

野村つみたて日本株投信

運用報告書(全体版)

第2期(決算日2019年5月13日)

作成対象期間(2018年5月15日～2019年5月13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	2017年10月2日以降、無期限とします。	
運用方針	ミリオンの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、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(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	野村つみたて日本株投信 マザーファンド	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。 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	野村つみたて日本株投信 マザーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。 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、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/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金	中期	日経平均株価 (日経225)	騰落率			
(設定日)	円	円	%	円	%	%	%	百万円
2017年10月2日	10,000	—	—	20,356	—	—	—	1
1期(2018年5月14日)	11,340	0	13.4	22,866	12.3	97.5	2.5	437
2期(2019年5月13日)	10,715	0	△ 5.5	21,191	△ 7.3	96.9	3.0	2,160

*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。

○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)	円	%	%	円	%	%	%
2018年5月14日	11,340	—	—	22,866	—	97.5	2.5
5月末	11,011	△ 2.9	△ 2.9	22,202	△ 2.9	97.5	2.5
6月末	11,076	△ 2.3	△ 2.5	22,305	△ 2.5	97.6	2.3
7月末	11,198	△ 1.3	△ 1.4	22,554	△ 1.4	96.9	3.0
8月末	11,356	0.1	△ 0.0	22,865	△ 0.0	98.7	1.3
9月末	12,057	6.3	5.5	24,120	5.5	97.4	2.6
10月末	10,965	△ 3.3	△ 4.1	21,920	△ 4.1	97.1	2.9
11月末	11,180	△ 1.4	△ 2.3	22,351	△ 2.3	98.6	1.4
12月末	10,031	△ 11.5	△ 12.5	20,015	△ 12.5	96.0	3.9
2019年1月末	10,411	△ 8.2	△ 9.2	20,773	△ 9.2	98.6	1.4
2月末	10,724	△ 5.4	△ 6.5	21,385	△ 6.5	98.5	1.5
3月末	10,718	△ 5.5	△ 7.3	21,206	△ 7.3	96.6	3.4
4月末	11,254	△ 0.8	△ 2.7	22,259	△ 2.7	96.9	3.1
(期末)							
2019年5月13日	10,715	△ 5.5	△ 7.3	21,191	△ 7.3	96.9	3.0

*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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：11,340円

期末：10,715円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 5.5% (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5月14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5月14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11,340円から期末10,715円に625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。

2018年9月中旬以降は、米中貿易摩擦への懸念が後退したこと、新興国市場への過度な不安感が解消されたこと、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。10月上旬以降は、再度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、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和らぎ、米国株式市場が上昇したことなどを受けて、上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村つみたて日本株投信]

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(日経225)の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価(日経225)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(日経225)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。

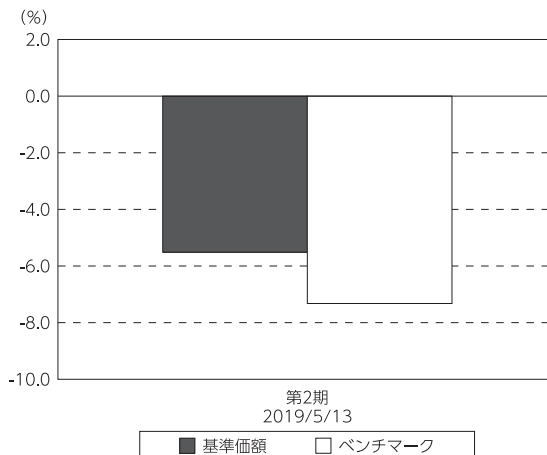
○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-5.5%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の-7.3%を1.8ポイント上回りました。

(主な差異要因)

- ・保有銘柄が配当権利落ちし、ファンドには未収配当金が計上されたこと
- ・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います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項目	第2期
	2018年5月15日～ 2019年5月13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	715

(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

【野村つみたて日本株投信】

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（日経225）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（日経225）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5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 20	% 0.183	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.081)	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)	(9)	(0.081)	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)	(2)	(0.022)	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	0.004	(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)	(0)	(0.004)	
(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	20	0.190	
期中の平均基準価額は、10,998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

(2018年5月15日～2019年5月13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	千口 1,351,715	千円 1,792,923	千口 6,957	千円 9,290

* 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2018年5月15日～2019年5月13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	61,043,006千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	64,918,550千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.94	

* (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5月15日～2019年5月13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 28	百万円 21	百万円 41

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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2018年5月15日～2019年5月13日)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2019年5月13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 318,770	千口 1,663,528	千円 2,160,590

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2019年5月13日現在)

○投資信託財産の構成

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	2,160,590	99.9
コール・ローン等、その他	2,931	0.1
投資信託財産総額	2,163,521	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5月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,163,521,264
コール・ローン等	2,930,534
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	2,160,590,730
(B) 負債	2,713,483
未払解約金	1,167,691
未払信託報酬	1,519,037
未払利息	3
その他未払費用	26,752
(C) 純資産総額(A-B)	2,160,807,781
元本	2,016,565,167
次期繰越損益金	144,242,614
(D) 受益権総口数	2,016,565,167口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,715円

(注) 期首元本額は385,706,916円、期中追加設定元本額は1,678,921,052円、期中一部解約元本額は48,062,801円、1口当たり純資産額は1.0715円です。

○損益の状況 (2018年5月15日～2019年5月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 646
支払利息	△ 646
(B) 有価証券売買損益	△ 59,584,322
売買益	1,142,523
売買損	△ 60,726,845
(C) 信託報酬等	△ 2,325,324
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 61,910,292
(E) 前期繰越損益金	13,725,955
(F) 追加信託差損益金	192,426,951
(配当等相当額)	(64,959,915)
(売買損益相当額)	(127,467,036)
(G) 計(D+E+F)	144,242,614
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	144,242,614
追加信託差損益金	192,426,951
(配当等相当額)	(68,111,006)
(売買損益相当額)	(124,315,945)
分配準備積立金	40,216,512
繰越損益金	△ 88,400,849

*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5月15日～2019年5月13日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年5月15日～ 2019年5月13日
a. 配当等収益(経費控除後)	26,490,557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	104,026,102円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	13,725,955円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	144,242,614円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	715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

(2019年5月13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(50,886,399千口)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	98	111		79,920
マルハニチロ	9.8	11.1		37,851
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	39.2	44.4		44,555
建設業 (2.3%)				
コムシスホールディングス	98	111		304,806
大成建設	19.6	22.2		107,004
大林組	98	111		116,550
清水建設	98	111		110,001
長谷工コーポレーション	19.6	22.2		26,151
鹿島建設	98	55.5		88,633
大和ハウス工業	98	111		335,220
積水ハウス	98	111		193,140
日揮	98	111		145,854
千代田化工建設	98	111		30,525
食料品 (4.4%)				
日清製粉グループ本社	98	111		277,167
明治ホールディングス	19.6	22.2		183,594
日本ハム	49	55.5		243,090
サッポロホールディングス	19.6	22.2		49,306
アサヒグループホールディングス	98	111		514,929
キリンホールディングス	98	111		247,197
宝ホールディングス	98	111		131,535
キッコーマン	98	111		558,330
味の素	98	111		213,453
ニチレイ	49	55.5		141,525
日本たばこ産業	98	111		275,446
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	9.8	11.1		14,263
ユニチカ	9.8	11.1		4,484
帝人	19.6	22.2		39,804
東レ	98	111		77,489

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
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	98	111		65,712
日本製紙	9.8	11.1		23,709
化学 (8.5%)				
クラレ	98	111		149,961
旭化成	98	111		127,761
昭和電工	9.8	11.1		34,021
住友化学	98	111		55,833
日産化学	98	111		520,590
東ソー	49	55.5		83,805
トクヤマ	19.6	22.2		58,164
デンカ	19.6	22.2		71,151
信越化学工業	98	111		1,053,723
三井化学	19.6	22.2		54,922
三菱ケミカルホールディングス	49	55.5		39,676
宇部興産	9.8	11.1		23,143
日本化薬	98	111		138,306
花王	98	111		937,839
D I C	—	11.1		32,367
富士フイルムホールディングス	98	111		575,868
資生堂	98	111		912,642
日東電工	98	111		579,309
医薬品 (7.8%)				
協和発酵キリン	98	111		221,112
武田薬品工業	98	111		479,298
アステラス製薬	490	555		805,582
大日本住友製薬	98	111		272,616
塩野義製薬	98	111		717,948
中外製薬	98	111		775,890
エーザイ	98	111		707,847
第一三共	98	111		608,724
大塚ホールディングス	98	111		429,459

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	98	—	—
出光興産	—	44.4	143,634
J X T Gホールディングス	98	111	59,496
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	49	55.5	106,560
ブリヂストン	98	111	465,867
ガラス・土石製品 (1.2%)			
A G C	19.6	22.2	78,699
日本板硝子	9.8	11.1	8,802
日本電気硝子	29.4	33.3	92,241
住友大阪セメント	98	11.1	48,784
太平洋セメント	9.8	11.1	36,963
東海カーボン	98	111	122,211
T O T O	49	55.5	215,895
日本硝子	98	111	175,380
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	9.8	11.1	20,435
神戸製鋼所	9.8	11.1	8,014
ジェイ エフ イー ホールディングス	9.8	11.1	19,508
日新製鋼	9.8	—	—
大太平洋金属	9.8	11.1	24,331
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	98	111	25,530
三井金属鉱業	9.8	11.1	28,638
東邦亜鉛	9.8	11.1	27,328
三菱マテリアル	9.8	11.1	29,292
住友金属鉱山	49	55.5	160,367
D O W Aホールディングス	19.6	22.2	76,923
古河機械金属	9.8	—	—
古河電気工業	9.8	11.1	28,804
住友電気工業	98	111	152,181
フジクラ	98	111	45,954
金属製品 (0.4%)			
S U M C O	9.8	11.1	14,607
東洋製鐵グループホールディングス	98	111	243,090
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	19.6	22.2	40,515
オークマ	19.6	22.2	131,202
アマダホールディングス	98	111	125,985

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小松製作所	98	111	263,514
住友重機械工業	19.6	22.2	78,144
日立建機	98	111	286,047
クボタ	98	111	184,038
住原製作所	19.6	22.2	68,820
ダイキン工業	98	111	1,500,720
日本精工	98	111	106,560
N T N	98	111	35,520
ジェイテクト	98	111	137,196
日立造船	19.6	22.2	8,036
三菱重工業	9.8	11.1	51,148
I H I	9.8	11.1	24,575
電気機器 (18.2%)			
日清紡ホールディングス	98	111	89,133
コニカミノルタ	98	111	118,659
ミネベアミツミ	98	111	198,801
日立製作所	98	22.2	82,273
三菱電機	98	111	160,894
富士電機	98	22.2	80,364
安川電機	98	111	405,705
オムロン	—	111	611,610
ジーエス・ユアサ コーポレーション	98	22.2	45,021
日本電気	9.8	11.1	42,457
富士通	98	11.1	80,563
沖電気工業	9.8	11.1	14,740
セイコーエプソン	196	222	366,300
パナソニック	98	111	99,012
ソニー	98	111	596,181
T D K	98	111	1,021,200
アルプスアルパイン	98	111	226,773
パイオニア	98	—	—
横河電機	98	111	235,653
アドバンテスト	196	222	634,698
カシオ計算機	98	111	147,963
ファナック	98	111	2,113,995
京セラ	196	222	1,530,690
太陽誘電	98	111	239,205
S C R E E Nホールディングス	19.6	22.2	103,674
キヤノン	147	166.5	506,826
リコー	98	111	114,774

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン	98	111	1,805,970
輸送用機器 (5.1%)			
デンソー	98	111	489,954
三井E&Sホールディングス	9.8	11.1	10,045
川崎重工業	9.8	11.1	27,017
日産自動車	98	111	96,092
いすゞ自動車	49	55.5	79,836
トヨタ自動車	98	111	726,495
日野自動車	98	111	105,006
三菱自動車工業	9.8	11.1	5,572
マツダ	19.6	22.2	27,661
本田技研工業	196	222	625,263
スズキ	98	111	562,215
SUBARU	98	111	284,715
ヤマハ発動機	98	111	211,899
精密機器 (3.3%)			
テルモ	196	444	1,318,680
ニコン	98	111	158,508
オリンパス	98	444	550,560
シチズン時計	98	111	63,825
その他製品 (1.3%)			
凸版印刷	98	55.5	94,960
大日本印刷	49	55.5	136,696
ヤマハ	98	111	590,520
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	9.8	11.1	6,515
中部電力	9.8	11.1	17,499
関西電力	9.8	11.1	14,208
東京瓦斯	19.6	22.2	60,073
大阪瓦斯	19.6	22.2	42,957
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	19.6	22.2	68,931
東京急行電鉄	49	55.5	99,567
小田急電鉄	49	55.5	145,743
京王電鉄	19.6	22.2	158,064
京成電鉄	49	55.5	210,900
東日本旅客鉄道	9.8	11.1	109,501
西日本旅客鉄道	9.8	11.1	92,052
東海旅客鉄道	9.8	11.1	246,420
日本通運	9.8	11.1	61,494

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマトホールディングス	98	111	258,907
海運業 (0.1%)			
日本郵船	9.8	11.1	19,003
商船三井	9.8	11.1	28,371
川崎汽船	9.8	11.1	15,928
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	9.8	11.1	40,859
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	49	55.5	165,279
情報・通信業 (11.4%)			
ヤフー	39.2	44.4	14,607
トレンドマイクロ	98	111	570,540
スカパーJ S A Tホールディングス	9.8	11.1	4,662
日本電信電話	19.6	22.2	106,005
KDD I	588	666	1,742,589
NTTドコモ	9.8	11.1	27,061
東宝	9.8	11.1	50,172
エヌ・ティ・ティ・データ	490	555	690,975
コナミホールディングス	98	111	559,440
ソフトバンクグループ	294	333	3,519,810
卸売業 (2.1%)			
双日	9.8	11.1	3,885
伊藤忠商事	98	111	219,225
丸紅	98	111	78,765
豊田通商	98	111	367,410
三井物産	98	111	183,205
住友商事	98	111	173,937
三菱商事	98	111	316,960
小売業 (14.8%)			
J・フロント リテイリング	49	55.5	69,375
三越伊勢丹ホールディングス	98	111	105,117
セブン&アイ・ホールディングス	98	111	410,922
ユニー・ファミリーマートホールディングス	98	444	1,225,440
高島屋	98	55.5	65,823
丸井グループ	98	111	236,097
イオン	98	111	217,504
ファーストリテイリング	98	111	7,149,510
銀行業 (0.7%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	98	111	45,399
新生銀行	9.8	11.1	16,539

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あおぞら銀行	9.8	11.1	28,682
三菱UFJフィナンシャル・グループ	98	111	56,898
りそなホールディングス	9.8	11.1	5,083
三井住友トラスト・ホールディングス	9.8	11.1	41,414
三井住友フィナンシャルグループ	9.8	11.1	42,646
千葉銀行	98	111	60,606
ふくおかフィナンシャルグループ	98	22.2	54,168
静岡銀行	98	111	89,688
みずほフィナンシャルグループ	98	111	18,381
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	98	111	54,456
野村ホールディングス	98	111	41,691
松井証券	98	111	112,554
保険業 (1.0%)			
SOMPOホールディングス	24.5	27.7	117,974
MS&ADインシュアランスグループホール	29.4	33.3	110,589
ソニーフィナンシャルホールディングス	19.6	22.2	50,083
第一生命ホールディングス	9.8	11.1	16,960
東京海上ホールディングス	49	55.5	301,420
T&Dホールディングス	19.6	22.2	25,907
その他金融業 (0.2%)			
クレディセゾン	98	111	148,962

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	98	111	69,042	
三井不動産	98	111	277,666	
三菱地所	98	111	205,794	
東京建物	49	55.5	65,712	
住友不動産	98	111	441,336	
サービス業 (4.8%)				
ディー・エヌ・エー	29.4	33.3	67,299	
電通	98	111	491,730	
サイバーエージェント	—	22.2	100,122	
楽天	98	111	124,209	
リクルートホールディングス	294	333	1,090,908	
日本郵政	98	111	134,643	
東京ドーム	49	55.5	59,884	
セコム	98	111	1,038,738	
合 計	株数・金額	16,998	19,363	64,067,532
	銘柄数<比率>	225	225	<96.9%>

*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 2,011	百万円 —
	日経225		

*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

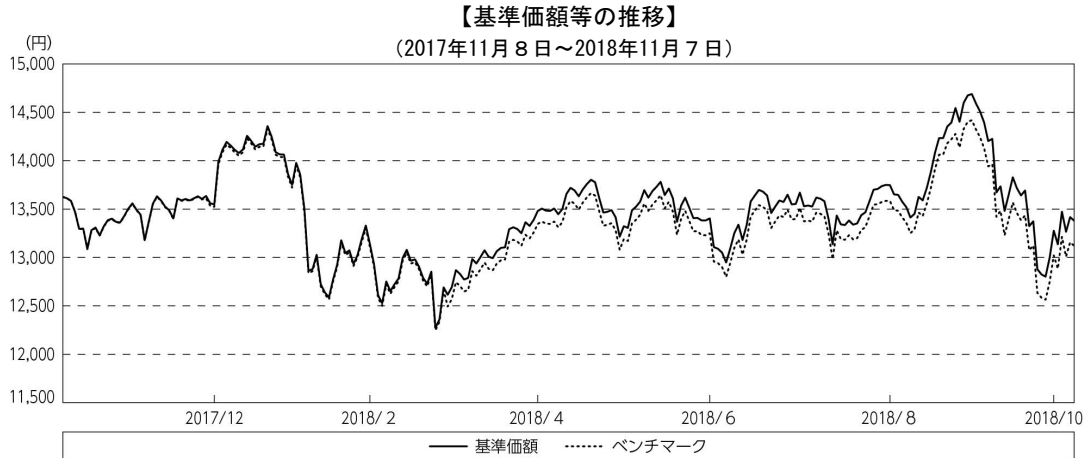
*騰落率は期首比です。

*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

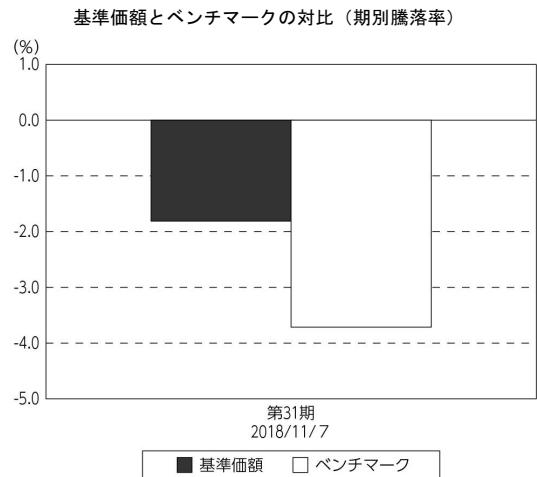
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

○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。

○株式売買比率

(2017年11月8日～2018年11月7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	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%)					富士フィ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	株 数	評 価 額
	千株	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	
東洋製織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	株 数	評 価 額
	千株	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	
SCREEN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%)			
コンコルディア・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	額
国内	株式先物取引	日経225	百万円	百万円
		2,411	—	—

*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	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。