日本郵政	98	120	115,920	
東京ドーム	49	60	59,160	
セコム	98	120	1,100,640	
合 計	株 数・金 額	16,949	21,294	69,950,943
	銘柄数<比率>	225	225	<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、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	日経225	百万円 1,187	百万円 —

*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31期（決算日2018年11月7日）

作成対象期間（2017年11月8日～2018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
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
31期(2018年11月7日)	13,379	△1.8	22,086	△3.7	96.5	3.5	69,198

*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) 2017年11月7日	円	%	円	%	%	%
	13,626	-	22,938	-	96.7	3.3
11月末	13,504	△0.9	22,725	△0.9	96.9	3.0
12月末	13,548	△0.6	22,765	△0.8	98.1	1.9
2018年1月末	13,749	0.9	23,098	0.7	98.0	2.0
2月末	13,139	△3.6	22,068	△3.8	97.9	2.1
3月末	12,869	△5.6	21,454	△6.5	97.0	3.0
4月末	13,481	△1.1	22,468	△2.0	98.3	1.7
5月末	13,323	△2.2	22,202	△3.2	97.5	2.5
6月末	13,404	△1.6	22,305	△2.8	97.6	2.3
7月末	13,553	△0.5	22,554	△1.7	97.0	3.0
8月末	13,747	0.9	22,865	△0.3	98.7	1.3
9月末	14,598	7.1	24,120	5.2	97.4	2.6
10月末	13,277	△2.6	21,920	△4.4	97.1	2.9
(期末) 2018年11月7日	円	%	円	%	%	%
	13,379	△1.8	22,086	△3.7	96.5	3.5

*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。

- 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13,626円から期末13,379円に247円の値下がりとなりました。

米国の長期金利の上昇や、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が発生したことなどを受け国内株式市場も下落し、基準価額は下落しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首は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や、外国為替市場で円高ドル安が進行したことなどを受け、下落しました。3月以降は米国の保護主義的な通商政策に対する見通しや、外国為替市場と海外の株式市場の動向などを受けて、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や、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が発生し、国内株式市場も急落しました。

○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

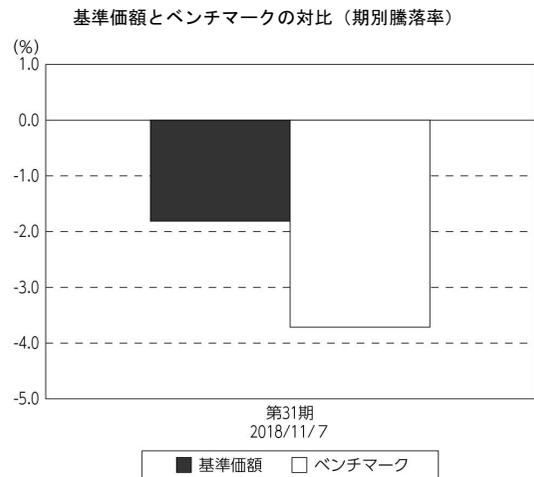
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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-1.8%となり、ベンチマークである日経平均株価の-3.7%を1.9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

(2017年11月8日～2018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	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)	1	0.006	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.006)	
合 計	1	0.006	
期中の平均基準価額は、13,516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

(2017年11月8日～2018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	千円	千株	千円
		14,842	51,936,706	9,034	32,148,274
		(△ 666)	()		

*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
		82,950	82,088	—	—

*単位未満は切り捨て。

(2017年11月8日～2018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	84,084,981千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	60,025,405千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.40

* (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11月8日～2018年11月7日)

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 52	百万円 31	百万円 58

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。

(2018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		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	千円	
水産・農林業 (0.2%)					日本製紙	7.8	11.2	22,265	
日本水産	78	112	76,160		化学 (8.5%)				
マルハニチロ	7.8	11.2	45,584		クラレ	78	112	174,832	
鉱業 (0.1%)					旭化成	78	112	138,152	
国際石油開発帝石	31.2	44.8	56,425		昭和電工	7.8	11.2	57,680	
建設業 (2.4%)					住友化学	78	112	67,312	
コムシスホールディングス	78	112	325,248		日産化学	78	112	647,360	
大成建設	15.6	22.4	112,224		東ソー	39	56	85,344	
大林組	78	112	115,248		トクヤマ	15.6	22.4	59,830	
清水建設	78	112	103,600		デンカ	15.6	22.4	77,952	
長谷工コーポレーション	15.6	22.4	32,121		信越化学工業	78	112	1,123,360	
鹿島建設	78	56	84,616		三井化学	15.6	22.4	61,644	
大和ハウス工業	78	112	374,752		三菱ケミカルホールディングス	39	56	52,113	
積水ハウス	78	112	185,472		宇部興産	7.8	11.2	27,776	
日揮	78	112	231,056		日本化薬	78	112	155,344	
千代田化工建設	78	112	46,592		花王	78	112	864,192	
食料品 (4.6%)					富士フイルムホールディングス	78	112	534,576	
日清製粉グループ本社	78	112	253,232		資生堂	78	112	841,008	
明治ホールディングス	15.6	22.4	172,704		日東電工	78	112	681,520	
日本ハム	78	56	228,200		医薬品 (8.7%)				
サッポロホールディングス	15.6	22.4	53,222		協和発酵キリン	78	112	250,320	
アサヒグループホールディングス	78	112	557,424		武田薬品工業	78	112	520,464	
キリンホールディングス	78	112	285,264		アステラス製薬	390	560	939,960	
宝ホールディングス	78	112	157,024		大日本住友製薬	78	112	316,848	
キッコーマン	78	112	674,240		塩野義製薬	78	112	817,824	
味の素	78	112	211,568		中外製薬	78	112	758,240	
ニチレイ	39	56	154,896		エーザイ	78	112	1,108,128	
日本たばこ産業	78	112	313,712		第一三共	78	112	479,696	
繊維製品 (0.2%)					大塚ホールディングス	78	112	614,656	
東洋紡	7.8	11.2	17,942		石油・石炭製品 (0.5%)				
ユニチカ	7.8	11.2	6,507		昭和シェル石油	78	112	227,696	
帝人	15.6	22.4	43,590		J X T Gホールディングス	78	112	82,387	
東レ	78	112	91,089		ゴム製品 (0.9%)				
パルプ・紙 (0.1%)					横浜ゴム	39	56	128,856	
王子ホールディングス	78	112	82,432		ブリヂストン	78	112	485,520	

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			
ガラス・土石製品 (1.4%)						
AGC	15.6	22.4	83,216			
日本板硝子	7.8	11.2	11,614			
日本電気硝子	23.4	33.6	99,288			
住友大阪セメント	78	11.2	50,064			
太平洋セメント	7.8	11.2	38,080			
東海カーボン	78	112	214,256			
TOTO	39	56	232,120			
日本碍子	78	112	187,264			
鉄鋼 (0.2%)						
新日鐵住金	7.8	11.2	24,259			
神戸製鋼所	7.8	11.2	11,076			
ジェイ エフ イー ホールディングス	7.8	11.2	24,432			
日新製鋼	7.8	11.2	17,124			
大太平洋金属	7.8	11.2	37,520			
非鉄金属 (1.0%)						
日本軽金属ホールディングス	78	112	27,888			
三井金属鉱業	7.8	11.2	35,392			
東邦亜鉛	7.8	11.2	43,232			
三菱マテリアル	7.8	11.2	33,264			
住友金属鉱山	39	56	209,216			
DOWAホールディングス	15.6	22.4	78,400			
古河機械金属	7.8	—	—			
古河電気工業	7.8	11.2	35,280			
住友電気工業	78	112	177,240			
フジクラ	78	112	55,216			
金属製品 (0.4%)						
SUMCO	7.8	11.2	18,267			
東洋製鐵グループホールディングス	78	112	256,816			
機械 (4.8%)						
日本製鋼所	15.6	22.4	57,926			
オークマ	15.6	22.4	132,160			
アマダホールディングス	78	112	124,208			
小松製作所	78	112	350,224			
住友重機械工業	15.6	22.4	79,408			
日立建機	78	112	350,000			
クボタ	78	112	206,584			
荏原製作所	15.6	22.4	74,256			
ダイキン工業	78	112	1,396,080			
日本精工	78	112	122,640			

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			
NTN	78	112	41,888			
ジェイテクト	78	112	153,104			
日立造船	15.6	22.4	9,116			
三菱重工業	7.8	11.2	47,577			
I H I	7.8	11.2	44,352			
電気機器 (17.3%)						
日清紡ホールディングス	78	112	126,000			
コニカミノルタ	78	112	120,288			
ミネベアミツミ	78	112	191,408			
日立製作所	78	22.4	78,892			
三菱電機	78	112	161,560			
富士電機	78	22.4	80,528			
安川電機	78	112	389,760			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	78	22.4	54,140			
日本電気	7.8	11.2	38,416			
富士通	78	11.2	77,940			
沖電気工業	7.8	11.2	16,923			
セイコーエプソン	156	224	417,536			
パナソニック	78	112	132,272			
ソニー	78	112	683,760			
TDK	78	112	1,133,440			
アルプス電気	78	112	298,816			
パイオニア	78	112	10,864			
横河電機	78	112	261,520			
アドバンテスト	156	224	554,176			
カシオ計算機	78	112	186,928			
ファナック	78	112	2,338,000			
京セラ	156	224	1,359,904			
太陽誘電	78	112	292,320			
S C R E E Nホールディングス	15.6	22.4	138,880			
キヤノン	117	168	538,944			
リコー	78	112	124,992			
東京エレクトロン	78	112	1,729,840			
輸送用機器 (5.5%)						
デンソー	78	112	578,032			
三井E&Sホールディングス	7.8	11.2	15,444			
川崎重工業	7.8	11.2	29,948			
日産自動車	78	112	114,352			
いすゞ自動車	39	56	88,004			
トヨタ自動車	78	112	743,568			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日野自動車	78	112	120,624
三菱自動車工業	7.8	11.2	8,332
マツダ	15.6	22.4	27,328
本田技研工業	156	224	723,296
スズキ	78	112	613,536
SUBARU	78	112	323,232
ヤマハ発動機	78	112	258,832
精密機器 (3.2%)			
テルモ	156	224	1,422,400
ニコン	78	112	222,656
オリンパス	78	112	402,080
シチズン時計	78	112	74,928
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	78	56	90,160
大日本印刷	39	56	142,520
ヤマハ	78	112	588,000
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	7.8	11.2	6,361
中部電力	7.8	11.2	17,399
関西電力	7.8	11.2	19,314
東京瓦斯	15.6	22.4	60,558
大阪瓦斯	15.6	22.4	45,718
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	15.6	22.4	70,000
東京急行電鉄	39	56	102,368
小田急電鉄	39	56	131,768
京王電鉄	15.6	22.4	135,072
京成電鉄	39	56	193,200
東日本旅客鉄道	7.8	11.2	110,432
西日本旅客鉄道	7.8	11.2	84,425
東海旅客鉄道	7.8	11.2	240,072
日本通運	7.8	11.2	79,072
ヤマトホールディングス	78	112	320,320
海運業 (0.1%)			
日本郵船	7.8	11.2	21,492
商船三井	7.8	11.2	30,968
川崎汽船	7.8	11.2	18,715
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	7.8	11.2	43,052

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	39	56	148,848
情報・通信業 (10.2%)			
ヤフー	31.2	44.8	14,784
トレンドマイクロ	78	112	751,520
スカパーJ S A Tホールディングス	7.8	11.2	5,756
日本電信電話	15.6	22.4	100,710
KDD I	468	672	1,641,696
NTTドコモ	7.8	11.2	27,944
東宝	7.8	11.2	40,600
エヌ・ティ・ティ・データ	390	560	777,280
コナミホールディングス	78	112	549,920
ソフトバンクグループ	234	336	2,875,152
卸売業 (2.3%)			
双日	7.8	11.2	4,580
伊藤忠商事	78	112	227,360
丸紅	78	112	97,104
豊田通商	78	112	442,960
三井物産	78	112	207,872
住友商事	78	112	194,488
三菱商事	78	112	348,432
小売業 (14.7%)			
J・フロント リテイリング	39	56	87,360
三越伊勢丹ホールディングス	78	112	155,680
セブン&アイ・ホールディングス	78	112	551,936
ユニー・ファミリーマートホールディングス	78	112	1,601,600
高島屋	78	56	102,368
丸井グループ	78	112	271,152
イオン	78	112	298,312
ファーストリテイリング	78	112	6,770,400
銀行業 (0.9%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	78	112	58,800
新生銀行	7.8	11.2	19,678
あおぞら銀行	7.8	11.2	43,848
三菱UFJフィナンシャル・グループ	78	112	75,432
りそなホールディングス	7.8	11.2	6,800
三井住友トラスト・ホールディングス	7.8	11.2	51,004
三井住友フィナンシャルグループ	7.8	11.2	49,705
千葉銀行	78	112	82,320
ふくおかフィナンシャルグループ	78	22.4	64,019

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
静岡銀行	78	112	115,360	
みずほフィナンシャルグループ	78	112	21,672	
証券、商品先物取引業 (0.4%)				
大和証券グループ本社	78	112	71,545	
野村ホールディングス	78	112	58,732	
松井証券	78	112	135,632	
保険業 (1.0%)				
SOMPOホールディングス	19.5	28	134,848	
MS&ADインシュアランスグループホール	23.4	33.6	115,617	
ソニーフィナンシャルホールディングス	15.6	22.4	59,382	
第一生命ホールディングス	7.8	11.2	24,444	
東京海上ホールディングス	39	56	303,800	
T&Dホールディングス	15.6	22.4	41,395	
その他金融業 (0.3%)				
クレディセゾン	78	112	201,712	
不動産業 (1.6%)				
東急不動産ホールディングス	78	112	72,464	
三井不動産	78	112	291,424	

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
三菱地所	78	112	206,752	
東京建物	39	56	69,384	
住友不動産	78	112	451,136	
サービス業 (4.6%)				
ディー・エヌ・エー	23.4	33.6	69,283	
電通	78	112	605,920	
サイバーエージェント	—	22.4	115,136	
楽天	78	112	98,896	
リクルートホールディングス	234	336	1,013,376	
日本郵政	78	112	149,968	
東京ドーム	39	56	55,440	
セコム	78	112	998,704	
合 計	株 数 ・ 金 額	13,568	18,709	66,770,140
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 96.5% >

*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 2,411	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 66,770,140	% 96.5
コール・ローン等、その他	2,457,402	3.5
投資信託財産総額	69,227,542	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11月7日現在)

○損益の状況 (2017年11月8日～2018年11月7日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,227,542,163
コール・ローン等	1,882,883,937
株式(評価額)	66,770,140,640
未収入金	61,467,026
未収配当金	481,920,560
差入委託証拠金	31,130,000
(B) 負債	28,834,900
未払解約金	28,830,936
未払利息	3,964
(C) 純資産総額(A-B)	69,198,707,263
元本	51,721,526,486
次期繰越損益金	17,477,180,777
(D) 受益権総口数	51,721,526,486口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,379円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,171,234,830
受取配当金	1,172,489,474
受取利息	280
その他収益金	78,581
支払利息	△ 1,333,505
(B) 有価証券売買損益	△ 1,235,412,740
売買益	6,687,791,616
売買損	△ 7,923,204,356
(C) 先物取引等取引損益	△ 83,036,346
取引益	787,831,594
取引損	△ 870,867,940
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 147,214,256
(E) 前期繰越損益金	13,272,476,163
(F) 追加信託差損益金	17,720,880,689
(G) 解約差損益金	△13,368,961,819
(H) 計(D+E+F+G)	17,477,180,777
次期繰越損益金(H)	17,477,180,777

(注) 期首元本額は36,598,712,762円、期中追加設定元本額は51,332,495,607円、期中一部解約元本額は36,209,681,883円、1口当たり純資産額は1,3379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 29,482,535,868円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 14,830,719,479円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 2,484,458,947円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 2,156,660,282円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 1,178,585,168円
- ・野村つみたて日本株投信 924,659,484円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 535,107,613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) 128,799,645円

* 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。