

野村つみたて日本株投信

運用報告書(全体版)

第5期（決算日2022年5月12日）

作成対象期間（2021年5月13日～2022年5月12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ないます。	
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	野村つみたて日本株投信	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、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ないます。	

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/>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
		税 込 分	騰 落 率	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
3期(2020年5月12日)	10,517	0	△ 1.8	20,366	△ 3.9	96.8	3.2	4,011
4期(2021年5月12日)	14,725	0	40.0	28,148	38.2	96.4	3.6	7,680
5期(2022年5月12日)	13,681	0	△ 7.1	25,749	△ 8.5	96.0	3.9	9,373

*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		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
		騰 落 率	率	日経平均株価 (日経225)	騰 落 率		
(期 首)	円	%		円	%	%	%
2021年5月12日	14,725	—		28,148	—	96.4	3.6
5月末	15,100	2.5		28,860	2.5	97.5	2.5
6月末	15,066	2.3		28,792	2.3	97.8	2.2
7月末	14,271	△3.1		27,284	△3.1	97.2	2.8
8月末	14,697	△0.2		28,090	△0.2	97.5	2.4
9月末	15,497	5.2		29,453	4.6	96.2	3.8
10月末	15,200	3.2		28,893	2.6	97.5	2.4
11月末	14,635	△0.6		27,822	△1.2	96.4	3.5
12月末	15,169	3.0		28,792	2.3	98.9	1.1
2022年1月末	14,217	△3.4		27,002	△4.1	97.5	2.5
2月末	13,973	△5.1		26,527	△5.8	97.4	2.6
3月末	14,776	0.3		27,821	△1.2	96.7	3.3
4月末	14,259	△3.2		26,848	△4.6	97.0	3.0
(期 末)							
2022年5月12日	13,681	△7.1		25,749	△8.5	96.0	3.9

*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：14,725円

期 末：13,681円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 7.1% (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(2021年5月12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(2021年5月12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、期首より国内企業の2021年度業績見通しの上方修正が一巡し株式市場全体を大きく押し上げる要因とはならなかったことや国内の新型コロナウイルス変異株による感染再拡大などが懸念材料となり横ばいで推移しました。

2021年9月に入ると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が、9月下旬以降は岸田新政権に対する期待が後退したことなどから下落しました。10月以降は、原油価格や米長期金利上昇が一服し過度なインフレ懸念が落ち着いた一方で、新型コロナウイルスの新たな変異株で感染力が高いと思われるオミクロン株への懸念が高まったことなどから一進一退の展開となりました。

2022年1月には、前年12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）の議事要旨において、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げや資産圧縮が早期に進むとの見方が広がったことで、米長期金利が上昇したことなどから下落しました。2月下旬にはロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて大きく下落しました。3月中旬以降は、原油価格上昇が一服したことやロシアとウクライナの和平交渉が進展するとの期待が高まったことなどから上昇しましたが、4月以降は、米金融政策の引き締め加速への警戒感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、個別銘柄の株数の比率がポートフォリオと日経平均株価（日経225）で同水準になるように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。

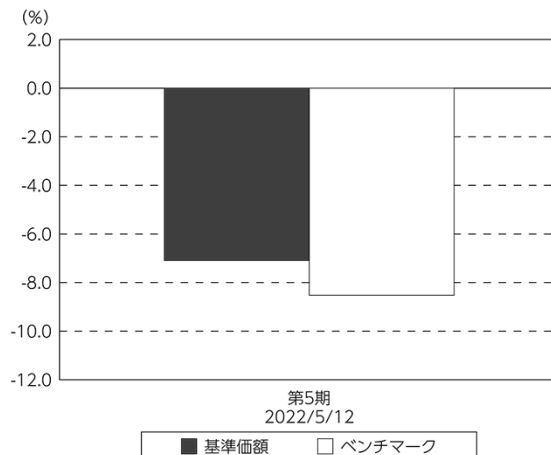
○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－7.1%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の－8.5%を1.4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、1万円当たり・税込み）

項 目	第 5 期
	2021年 5 月13日～ 2022年 5 月12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	3,812

（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み入れ、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

(2021年 5 月13日～2022年 5 月12日)

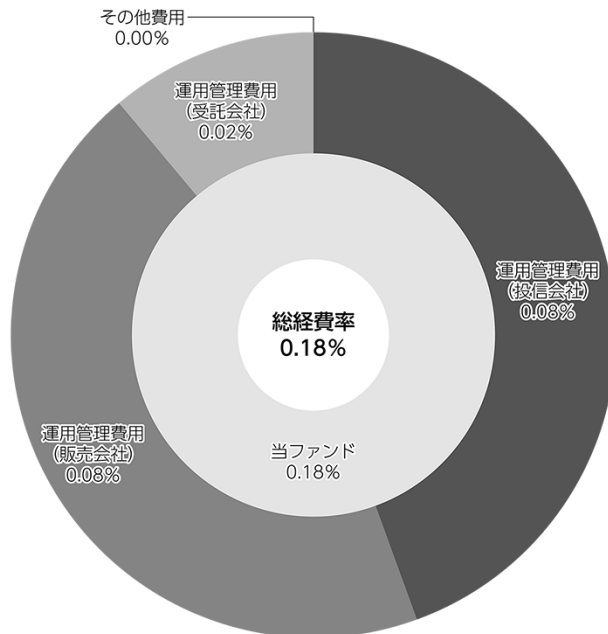
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 28	% 0.187	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(12)	(0.083)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(12)	(0.083)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.003	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.003)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	29	0.193	
期中の平均基準価額は、14,738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0.18%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

(2021年5月13日～2022年5月12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
	千口	千円	千口	千円
ミリオン・インデックスマザーファンド	1,460,755	2,631,506	127,036	230,259

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年5月13日～2022年5月12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	64,618,051千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	93,548,435千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69

*(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

(2021年5月13日～2022年5月12日)

利害関係人との取引状況

<野村つみたて日本株投信>

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			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	43,099	2,211	5.1	21,518	242	1.1

平均保有割合 9.2%

※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 27	百万円 14	百万円 61

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2022年5月12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 4, 286, 565	千口 5, 620, 284	千円 9, 372, 948

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年5月12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 9, 372, 948	% 99. 8
コール・ローン等、その他	16, 439	0. 2
投資信託財産総額	9, 389, 387	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 (2022年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,389,387,217
コール・ローン等	12,543,748
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	9,372,948,088
未収入金	3,895,381
(B) 負債	15,485,798
未払解約金	6,686,555
未払信託報酬	8,646,714
未払利息	1
その他未払費用	152,528
(C) 純資産総額(A－B)	9,373,901,419
元本	6,852,009,868
次期繰越損益金	2,521,891,551
(D) 受益権総口数	6,852,009,868口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,681円

(注) 期首元本額は5,216,103,711円、期中追加設定元本額は1,922,782,921円、期中一部解約元本額は286,876,764円、1口当たり純資産額は1.3681円です。

○損益の状況 (2021年5月13日～2022年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,448
支払利息	△ 1,448
(B) 有価証券売買損益	△ 710,465,563
売買益	9,759,841
売買損	△ 720,225,404
(C) 信託報酬等	△ 16,877,950
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 727,344,961
(E) 前期繰越損益金	1,508,935,788
(F) 追加信託差損益金	1,740,300,724
(配当等相当額)	(943,610,538)
(売買損益相当額)	(796,690,186)
(G) 計(D＋E＋F)	2,521,891,551
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	2,521,891,551
追加信託差損益金	1,740,300,724
(配当等相当額)	(948,186,995)
(売買損益相当額)	(792,113,729)
分配準備積立金	1,664,196,579
繰越損益金	△ 882,605,752

* 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(2021年5月13日～2022年5月12日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年5月13日～ 2022年5月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	155,260,791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	948,186,995円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,508,935,788円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	2,612,383,574円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,812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34期（決算日2021年11月8日）

作成対象期間（2020年11月10日～2021年11月8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ないます。 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ないます。 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ないます。 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 率	中 率	日 経 平 均 株 価	騰 落 率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
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
34期(2021年11月 8 日)	18, 908	20. 5	29, 507	18. 8	97. 9	2. 1	97, 537

* 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	率	日 経 平 均 株 価	騰 落 率		
(期 首)	円	%	円	%	%	%
2020年11月 9 日	15, 690	—	24, 840	—	97. 5	2. 5
11月末	16, 699	6. 4	26, 434	6. 4	98. 1	1. 8
12月末	17, 360	10. 6	27, 444	10. 5	98. 8	1. 2
2021年 1 月末	17, 499	11. 5	27, 663	11. 4	97. 1	2. 9
2 月末	18, 333	16. 8	28, 966	16. 6	97. 7	2. 2
3 月末	18, 567	18. 3	29, 179	17. 5	96. 7	3. 3
4 月末	18, 337	16. 9	28, 813	16. 0	97. 9	2. 1
5 月末	18, 375	17. 1	28, 860	16. 2	97. 5	2. 5
6 月末	18, 336	16. 9	28, 792	15. 9	97. 8	2. 2
7 月末	17, 371	10. 7	27, 284	9. 8	97. 2	2. 8
8 月末	17, 892	14. 0	28, 090	13. 1	97. 5	2. 4
9 月末	18, 869	20. 3	29, 453	18. 6	96. 2	3. 8
10月末	18, 511	18. 0	28, 893	16. 3	97. 6	2. 4
(期 末)						
2021年11月 8 日	18, 908	20. 5	29, 507	18. 8	97. 9	2. 1

* 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3月下旬以降は、新型コロナウイルス変異株の感染再拡大による景気減速懸念などから軟調に推移しました。9月上旬に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が、9月下旬以降は米中景気先行き不安や岸田新政権に対する期待が後退したことなどから下落しました。10月中旬以降は、原油価格や米長期金利上昇が一服し過度なインフレ懸念が落ち着いたことなどから上昇しました。

○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

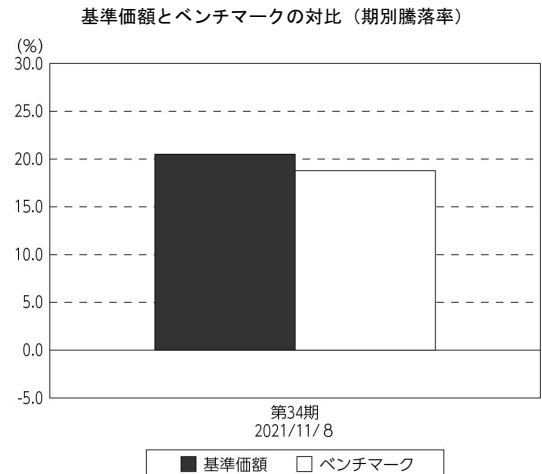
日経平均株価（日経225）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の株数の比率がポートフォリオと日経平均株価（日経225）で同水準になるように投資を行ないました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行ないました。

○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+20.5%となり、ベンチマークである日経平均株価の+18.8%を1.7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（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

(2020年11月10日～2021年11月8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	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.003)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、18,012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

(2020年11月10日～2021年11月8日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 7,522 (713)	千円 33,958,632 (-)	千株 5,706	千円 24,372,308

*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 85,206	百万円 85,236	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年11月10日～2021年11月8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	58,330,940千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	84,774,077千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68

* (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11月10日～2021年11月8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 33,958	百万円 2,351	% 6.9	百万円 24,372	百万円 281	% 1.2

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 22	百万円 17	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。

○組入資産の明細

(2021年11月8日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	104	114	71,706
マルハニチロ	10.4	11.4	29,503
鉱業 (0.0%)			
I N P E X	41.6	45.6	44,232
建設業 (1.6%)			
コムシスホールディングス	104	114	324,216
大成建設	20.8	22.8	79,002
大林組	104	114	102,600
清水建設	104	114	92,226
長谷工コーポレーション	20.8	22.8	34,564
鹿島建設	52	57	77,463
大和ハウス工業	104	114	412,110
積水ハウス	104	114	274,683
日揮ホールディングス	104	114	125,286
食料品 (3.7%)			
日清製粉グループ本社	104	114	199,614
明治ホールディングス	20.8	22.8	163,020
日本ハム	52	57	231,990
サッポロホールディングス	20.8	22.8	56,019
アサヒグループホールディングス	104	114	590,520
キリンホールディングス	104	114	228,684
宝ホールディングス	104	114	175,104
キッコーマン	104	114	1,076,160
味の素	104	114	388,284
ニチレイ	52	57	155,154
日本たばこ産業	104	114	267,216
繊維製品 (0.2%)			
東洋紡	10.4	11.4	15,629
ユニチカ	10.4	11.4	4,069
帝人	20.8	22.8	34,086
東レ	104	114	86,343
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	104	114	65,208
日本製紙	10.4	11.4	13,360

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (7.8%)			
クラレ	104	114	119,016
旭化成	104	114	133,494
昭和電工	10.4	11.4	32,136
住友化学	104	114	66,462
日産化学	104	114	745,560
東ソー	52	57	103,455
トクヤマ	20.8	22.8	46,101
デンカ	20.8	22.8	84,018
信越化学工業	104	114	2,306,220
三井化学	20.8	22.8	77,976
三菱ケミカルホールディングス	52	57	53,882
宇部興産	10.4	11.4	24,156
花王	104	114	719,340
D I C	10.4	11.4	34,770
富士フイルムホールディングス	104	114	1,037,856
資生堂	104	114	892,050
日東電工	104	114	1,003,200
医薬品 (7.1%)			
協和キリン	104	114	432,060
武田薬品工業	104	114	370,044
アステラス製薬	520	570	1,131,165
大日本住友製薬	104	114	177,270
塩野義製薬	104	114	807,918
中外製薬	312	342	1,402,200
エーザイ	104	114	947,910
第一三共	312	342	954,522
大塚ホールディングス	104	114	512,886
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	41.6	45.6	143,868
E N E O Sホールディングス	104	114	53,089
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	52	57	116,109
ブリヂストン	104	114	588,012

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 (1.0%)			
A G C	20.8	22.8	132,240
日本板硝子	10.4	11.4	6,919
日本電気硝子	31.2	34.2	93,605
住友大阪セメント	10.4	11.4	38,361
太平洋セメント	10.4	11.4	28,112
東海カーボン	104	114	155,154
T O T O	52	57	308,940
日本碍子	104	114	223,554
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	10.4	11.4	21,865
神戸製鋼所	10.4	11.4	6,942
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.4	11.4	17,100
大太平洋金属	10.4	11.4	24,282
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	10.4	11.4	20,805
三井金属鉱業	10.4	11.4	36,537
東邦亜鉛	10.4	11.4	33,481
三菱マテリアル	10.4	11.4	25,216
住友金属鉱山	52	57	252,738
DOWAホールディングス	20.8	22.8	109,326
古河電気工業	10.4	11.4	28,123
住友電気工業	104	114	173,736
フジクラ	104	114	70,680
金属製品 (0.0%)			
S U M C O	10.4	11.4	27,667
東洋製罐グループホールディングス	104	—	—
機械 (5.1%)			
日本製鋼所	20.8	22.8	78,774
オークマ	20.8	22.8	124,716
アマダ	104	114	131,898
小松製作所	104	114	353,742
住友重機械工業	20.8	22.8	67,260
日立建機	104	114	423,510
クボタ	104	114	260,490
荏原製作所	20.8	22.8	147,516
ダイキン工業	104	114	2,912,700
日本精工	104	114	87,780
N T N	104	114	26,904
ジェイテクト	104	114	118,446

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E&Sホールディングス	—	11.4	5,027
日立造船	20.8	22.8	19,950
三菱重工業	10.4	11.4	33,282
I H I	10.4	11.4	32,501
電気機器 (24.9%)			
日清紡ホールディングス	104	—	—
コニカミノルタ	104	114	58,710
ミネベアミツミ	104	114	357,960
日立製作所	20.8	22.8	162,130
三菱電機	104	114	174,876
富士電機	20.8	22.8	130,188
安川電機	104	114	584,820
オムロン	104	114	1,310,430
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20.8	22.8	51,619
日本電気	10.4	11.4	64,410
富士通	10.4	11.4	235,752
沖電気工業	10.4	11.4	11,286
セイコーエプソン	208	228	452,124
パナソニック	104	114	156,009
シャープ	—	114	151,620
ソニーグループ	104	114	1,594,290
T D K	104	342	1,516,770
アルプスアルパイン	104	114	128,820
横河電機	104	114	265,506
アドバンテスト	208	228	2,295,960
キーエンス	—	11.4	826,044
カシオ計算機	104	114	182,400
ファナック	104	114	2,579,820
京セラ	208	228	1,630,200
太陽誘電	104	114	674,880
村田製作所	—	91.2	771,643
S C R E E Nホールディングス	20.8	22.8	259,008
キヤノン	156	171	445,540
リコー	104	114	123,348
東京エレクトロン	104	114	6,533,340
輸送用機器 (4.6%)			
デンソー	104	114	946,314
三井E&Sホールディングス	10.4	—	—
川崎重工業	10.4	11.4	26,527
日産自動車	104	114	67,396

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
いすゞ自動車	52	57	90,801
トヨタ自動車	104	570	1,155,960
日野自動車	104	114	125,856
三菱自動車工業	10.4	11.4	4,218
マツダ	20.8	22.8	23,415
本田技研工業	208	228	751,260
スズキ	104	114	620,844
S U B A R U	104	114	252,282
ヤマハ発動機	104	114	347,700
精密機器 (3.8%)			
テルモ	416	456	2,229,384
ニコン	104	114	141,588
オリンパス	416	456	1,211,364
シチズン時計	104	114	56,544
その他製品 (2.8%)			
パンダイナムコホールディングス	104	114	1,055,868
凸版印刷	52	57	104,880
大日本印刷	52	57	162,963
ヤマハ	104	114	743,280
任天堂	—	11.4	561,564
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	10.4	11.4	3,511
中部電力	10.4	11.4	12,996
関西電力	10.4	11.4	11,970
東京瓦斯	20.8	22.8	45,668
大阪瓦斯	20.8	22.8	41,906
陸運業 (1.5%)			
東武鉄道	20.8	22.8	65,139
東急	52	57	95,361
小田急電鉄	52	57	136,458
京王電鉄	20.8	22.8	126,768
京成電鉄	52	57	213,180
東日本旅客鉄道	10.4	11.4	83,641
西日本旅客鉄道	10.4	11.4	64,068
東海旅客鉄道	10.4	11.4	200,298
日本通運	10.4	11.4	82,194
ヤマトホールディングス	104	114	317,262
海運業 (0.2%)			
日本郵船	10.4	11.4	88,122
商船三井	10.4	11.4	79,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	10.4	11.4	58,482
空運業 (0.0%)			
A N Aホールディングス	10.4	11.4	32,957
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	52	57	177,840
情報・通信業 (10.8%)			
ネクソン	208	228	482,676
Zホールディングス	41.6	45.6	35,796
トレンドマイクロ	104	114	743,280
スカパー J S A Tホールディングス	10.4	—	—
日本電信電話	41.6	45.6	147,014
K D D I	624	684	2,322,864
ソフトバンク	104	114	170,031
N T T ドコモ	10.4	—	—
東宝	10.4	11.4	63,840
エヌ・ティ・ティ・データ	520	570	1,356,600
コナミホールディングス	104	114	743,280
ソフトバンクグループ	624	684	4,214,124
卸売業 (2.1%)			
双日	10.4	11.4	19,630
伊藤忠商事	104	114	393,186
丸紅	104	114	118,275
豊田通商	104	114	603,060
三井物産	104	114	289,560
住友商事	104	114	189,867
三菱商事	104	114	391,590
小売業 (10.8%)			
J・フロント リテイリング	52	57	63,327
三越伊勢丹ホールディングス	104	114	101,574
セブン&アイ・ホールディングス	104	114	568,518
高島屋	52	57	66,633
丸井グループ	104	114	262,428
イオン	104	114	306,831
ファーストリテイリング	104	114	8,950,140
銀行業 (0.5%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	104	114	51,870
新生銀行	10.4	11.4	19,938
あおぞら銀行	10.4	11.4	30,403
三菱U F Jフィナンシャル・グループ	104	114	72,732
りそなホールディングス	10.4	11.4	4,987

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	10.4	11.4	44,505
三井住友フィナンシャルグループ	10.4	11.4	43,878
千葉銀行	104	114	81,966
ふくおかフィナンシャルグループ	20.8	22.8	47,834
静岡銀行	104	114	105,336
みずほフィナンシャルグループ	10.4	11.4	17,635
証券・商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	104	114	74,031
野村ホールディングス	104	114	58,185
松井証券	104	114	92,682
保険業 (0.7%)			
S O M P Oホールディングス	26	22.8	112,198
MS&ADインシュアランスグループホール	31.2	34.2	126,745
第一生命ホールディングス	10.4	11.4	27,787
東京海上ホールディングス	52	57	342,057
T & Dホールディングス	20.8	22.8	32,809
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	104	114	161,880
日本取引所グループ	104	114	294,633

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 (1.2%)			
東急不動産ホールディングス	104	114	73,074
三井不動産	104	114	305,178
三菱地所	104	114	196,935
東京建物	52	57	95,019
住友不動産	104	114	468,654
サービス業 (6.6%)			
エムスリー	249.6	273.6	1,736,265
ディー・エヌ・エー	31.2	34.2	74,077
電通グループ	104	114	503,880
サイバーエージェント	20.8	91.2	182,491
楽天グループ	104	114	141,132
リクルートホールディングス	312	342	2,701,458
日本郵政	104	114	97,242
セコム	104	114	875,748
合 計	株 数 ・ 金 額	18,777	21,306
	銘柄数 < 比率 >	225	225 < 97.9% >

*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、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 2 2 5	百万円 2,064	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年11月8日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	95,441,204	97.0
コール・ローン等、その他	3,002,242	3.0
投資信託財産総額	98,443,446	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11月8日現在)

○損益の状況 (2020年11月10日～2021年11月8日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	98,437,571,426
コール・ローン等	2,292,093,026
株式(評価額)	95,441,204,700
未収配当金	614,513,700
差入委託証拠金	89,760,000
(B) 負債	900,056,769
未払金	11,734,650
未払解約金	888,320,117
未払利息	2,002
(C) 純資産総額(A－B)	97,537,514,657
元本	51,585,018,494
次期繰越損益金	45,952,496,163
(D) 受益権総口数	51,585,018,494口
1万口当たり基準価額(C／D)	18,908円

(注) 期首元本額は46,853,905,347円、期中追加設定元本額は34,261,665,188円、期中一部解約元本額は29,530,552,041円、1口当たり純資産額は1.8908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 27,702,078,805円
- ・ミリオン（インデックスポートフォリオ）10,874,988,689円
- ・野村つみたて日本株投信 4,931,637,883円
- ・野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）4,188,498,041円
- ・日経225インデックスファンド（適格機関投資家専用）1,723,102,610円
- ・野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）932,789,605円
- ・日経225インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）775,946,610円
- ・ミリオン（バランスポートフォリオ）374,945,816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）81,030,435円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,420,404,292
受取配当金	1,421,039,256
受取利息	9
その他収益金	27,312
支払利息	△ 662,285
(B) 有価証券売買損益	14,216,181,333
売買益	17,390,966,693
売買損	△ 3,174,785,360
(C) 先物取引等取引損益	229,678,682
取引益	1,136,612,824
取引損	△ 906,934,142
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	15,866,264,307
(E) 前期繰越損益金	26,658,873,247
(F) 追加信託差損益金	27,709,665,638
(G) 解約差損益金	△24,282,307,029
(H) 計(D＋E＋F＋G)	45,952,496,163
次期繰越損益金(H)	45,952,496,163

* 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(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。