

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11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	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)	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	み 金 騰 落 率	日経平均株価 (日経225)	騰 落 率			
7期(2017年9月6日)	円 21,057	円 0	% 15.0	円 19,358	% 13.3	% 97.8	% 2.1	百万円 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
10期(2020年9月7日)	26,366	0	10.8	23,090	8.9	97.3	2.6	35,596
11期(2021年9月6日)	34,217	0	29.8	29,660	28.5	98.9	1.0	51,306

*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) 2020年9月7日	円 26,366	% -	円 23,090	% -	% 97.3	% 2.6
9月末	26,627	1.0	23,185	0.4	97.2	2.8
10月末	26,378	0.0	22,977	△ 0.5	97.4	2.6
11月末	30,345	15.1	26,434	14.5	98.1	1.8
12月末	31,535	19.6	27,444	18.9	98.8	1.2
2021年1月末	31,776	20.5	27,663	19.8	97.1	2.9
2月末	33,279	26.2	28,966	25.4	97.7	2.2
3月末	33,690	27.8	29,179	26.4	96.7	3.3
4月末	33,261	26.2	28,813	24.8	97.9	2.1
5月末	33,317	26.4	28,860	25.0	97.5	2.5
6月末	33,234	26.0	28,792	24.7	97.8	2.2
7月末	31,474	19.4	27,284	18.2	97.2	2.8
8月末	32,405	22.9	28,090	21.7	97.5	2.4
(期末) 2021年9月6日	34,217	29.8	29,660	28.5	98.9	1.0

*騰落率は期首比です。

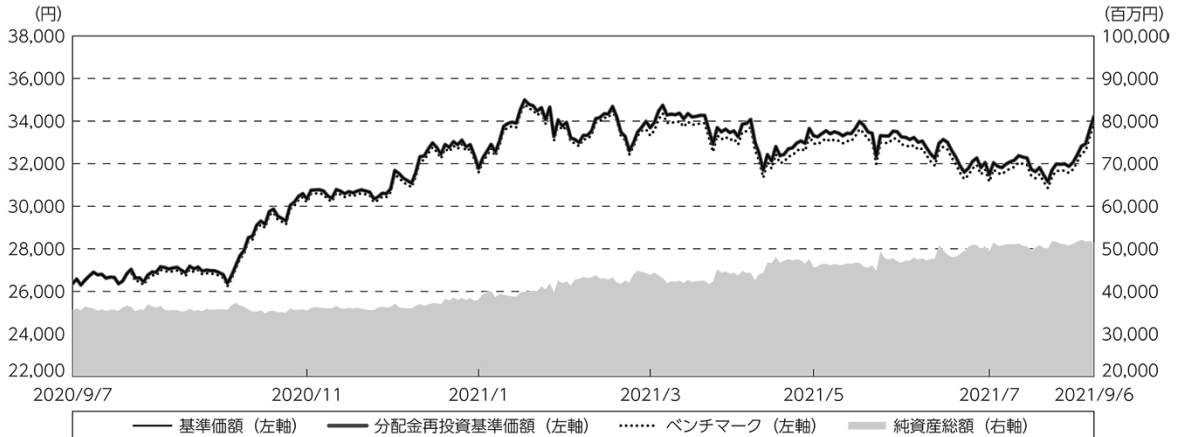
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*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(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、日経平均株価(日経225)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ないました。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ないました。

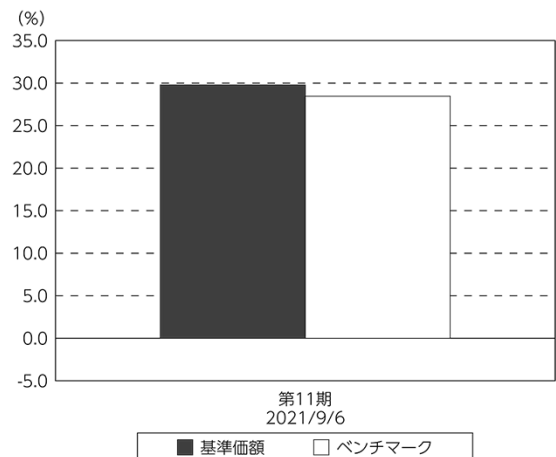
○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+29.8%となり、ベンチマークである日経平均株価の+28.5%を1.3ポイント上回りました。

主な差異要因

- ・保有銘柄の配当が計上されたこと
- ・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11期
	2020年9月8日～ 2021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	24,217

(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

(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 138	% 0.439	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(64)	(0.203)	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 ）	(64)	(0.203)	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 ）	(10)	(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	0.004	(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	140	0.446	
期中の平均基準価額は、31,443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。

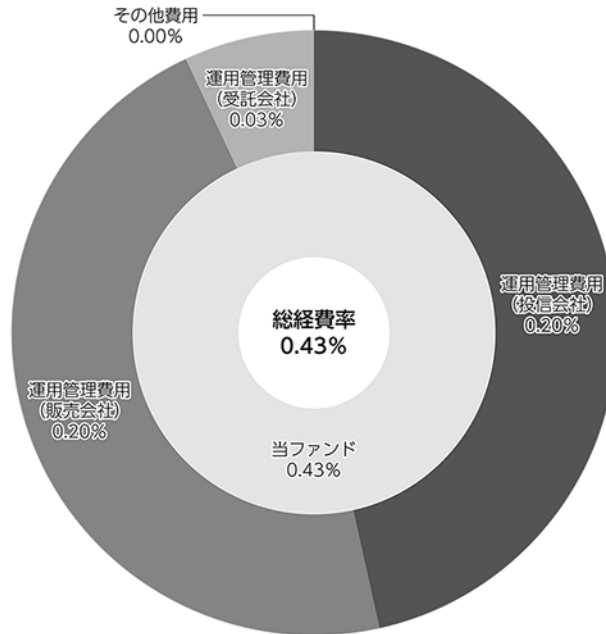
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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

(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
ミリオン・インデックスマザーファンド	29,196,416	51,180,052	26,600,995	46,305,144

*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	
	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	52,746,465千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	80,631,758千円	
(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

(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 30,246	百万円 139	% 0.5	百万円 22,500	百万円 38	% 0.2

平均保有割合 50.8%

※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 21	百万円 15	百万円 67

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

(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
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 24,557,044	千口 27,152,465	千円 51,301,868

*口数・評価額の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
ミリオン・インデックスマザーファンド	千円 51,301,868	% 95.1
コール・ローン等、その他	2,662,852	4.9
投資信託財産総額	53,964,720	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	53,964,720,387
コール・ローン等	271,627,918
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	51,301,868,837
未収入金	2,391,223,632
(B) 負債	2,657,828,530
未払解約金	2,554,501,890
未払信託報酬	102,557,311
未払利息	208
その他未払費用	769,121
(C) 純資産総額(A-B)	51,306,891,857
元本	14,994,490,552
次期繰越損益金	36,312,401,305
(D) 受益権総口数	14,994,490,552口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,217円

(注) 期首元本額は13,501,084,467円、期中追加設定元本額は24,470,701,239円、期中一部解約元本額は22,977,295,154円、1口当たり純資産額は3.4217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	△ 33,239
支払利息	△ 33,239
(B) 有価証券売買損益	4,430,304,669
売買益	8,671,795,405
売買損	△ 4,241,490,736
(C) 信託報酬等	△ 184,980,115
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,245,291,315
(E) 前期繰越損益金	413,070,983
(F) 追加信託差損益金	31,654,039,007
(配当等相当額)	(6,299,235,673)
(売買損益相当額)	(25,354,803,334)
(G) 計(D+E+F)	36,312,401,305
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	36,312,401,305
追加信託差損益金	31,654,039,007
(配当等相当額)	(6,413,031,901)
(売買損益相当額)	(25,241,007,106)
分配準備積立金	4,658,362,298

*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)	615,590,266円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	3,629,701,049円
c. 信託約款に定める収益調整金	31,654,039,007円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	413,070,983円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	36,312,401,305円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	24,217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。

ミリオン・インデックス マザーファンド

運用報告書

第33期（決算日2020年11月9日）

作成対象期間（2019年11月8日～2020年11月9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	中率	日経平均株価	騰落中率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
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
32期(2019年11月7日)	14,446	8.0	23,330	5.6	97.2	2.8	67,958
33期(2020年11月9日)	15,690	8.6	24,840	6.5	97.5	2.5	73,512

*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	騰落率	日経平均株価	騰落率		
(期首) 2019年11月7日	円	%	円	%	%	%
	14,446	-	23,330	-	97.2	2.8
11月末	14,424	△0.2	23,294	△0.2	98.6	1.4
12月末	14,674	1.6	23,657	1.4	97.6	2.4
2020年1月末	14,393	△0.4	23,205	△0.5	97.9	2.1
2月末	13,128	△9.1	21,143	△9.4	95.9	4.1
3月末	11,866	△17.9	18,917	△18.9	96.1	3.9
4月末	12,664	△12.3	20,194	△13.4	96.5	3.5
5月末	13,718	△5.0	21,878	△6.2	96.7	3.3
6月末	13,993	△3.1	22,288	△4.5	96.6	3.4
7月末	13,628	△5.7	21,710	△6.9	97.6	2.3
8月末	14,526	0.6	23,140	△0.8	97.8	2.2
9月末	14,642	1.4	23,185	△0.6	97.2	2.8
10月末	14,510	0.4	22,977	△1.5	97.4	2.6
(期末) 2020年11月9日	円	%	円	%	%	%
	15,690	8.6	24,840	6.5	97.5	2.5

*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」を示す標準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と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

国内株式の株価の変動

○投資環境

国内株式市場は、期首から米中貿易協議の進展への期待が続いたこと、英国の総選挙において保守党が大勝し英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が薄らいだことなどをを受けて堅調に推移しました。

2020年2月下旬以降は、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。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、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、米国の大統領、連邦議会上・下院選挙において、上・下両院が共和党と民主党に割れる「ねじれ」状態が続くと観測から、民主党が掲げているハイテク企業への規制強化、ヘルスケア改革などへの警戒が和らぎ、大きく上昇しました。

○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

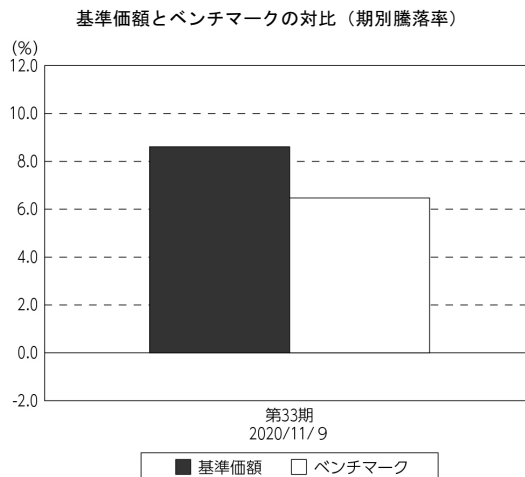
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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+8.6%となり、ベンチマークである日経平均株価の+6.5%を2.1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、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

(2019年11月8日～2020年11月9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	0.004	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.004)	
合 計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、13,847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

(2019年11月8日～2020年11月9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
		5,467	17,276,438	5,244	17,935,381
		(260)	(-)		

*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
		60,880	61,146	-	-

*単位未満は切り捨て。

(2019年11月8日～2020年11月9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	35,211,819千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	66,119,331千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.53

* (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

(2019年11月8日～2020年11月9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 13	百万円 13	百万円 52

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。

(2020年11月9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 (0.1%)				
日本水産	102	104	43,992	
マルハニチロ	10.2	10.4	23,420	
鉱業 (0.0%)				
国際石油開発帝石	40.8	41.6	20,800	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	102	104	313,040	
大成建設	20.4	20.8	71,552	
大林組	102	104	93,704	
清水建設	102	104	80,808	
長谷工コーポレーション	20.4	20.8	26,873	
鹿島建設	51	52	60,372	
大和ハウス工業	102	104	296,244	
積水ハウス	102	104	185,952	
日揮ホールディングス	102	104	92,872	
食料品 (3.6%)				
日清製粉グループ本社	102	104	172,432	
明治ホールディングス	20.4	20.8	161,408	
日本ハム	51	52	233,740	
サッポロホールディングス	20.4	20.8	39,603	
アサヒグループホールディングス	102	104	383,760	
キリンホールディングス	102	104	217,776	
宝ホールディングス	102	104	120,848	
キッコーマン	102	104	651,040	
味の素	102	104	237,536	
ニチレイ	51	52	150,436	
日本たばこ産業	102	104	215,384	
繊維製品 (0.1%)				
東洋紡	10.2	10.4	15,132	
ユニチカ	10.2	10.4	3,733	
帝人	20.4	20.8	35,630	
東レ	102	104	52,052	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	102	104	48,360	
日本製紙	10.2	10.4	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
化学 (8.0%)				
クラレ	102	104	105,664	
旭化成	102	104	98,103	
昭和電工	10.2	10.4	19,645	
住友化学	102	104	38,688	
日産化学	102	104	620,880	
東ソー	51	52	89,960	
トクヤマ	20.4	20.8	47,569	
デンカ	20.4	20.8	68,536	
信越化学工業	102	104	1,570,400	
三井化学	20.4	20.8	57,844	
三菱ケミカルホールディングス	51	52	29,473	
宇部興産	10.2	10.4	18,210	
日本化薬	102	—	—	
花王	102	104	797,576	
D I C	10.2	10.4	26,832	
富士フィルムホールディングス	102	104	573,456	
資生堂	102	104	732,264	
日東電工	102	104	808,080	
医薬品 (8.2%)				
協和キリン	102	104	299,104	
武田薬品工業	102	104	361,400	
アステラス製薬	510	520	822,120	
大日本住友製薬	102	104	137,904	
塩野義製薬	102	104	582,400	
中外製薬	102	312	1,395,576	
エーザイ	102	104	813,176	
第一三共	102	312	1,043,328	
大塚ホールディングス	102	104	436,280	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	40.8	41.6	89,523	
E N E O S ホールディングス	102	104	37,804	
ゴム製品 (0.6%)				
横浜ゴム	51	52	78,260	
ブリヂストン	102	104	368,264	

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%)			
A G C	20.4	20.8	68,224
日本板硝子	10.2	10.4	4,076
日本電気硝子	30.6	31.2	68,140
住友大阪セメント	10.2	10.4	34,268
太平洋セメント	10.2	10.4	26,644
東海カーボン	102	104	124,696
T O T O	51	52	278,200
日本碍子	102	104	164,528
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	10.2	10.4	11,424
神戸製鋼所	10.2	10.4	4,773
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.2	10.4	8,413
大太平洋金属	10.2	10.4	17,160
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	102	10.4	18,064
三井金属鉱業	10.2	10.4	29,255
東邦亜鉛	10.2	10.4	22,297
三菱マテリアル	10.2	10.4	20,384
住友金属鉱山	51	52	186,940
DOWAホールディングス	20.4	20.8	66,976
古河電気工業	10.2	10.4	25,230
住友電気工業	102	104	130,416
フジクラ	102	104	40,872
金属製品 (0.2%)			
SUMCO	10.2	10.4	16,920
東洋製罐グループホールディングス	102	104	107,224
機械 (5.2%)			
日本製鋼所	20.4	20.8	49,774
オークマ	20.4	20.8	113,984
アマダ	102	104	96,616
小松製作所	102	104	255,164
住友重機械工業	20.4	20.8	50,356
日立建機	102	104	281,320
クボタ	102	104	216,788
荏原製作所	20.4	20.8	61,360
ダイキン工業	102	104	2,343,120
日本精工	102	104	89,336
N T N	102	104	21,944
ジェイテクト	102	104	90,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立造船	20.4	20.8	8,798
三菱重工業	10.2	10.4	24,133
I H I	10.2	10.4	14,008
電気機器 (20.1%)			
日清紡ホールディングス	102	104	75,400
コニカミノルタ	102	104	28,496
ミネベアアツミ	102	104	195,000
日立製作所	20.4	20.8	74,692
三菱電機	102	104	141,440
富士電機	20.4	20.8	72,072
安川電機	102	104	450,320
オムロン	102	104	850,720
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20.4	20.8	40,851
日本電気	10.2	10.4	59,904
富士通	10.2	10.4	141,544
沖電気工業	10.2	10.4	9,984
セイコーエプソン	204	208	271,232
パナソニック	102	104	105,872
ソニー	102	104	958,880
T D K	102	104	1,385,280
アルプスアルパイン	102	104	150,280
横河電機	102	104	178,776
アドバンテスト	204	208	1,374,880
カシオ計算機	102	104	181,168
ファナック	102	104	2,381,600
京セラ	204	208	1,237,392
太陽誘電	102	104	421,720
S C R E E Nホールディングス	20.4	20.8	125,216
キヤノン	153	156	279,240
リコー	102	104	66,248
東京エレクトロン	102	104	3,113,240
輸送用機器 (4.1%)			
デンソー	102	104	521,352
三井E&Sホールディングス	10.2	10.4	3,879
川崎重工業	10.2	10.4	14,643
日産自動車	102	104	40,196
いすゞ自動車	51	52	47,424
トヨタ自動車	102	104	745,992
日野自動車	102	104	91,312
三菱自動車工業	10.2	10.4	1,955

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
マツダ	20.4	20.8	12,043	
本田技研工業	204	208	589,368	
スズキ	102	104	520,000	
S U B A R U	102	104	213,460	
ヤマハ発動機	102	104	162,344	
精密機器 (3.9%)				
テルモ	408	416	1,746,784	
ニコン	102	104	70,200	
オリンパス	408	416	926,432	
シチズン時計	102	104	29,120	
その他製品 (2.3%)				
パンダイナムコホールディングス	102	104	935,584	
凸版印刷	51	52	72,852	
大日本印刷	51	52	109,460	
ヤマハ	102	104	556,400	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	10.2	10.4	2,922	
中部電力	10.2	10.4	13,072	
関西電力	10.2	10.4	10,178	
東京瓦斯	20.4	20.8	51,459	
大阪瓦斯	20.4	20.8	42,411	
陸運業 (1.6%)				
東武鉄道	20.4	20.8	66,352	
東急	51	52	67,600	
小田急電鉄	51	52	144,768	
京王電鉄	20.4	20.8	140,192	
京成電鉄	51	52	167,700	
東日本旅客鉄道	10.2	10.4	57,501	
西日本旅客鉄道	10.2	10.4	46,976	
東海旅客鉄道	10.2	10.4	133,796	
日本通運	10.2	10.4	69,888	
ヤマトホールディングス	102	104	279,552	
海運業 (0.1%)				
日本郵船	10.2	10.4	21,340	
商船三井	10.2	10.4	26,208	
川崎汽船	10.2	10.4	15,319	
空運業 (0.0%)				
A N Aホールディングス	10.2	10.4	23,431	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	51	52	161,200	

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
情報・通信業 (12.8%)				
ネクソン	—	208	635,440	
Zホールディングス	40.8	41.6	27,601	
トレンドマイクロ	102	104	644,800	
スカパー J S A Tホールディングス	10.2	10.4	4,836	
日本電信電話	20.4	41.6	100,089	
K D D I	612	624	1,889,472	
ソフトバンク	—	104	128,648	
N T T ドコモ	10.2	10.4	40,456	
東宝	10.2	10.4	44,460	
エヌ・ティ・ティ・データ	510	520	709,280	
コナミホールディングス	102	104	527,280	
ソフトバンクグループ	612	624	4,419,792	
卸売業 (1.7%)				
双日	10.2	10.4	2,402	
伊藤忠商事	102	104	270,920	
丸紅	102	104	60,611	
豊田通商	102	104	338,000	
三井物産	102	104	179,192	
住友商事	102	104	130,000	
三菱商事	102	104	251,056	
小売業 (12.7%)				
J. フロント リテイリング	51	52	41,704	
三越伊勢丹ホールディングス	102	104	52,832	
セブン&アイ・ホールディングス	102	104	326,872	
ファミリーマート	408	—	—	
高島屋	51	52	41,392	
丸井グループ	102	104	202,384	
イオン	102	104	295,568	
ファーストリテイリング	102	104	8,144,240	
銀行業 (0.5%)				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	102	104	37,648	
新生銀行	10.2	10.4	13,956	
あおぞら銀行	10.2	10.4	18,262	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	102	104	44,512	
りそなホールディングス	10.2	10.4	3,668	
三井住友トラスト・ホールディングス	10.2	10.4	29,801	
三井住友フィナンシャルグループ	10.2	10.4	30,742	
千葉銀行	102	104	58,968	
ふくおかフィナンシャルグループ	20.4	20.8	38,355	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡銀行	102	104	75,504
みずほフィナンシャルグループ	102	10.4	13,998
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	102	104	45,479
野村ホールディングス	102	104	52,041
松井証券	102	104	90,064
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	25.5	26	104,182
MS&ADインシュアランスグループホール	30.6	31.2	92,788
ソニーフィナンシャルホールディングス	20.4	—	—
第一生命ホールディングス	10.2	10.4	16,619
東京海上ホールディングス	51	52	254,592
T&Dホールディングス	20.4	20.8	22,235
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	102	104	126,152
日本取引所グループ	—	104	262,392
不動産業 (1.1%)			
東急不動産ホールディングス	102	104	49,816

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
三井不動産	102	104	191,984	
三菱地所	102	104	173,316	
東京建物	51	52	66,040	
住友不動産	102	104	317,200	
サービス業 (7.2%)				
エムスリー	244.8	249.6	2,046,220	
ディー・エヌ・エー	30.6	31.2	57,720	
電通グループ	102	104	326,040	
サイバーエージェント	20.4	20.8	137,072	
楽天	102	104	116,064	
リクルートホールディングス	306	312	1,413,360	
日本郵政	102	104	76,960	
セコム	102	104	980,200	
合 計	株 数 ・ 金 額	18,293	18,777	71,638,698
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 97.5% >

*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	百万円 1,864	百万円 —
	日経225		

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年11月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	71,638,698	94.6
コール・ローン等、その他	4,052,532	5.4
投資信託財産総額	75,691,230	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 (2020年11月9日現在)

○損益の状況 (2019年11月8日～2020年11月9日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	75,691,230,255
コール・ローン等	740,496,984
株式(評価額)	71,638,698,560
未収入金	2,779,516,431
未収配当金	467,288,280
差入委託証拠金	65,230,000
(B) 負債	2,178,451,661
未払金	447,720
未払解約金	2,178,003,361
未払利息	580
(C) 純資産総額(A-B)	73,512,778,594
元本	46,853,905,347
次期繰越損益金	26,658,873,247
(D) 受益権総口数	46,853,905,347口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,690円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,283,974,046
受取配当金	1,284,611,472
受取利息	607
その他収益金	70,941
支払利息	△ 708,974
(B) 有価証券売買損益	6,237,373,012
売買益	11,744,223,121
売買損	△ 5,506,850,109
(C) 先物取引等取引損益	239,051,916
取引益	1,204,822,730
取引損	△ 965,770,814
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,760,398,974
(E) 前期繰越損益金	20,915,435,701
(F) 追加信託差損益金	10,733,139,393
(G) 解約差損益金	△12,750,100,821
(H) 計(D+E+F+G)	26,658,873,247
次期繰越損益金(H)	26,658,873,247

(注) 期首元本額は47,042,890,090円、期中追加設定元本額は29,728,503,560円、期中一部解約元本額は29,917,488,303円、1口当たり純資産額は1,5690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 22,788,019,657円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 12,587,732,700円
- ・野村つみたて日本株投資 3,836,707,944円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 3,628,819,163円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 1,751,673,149円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 927,269,583円
- ・野村日経225インデックス(野村SMA・EW向け) 737,498,051円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 482,632,480円
- ・野村PoFs用・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 113,552,620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。