

# 野村日経225インデックス (野村SMA・EW向け)

## 運用報告書(全体版)

第1期(決算日2020年6月8日)

作成対象期間(2020年2月25日～2020年6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。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型	
信託期間	2020年2月25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、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	野村日経225インデックス(野村SMA・EW向け)	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等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	野村日経225インデックス(野村SMA・EW向け)	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			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	日経平均株価 (日経225)	期中 騰落 率			
(設定日) 2020年2月25日	円 10,000	円 —	% —	円 23,387	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2020年6月8日)	10,013	0	0.1	23,178	△0.9	98.1	1.8	150

\*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	日経平均株価 (日経225)	騰落率	日経平均株価 (日経225)		
(設定日) 2020年2月25日	円 10,000	% —	円 23,387	% —	% —	% —
2月末	9,049	△9.5	21,143	△9.6	95.9	4.1
3月末	8,178	△18.2	18,917	△19.1	96.1	3.9
4月末	8,726	△12.7	20,194	△13.7	96.5	3.5
5月末	9,450	△5.5	21,878	△6.5	96.7	3.3
(期末) 2020年6月8日	10,013	0.1	23,178	△0.9	98.1	1.8

\*騰落率は設定日比です。

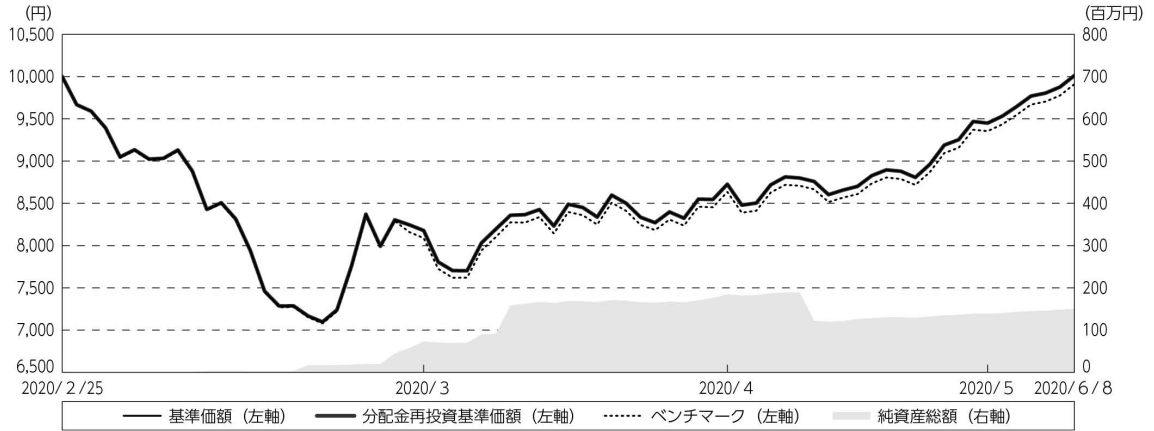
\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

\*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



設定日：10,000円

期末：10,013円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：0.1%（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。
- (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、設定時を10,000として計算しております。
- (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

新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を巡り、市場は急落した後に持ち直し、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

## ○投資環境

国内株式市場は、設定時から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。2020年3月下旬以降は、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受けて、上昇に転じました。5月下旬以降は、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。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）]

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

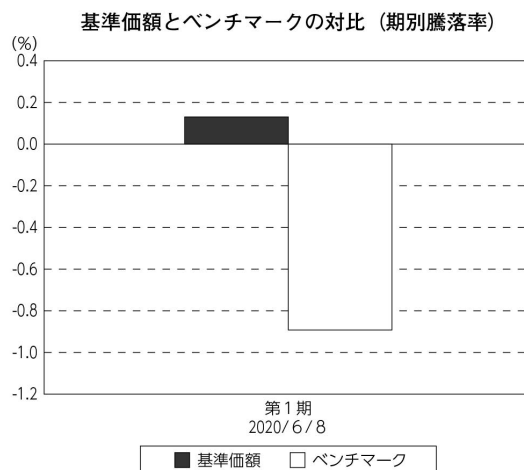
日経平均株価（日経225）の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価（日経225）に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行いました。

## ○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+0.1%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の-0.9%を1.0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



(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1期
	2020年2月25日～ 2020年6月8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	1,873

(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て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

### [野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）]

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

（2020年2月25日～2020年6月8日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	7	0.077	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(5)	(0.058)	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 ）	(1)	(0.009)	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 ）	(1)	(0.009)	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	0.001	(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)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.001	(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)	(0.001)	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	7	0.079	
期中の平均基準価額は、8,850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。

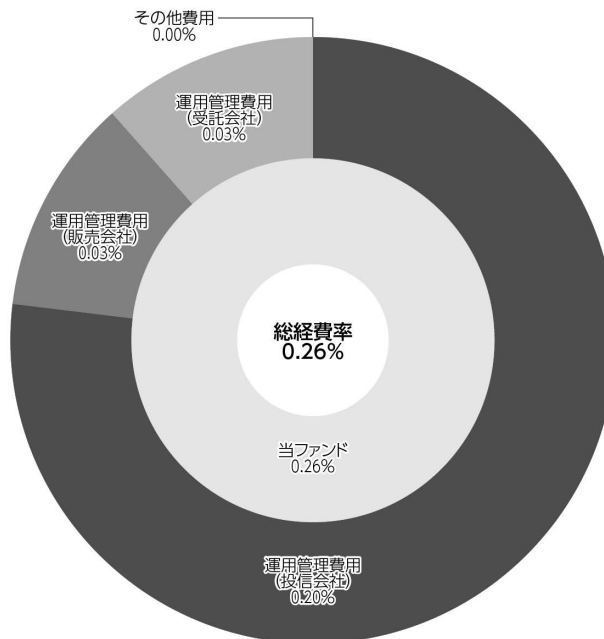
\* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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0.26%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2月25日～2020年6月8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 155,408	千円 183,668	千口 51,795	千円 66,152

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2020年2月25日～2020年6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
	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	13,488,493千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	64,597,587千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

\* (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2月25日～2020年6月8日)

## 利害関係人の発行する有価証券等

&lt;ミリオン・インデックスマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株式	百万円 8	百万円 2	百万円 57

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。

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2020年2月25日～2020年6月8日)

設定時残高 (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

(2020年6月8日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 103,612	千円 150,611

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2020年6月8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 150,611	% 99.9
コール・ローン等、その他	94	0.1
投資信託財産総額	150,705	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6月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	150,705,382
コール・ローン等	88,905
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	150,611,800
未収入金	4,677
(B) 負債	78,755
未払信託報酬	77,814
その他未払費用	941
(C) 純資産総額(A-B)	150,626,627
元本	150,434,594
次期繰越損益金	192,033
(D) 受益権総口数	150,434,594口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,013円

(注) 期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は227,929,765円、期中一部解約元本額は78,495,171円、1口当たり純資産額は1.0013円です。

## ○損益の状況 (2020年2月25日～2020年6月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 11
支払利息	△ 11
(B) 有価証券売買損益	27,609,297
売買益	33,119,933
売買損	△ 5,510,636
(C) 信託報酬等	△ 78,755
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,530,531
(E) 追加信託差損益金	△27,338,498
(売買損益相当額)	(△27,338,498)
(F) 計(D+E)	192,033
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	192,033
追加信託差損益金	△27,338,498
(配当等相当額)	( 655,035)
(売買損益相当額)	(△27,993,533)
分配準備積立金	27,530,531

\*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(E)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2月25日～2020年6月8日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年2月25日～ 2020年6月8日
a. 配当等収益(経費控除後)	640,282円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	26,890,249円
c. 信託約款に定める収益調整金	655,035円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	28,185,566円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,873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。

（2020年6月8日現在）

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

## &lt;ミリオン・インデックスマザーファンド&gt;

下記は、ミリオン・インデックスマザーファンド全体（50,511,291千口）の内容です。

## 国内株式

銘柄	当 期 末		銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>		
日本水産	112	57,904	王子ホールディングス	112	59,696
マルハニチロ	11.2	26,891	日本製紙	11.2	18,502
<b>鉱業 (0.1%)</b>			<b>化学 (8.2%)</b>		
国際石油開発帝石	44.8	36,064	クラレ	112	141,232
<b>建設業 (2.0%)</b>			旭化成	112	106,724
コムシスホールディングス	112	326,928	昭和電工	11.2	29,836
大成建設	22.4	93,184	住友化学	112	41,776
大林組	112	123,200	日産化学	112	601,440
清水建設	112	105,840	東ソー	56	89,040
長谷工コーポレーション	22.4	30,934	トクヤマ	22.4	60,412
鹿島建設	56	72,800	デンカ	22.4	63,907
大和ハウス工業	112	331,408	信越化学工業	112	1,428,000
積水ハウス	112	242,088	三井化学	22.4	55,686
日揮ホールディングス	112	144,592	三菱ケミカルホールディングス	56	37,592
<b>食料品 (3.9%)</b>			宇部興産	11.2	22,713
日清製粉グループ本社	112	196,112	日本化薬	112	130,816
明治ホールディングス	22.4	182,560	花王	112	998,032
日本ハム	56	240,520	D I C	11.2	32,692
サッポロホールディングス	22.4	51,116	富士フイルムホールディングス	112	561,232
アサヒグループホールディングス	112	502,432	資生堂	112	801,472
キリンホールディングス	112	267,680	日東電工	112	694,400
宝ホールディングス	112	108,976	<b>医薬品 (9.8%)</b>		
キッコーマン	112	602,560	協和キリン	112	319,312
味の素	112	203,840	武田薬品工業	112	454,384
ニチレイ	56	167,552	アステラス製薬	560	1,037,400
日本たばこ産業	112	246,904	大日本住友製薬	112	184,800
<b>繊維製品 (0.2%)</b>			塩野義製薬	112	724,864
東洋紡	11.2	16,777	中外製薬	112	1,756,160
ユニチカ	11.2	4,300	エーザイ	112	997,920
帝人	22.4	41,126	第一三共	112	1,032,080
東レ	112	63,078	大塚ホールディングス	112	552,272

## 野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
<b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>		
出光興産	44.8	110,611
JXTGホールディングス	112	47,936
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>		
横浜ゴム	56	99,008
ブリヂストン	112	419,776
<b>ガラス・土石製品 (1.1%)</b>		
AGC	22.4	78,512
日本板硝子	11.2	5,476
日本電気硝子	33.6	64,108
住友大阪セメント	11.2	44,464
太平洋セメント	11.2	30,654
東海カーボン	112	118,608
TOTO	56	254,520
日本碍子	112	192,304
<b>鉄鋼 (0.1%)</b>		
日本製鉄	11.2	13,171
神戸製鋼所	11.2	5,051
ジェイ エフ イー ホールディングス	11.2	10,483
大太平洋金属	11.2	21,627
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>		
日本軽金属ホールディングス	112	21,728
三井金属鉱業	11.2	27,787
東邦亜鉛	11.2	19,712
三菱マテリアル	11.2	28,672
住友金属鉱山	56	181,496
DOWAホールディングス	22.4	83,776
古河電気工業	11.2	29,825
住友電気工業	112	154,280
フジクラ	112	39,088
<b>金属製品 (0.2%)</b>		
SUMCO	11.2	19,174
東洋製綱グループホールディングス	112	155,904
<b>機械 (4.7%)</b>		
日本製鋼所	22.4	38,416
オークマ	22.4	116,256
アマダ	112	112,448
小松製作所	112	262,360
住友重機械工業	22.4	61,600
日立建機	112	346,080

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
クボタ	112	177,520
荏原製作所	22.4	61,488
ダイキン工業	112	1,868,160
日本精工	112	103,152
NTN	112	29,344
ジェイテクト	112	111,888
日立造船	22.4	9,072
三菱重工業	11.2	33,499
IHI	11.2	20,585
<b>電気機器 (19.6%)</b>		
日清紡ホールディングス	112	100,128
コニカミノルタ	112	52,080
ミネベアミツミ	112	242,256
日立製作所	22.4	84,067
三菱電機	112	165,368
富士電機	22.4	69,888
安川電機	112	446,880
オムロン	112	833,280
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22.4	45,203
日本電気	11.2	56,112
富士通	11.2	129,528
沖電気工業	11.2	12,712
セイコーエプソン	224	324,352
パナソニック	112	112,896
ソニー	112	828,352
TDK	112	1,256,640
アルプスアルパイン	112	179,424
横河電機	112	192,976
アドバンテスト	224	1,377,600
カシオ計算機	112	219,296
ファナック	112	2,324,560
京セラ	224	1,392,832
太陽誘電	112	375,200
SCREENホールディングス	22.4	120,064
キヤノン	168	395,388
リコー	112	104,720
東京エレクトロン	112	2,709,280
<b>輸送用機器 (4.5%)</b>		
デンソー	112	489,440
三井E&Sホールディングス	11.2	7,369

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
川崎重工業	11.2	22,176
日産自動車	112	54,611
いすゞ自動車	56	61,348
トヨタ自動車	112	802,704
日野自動車	112	95,200
三菱自動車工業	11.2	3,897
マツダ	22.4	18,838
本田技研工業	224	680,960
スズキ	112	466,592
S U B A R U	112	297,416
ヤマハ発動機	112	205,520
<b>精密機器 (4.0%)</b>		
テルモ	448	1,838,144
ニコン	112	118,272
オリンパス	448	871,584
シチズン時計	112	46,368
<b>その他製品 (2.2%)</b>		
バンダイナムコホールディングス	112	717,584
凸版印刷	56	107,688
大日本印刷	56	145,376
ヤマハ	112	640,640
<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>		
東京電力ホールディングス	11.2	4,312
中部電力	11.2	16,100
関西電力	11.2	12,443
東京瓦斯	22.4	57,108
大阪瓦斯	22.4	47,443
<b>陸運業 (1.9%)</b>		
東武鉄道	22.4	85,792
東急	56	97,552
小田急電鉄	56	148,624
京王電鉄	22.4	140,896
京成電鉄	56	208,040
東日本旅客鉄道	11.2	98,604
西日本旅客鉄道	11.2	78,422
東海旅客鉄道	11.2	212,296
日本通運	11.2	66,752
ヤマトホールディングス	112	261,856
<b>海運業 (0.1%)</b>		
日本郵船	11.2	18,536

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
商船三井	11.2	24,124
川崎汽船	11.2	13,160
<b>空運業 (0.1%)</b>		
A N Aホールディングス	11.2	31,964
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>		
三菱倉庫	56	165,592
<b>情報・通信業 (10.9%)</b>		
Zホールディングス	44.8	19,936
トレンドマイクロ	112	693,280
スカパーJ S A Tホールディングス	11.2	5,028
日本電信電話	44.8	113,433
K D D I	672	2,169,216
N T T ドコモ	11.2	32,474
東宝	11.2	44,688
エヌ・ティ・ティ・データ	560	746,480
コナミホールディングス	112	448,000
ソフトバンクグループ	672	3,577,728
<b>卸売業 (1.8%)</b>		
双日	11.2	2,990
伊藤忠商事	112	268,688
丸紅	112	64,657
豊田通商	112	343,280
三井物産	112	199,584
住友商事	112	152,432
三菱商事	112	284,872
<b>小売業 (13.0%)</b>		
J. フロント リテイリング	56	56,000
三越伊勢丹ホールディングス	112	86,016
セブン&アイ・ホールディングス	112	436,800
ファミリーマート	448	960,064
高島屋	56	60,704
丸井グループ	112	243,040
イオン	112	274,064
ファーストリテイリング	112	7,283,360
<b>銀行業 (0.6%)</b>		
コンコルディア・フィナンシャルグループ	112	42,448
新生銀行	11.2	17,158
あおぞら銀行	11.2	24,113
三菱UFJフィナンシャル・グループ	112	54,118
りそなホールディングス	11.2	4,560

## 野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	11.2	37,956
三井住友フィナンシャルグループ	11.2	38,360
千葉銀行	112	61,600
ふくおかフィナンシャルグループ	22.4	42,873
静岡銀行	112	83,216
みずほフィナンシャルグループ	112	16,329
<b>証券、商品先物取引業 (0.3%)</b>		
大和証券グループ本社	112	54,768
野村ホールディングス	112	57,825
松井証券	112	99,456
<b>保険業 (0.8%)</b>		
SOMPOホールディングス	28	107,520
MS&ADインシュアランスグループホール	33.6	111,484
ソニーフィナンシャルホールディングス	22.4	58,150
第一生命ホールディングス	11.2	17,724
東京海上ホールディングス	56	283,584
T&Dホールディングス	22.4	25,334
<b>その他金融業 (0.2%)</b>		
クレディセゾン	112	165,536

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
<b>不動産業 (1.4%)</b>		
東急不動産ホールディングス	112	68,544
三井不動産	112	261,296
三菱地所	112	206,136
東京建物	56	82,320
住友不動産	112	374,528
<b>サービス業 (6.0%)</b>		
エムスリー	268.8	1,200,192
ディー・エヌ・エー	33.6	50,366
電通グループ	112	347,760
サイバーエージェント	22.4	115,136
楽天	112	109,536
リクルートホールディングス	336	1,344,672
日本郵政	112	95,435
セコム	112	1,052,800
合 計	株数・金額 20,109	72,063,479
	銘柄数<比率>	<98.1%>

\*各銘柄の業種分類は、期末の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 1,345	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32期（決算日2019年11月7日）

作成対象期間（2018年11月8日～2019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
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
32期(2019年11月7日)	14,446	8.0	23,330	5.6	97.2	2.8	67,958

\*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) 2018年11月7日	円	%	円	%	%	%
	13,379	-	22,086	-	96.5	3.5
11月末	13,540	1.2	22,351	1.2	98.6	1.4
12月末	12,150	△9.2	20,015	△9.4	96.1	3.9
2019年1月末	12,612	△5.7	20,773	△5.9	98.6	1.4
2月末	12,993	△2.9	21,385	△3.2	98.5	1.5
3月末	12,988	△2.9	21,206	△4.0	96.6	3.4
4月末	13,640	2.0	22,259	0.8	96.9	3.1
5月末	12,628	△5.6	20,601	△6.7	96.5	3.4
6月末	13,063	△2.4	21,276	△3.7	96.5	3.5
7月末	13,214	△1.2	21,522	△2.6	97.2	2.7
8月末	12,723	△4.9	20,704	△6.3	96.7	3.3
9月末	13,467	0.7	21,756	△1.5	96.8	3.2
10月末	14,195	6.1	22,927	3.8	97.6	2.4
(期末) 2019年11月7日	円	%	円	%	%	%
	14,446	8.0	23,330	5.6	97.2	2.8

\*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

基準価額は、期首13,379円から期末14,446円に1,067円の値上がりとなりました。

米国が柔軟な金融政策運営方針を示したことや、米中貿易協議において歩み寄りが見られたことなどをを受けて国内株式市場は上昇し、基準価額も上昇しました。

### ○投資環境

国内株式市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ決定を受けて景気減速への警戒感が高まったことなどから米国株式市場の下落が続いたことを受け、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薄らいだことなどから米国株式市場が上昇したことを受け、国内株式市場は上昇しました。

5月に入ると、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などから、下落しましたが、6月には、FRB議長が政策金利引き下げの可能性を示唆したことなどから米国株式市場が大きく上昇し、反発しました。8月には米中貿易摩擦への懸念が高まり、米国株が急落したことなどで下落したものの、9月以降は米中貿易協議において歩み寄りが見られたことや、日米企業の7-9月期決算が事前予想に対して良好な滑り出しとなっ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

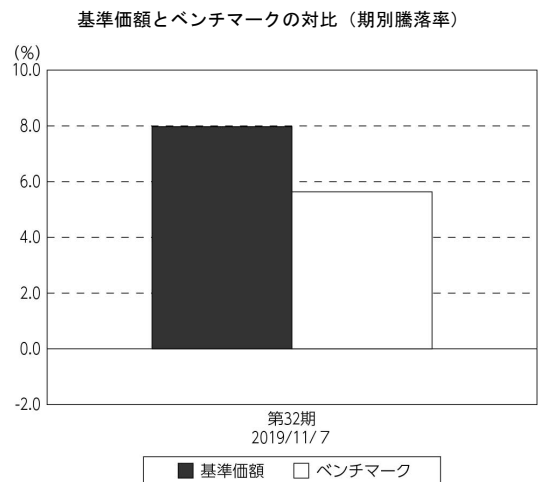
日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指すため、日経平均株価に採用されている銘柄にみなし額面を考慮した等株数投資を行いました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

## ○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+8.0%となり、ベンチマークである日経平均株価の+5.6%を2.4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

(2018年11月8日～2019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)	0	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.003)	
期中の平均基準価額は、13,101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

(2018年11月8日～2019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 5,684 (1,219)	千円 19,041,873 ( )	千株 7,320	千円 24,169,097

\*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 50,248	百万円 50,916	百万円 -	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

(2018年11月8日～2019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	43,210,970千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	66,999,912千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64

\* (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11月8日～2019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 12	百万円 17	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。

(2019年11月7日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
日本水産	112	102	65,382	
マルハニチロ	11.2	10.2	30,039	
<b>鉱業 (0.1%)</b>				
国際石油開発帝石	44.8	40.8	43,492	
<b>建設業 (2.3%)</b>				
コムシスホールディングス	112	102	320,280	
大成建設	22.4	20.4	90,474	
大林組	112	102	116,484	
清水建設	112	102	106,386	
長谷工コーポレーション	22.4	20.4	29,172	
鹿島建設	56	51	77,826	
大和ハウス工業	112	102	383,316	
積水ハウス	112	102	240,312	
日揮ホールディングス	112	102	163,608	
千代田化工建設	112	—	—	
<b>食料品 (4.1%)</b>				
日清製粉グループ本社	112	102	220,014	
明治ホールディングス	22.4	20.4	166,668	
日本ハム	56	51	247,860	
サッポロホールディングス	22.4	20.4	52,060	
アサヒグループホールディングス	112	102	528,156	
キリンホールディングス	112	102	234,498	
宝ホールディングス	112	102	110,160	
キッコーマン	112	102	568,140	
味の素	112	102	191,352	
ニチレイ	56	51	131,529	
日本たばこ産業	112	102	248,574	
<b>繊維製品 (0.2%)</b>				
東洋紡	11.2	10.2	16,320	
ユニチカ	11.2	10.2	3,672	
帝人	22.4	20.4	43,411	
東レ	112	102	80,100	
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>				
王子ホールディングス	112	102	63,954	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本製紙	11.2	10.2	19,094	
<b>化学 (8.3%)</b>				
クラレ	112	102	141,372	
旭化成	112	102	129,744	
昭和電工	11.2	10.2	31,977	
住友化学	112	102	52,326	
日産化学	112	102	453,390	
東ソー	56	51	81,957	
トクヤマ	22.4	20.4	62,934	
デンカ	22.4	20.4	65,076	
信越化学工業	112	102	1,248,990	
三井化学	22.4	20.4	55,651	
三菱ケミカルホールディングス	56	51	44,900	
宇部興産	11.2	10.2	24,041	
日本化薬	112	102	137,904	
花王	112	102	880,362	
D I C	—	10.2	32,895	
富士フイルムホールディングス	112	102	493,680	
資生堂	112	102	914,532	
日東電工	112	102	636,480	
<b>医薬品 (8.0%)</b>				
協和キリン	112	102	205,836	
武田薬品工業	112	102	436,356	
アステラス製薬	560	510	930,750	
大日本住友製薬	112	102	190,128	
塩野義製薬	112	102	648,720	
中外製薬	112	102	951,252	
エーザイ	112	102	763,266	
第一三共	112	102	697,680	
大塚ホールディングス	112	102	460,530	
<b>石油・石炭製品 (0.3%)</b>				
昭和シェル石油	112	—	—	
出光興産	—	40.8	130,764	
J X T Gホールディングス	112	102	52,989	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
横浜ゴム	56	51	127,296
ブリヂストン	112	102	470,934
<b>ガラス・土石製品 (1.2%)</b>			
AGC	22.4	20.4	80,784
日本板硝子	11.2	10.2	6,701
日本電気硝子	33.6	30.6	74,541
住友大阪セメント	11.2	10.2	49,011
太平洋セメント	11.2	10.2	32,691
東海カーボン	112	102	109,956
TOTO	56	51	234,090
日本碍子	112	102	188,394
<b>鉄鋼 (0.1%)</b>			
日本製鉄	11.2	10.2	16,263
神戸製鋼所	11.2	10.2	5,946
ジェイ エフ イー ホールディングス	11.2	10.2	14,116
日新製鋼	11.2	—	—
大太平洋金属	11.2	10.2	27,560
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	112	102	23,256
三井金属鉱業	11.2	10.2	32,691
東邦亜鉛	11.2	10.2	22,083
三菱マテリアル	11.2	10.2	32,793
住友金属鉱山	56	51	184,671
DOWAホールディングス	22.4	20.4	81,600
古河電気工業	11.2	10.2	31,722
住友電気工業	112	102	161,211
フジクラ	112	102	48,858
<b>金属製品 (0.3%)</b>			
SUMCO	11.2	10.2	18,564
東洋製鐵グループホールディングス	112	102	201,042
<b>機械 (4.8%)</b>			
日本製鋼所	22.4	20.4	46,960
オークマ	22.4	20.4	131,580
アマダホールディングス	112	102	129,030
小松製作所	112	102	270,249
住友重機械工業	22.4	20.4	67,626
日立建機	112	102	295,800
クボタ	112	102	181,152
荏原製作所	22.4	20.4	66,708

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイキン工業	112	102	1,573,860
日本精工	112	102	110,568
N T N	112	102	36,516
ジェイテクト	112	102	146,268
日立造船	22.4	20.4	8,282
三菱重工業	11.2	10.2	44,594
I H I	11.2	10.2	26,662
<b>電気機器 (19.6%)</b>			
日清紡ホールディングス	112	102	95,166
コニカミノルタ	112	102	73,338
ミネベアミツミ	112	102	219,300
日立製作所	22.4	20.4	85,618
三菱電機	112	102	163,710
富士電機	22.4	20.4	68,544
安川電機	112	102	441,150
オムロン	—	102	666,060
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22.4	20.4	44,798
日本電気	11.2	10.2	44,574
富士通	11.2	10.2	96,471
沖電気工業	11.2	10.2	15,167
セイコーエプソン	224	204	319,056
パナソニック	112	102	104,142
ソニー	112	102	668,304
T D K	112	102	1,161,780
アルプスアルパイン	112	102	243,882
パイオニア	112	—	—
横河電機	112	102	196,860
アドバンテスト	224	204	1,095,480
カシオ計算機	112	102	180,336
ファナック	112	102	2,206,260
京セラ	224	204	1,461,456
太陽誘電	112	102	307,020
S C R E E Nホールディングス	22.4	20.4	153,612
キヤノン	168	153	455,710
リコー	112	102	106,080
東京エレクトロン	112	102	2,260,320
<b>輸送用機器 (5.0%)</b>			
デンソー	112	102	512,652
三井E&Sホールディングス	11.2	10.2	9,108
川崎重工業	11.2	10.2	26,387

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日産自動車	112	102	102	71,124
いすゞ自動車	56	51	51	64,744
トヨタ自動車	112	102	102	789,072
日野自動車	112	102	102	106,998
三菱自動車工業	11.2	10.2	10.2	5,018
マツダ	22.4	20.4	20.4	20,440
本田技研工業	224	204	204	614,856
スズキ	112	102	102	526,728
S U B A R U	112	102	102	314,466
ヤマハ発動機	112	102	102	224,196
<b>精密機器 (3.6%)</b>				
テルモ	224	408	408	1,445,136
ニコン	112	102	102	145,962
オリンパス	112	408	408	693,600
シチズン時計	112	102	102	61,914
<b>その他製品 (2.3%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	—	102	102	684,522
凸版印刷	56	51	51	104,958
大日本印刷	56	51	51	151,674
ヤマハ	112	102	102	594,660
<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>				
東京電力ホールディングス	11.2	10.2	10.2	5,181
中部電力	11.2	10.2	10.2	16,294
関西電力	11.2	10.2	10.2	12,928
東京瓦斯	22.4	20.4	20.4	53,274
大阪瓦斯	22.4	20.4	20.4	43,452
<b>陸運業 (2.1%)</b>				
東武鉄道	22.4	20.4	20.4	80,376
東急	56	51	51	107,661
小田急電鉄	56	51	51	139,077
京王電鉄	22.4	20.4	20.4	141,168
京成電鉄	56	51	51	233,070
東日本旅客鉄道	11.2	10.2	10.2	102,663
西日本旅客鉄道	11.2	10.2	10.2	100,123
東海旅客鉄道	11.2	10.2	10.2	230,826
日本通運	11.2	10.2	10.2	67,626
ヤマトホールディングス	112	102	102	184,926
<b>海運業 (0.1%)</b>				
日本郵船	11.2	10.2	10.2	20,736
商船三井	11.2	10.2	10.2	30,651

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
川崎汽船	11.2	10.2	10.2	17,646
<b>空運業 (0.1%)</b>				
A N Aホールディングス	11.2	10.2	10.2	38,505
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
三菱倉庫	56	51	51	145,452
<b>情報・通信業 (9.9%)</b>				
Zホールディングス	44.8	40.8	40.8	15,177
トレンドマイクロ	112	102	102	551,820
スカパーJ S A Tホールディングス	11.2	10.2	10.2	4,753
日本電信電話	22.4	20.4	20.4	112,200
K D D I	672	612	612	1,958,400
N T Tドコモ	11.2	10.2	10.2	30,753
東宝	11.2	10.2	10.2	44,625
エヌ・ティ・ティ・データ	560	510	510	759,900
コナミホールディングス	112	102	102	468,180
ソフトバンクグループ	336	612	612	2,586,312
<b>卸売業 (2.0%)</b>				
双日	11.2	10.2	10.2	3,539
伊藤忠商事	112	102	102	235,008
丸紅	112	102	102	80,151
豊田通商	112	102	102	378,930
三井物産	112	102	102	194,055
住友商事	112	102	102	168,453
三菱商事	112	102	102	286,008
<b>小売業 (14.1%)</b>				
J . フロント リテイリング	56	51	51	72,471
三越伊勢丹ホールディングス	112	102	102	93,330
セブン&アイ・ホールディングス	112	102	102	428,094
ファミリーマート	112	408	408	1,137,096
高島屋	56	51	51	67,167
丸井グループ	112	102	102	252,756
イオン	112	102	102	232,050
ファーストリテイリング	112	102	102	7,049,220
<b>銀行業 (0.7%)</b>				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	112	102	102	46,512
新生銀行	11.2	10.2	10.2	18,094
あおぞら銀行	11.2	10.2	10.2	28,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	112	102	102	59,302
りそなホールディングス	11.2	10.2	10.2	4,910
三井住友トラスト・ホールディングス	11.2	10.2	10.2	41,901



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
三井住友フィナンシャルグループ	11.2	10.2	40,392	
千葉銀行	112	102	62,322	
ふくおかフィナンシャルグループ	22.4	20.4	43,370	
静岡銀行	112	102	86,394	
みずほフィナンシャルグループ	112	102	17,442	
<b>証券、商品先物取引業 (0.3%)</b>				
大和証券グループ本社	112	102	52,183	
野村ホールディングス	112	102	52,754	
松井証券	112	102	92,820	
<b>保険業 (0.9%)</b>				
SOMPOホールディングス	28	25.5	112,200	
MS&ADインシュアランスグループホール	33.6	30.6	109,027	
ソニーフィナンシャルホールディングス	22.4	20.4	49,041	
第一生命ホールディングス	11.2	10.2	18,839	
東京海上ホールディングス	56	51	300,288	
T&Dホールディングス	22.4	20.4	26,458	
<b>その他金融業 (0.3%)</b>				
クレディセゾン	112	102	168,096	
<b>不動産業 (1.6%)</b>				
東急不動産ホールディングス	112	102	74,868	

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
三井不動産	112	102	289,221	
三菱地所	112	102	215,883	
東京建物	56	51	79,407	
住友不動産	112	102	403,104	
<b>サービス業 (5.3%)</b>				
エムスリー	—	244.8	649,454	
ディー・エヌ・エー	33.6	30.6	54,437	
電通	112	102	410,040	
サイバーエージェント	22.4	20.4	75,174	
楽天	112	102	108,732	
リクルートホールディングス	336	306	1,139,544	
日本郵政	112	102	103,173	
東京ドーム	56	—	—	
セコム	112	102	980,322	
合 計	株 数・金 額	18,709	18,293	66,060,268
	銘柄数<比率>	225	225	<97.2%>

\*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 1,892	百万円 —
	日経225		

\*単位未満は切り捨て。

### ○投資信託財産の構成

(2019年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 66,060,268	% 95.6
コール・ローン等、その他	3,058,328	4.4
投資信託財産総額	69,118,596	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11月7日現在)

○損益の状況 (2018年11月8日～2019年11月7日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,118,596,980
コール・ローン等	1,144,617,475
株式(評価額)	66,060,268,380
未収入金	1,322,861,525
未収配当金	545,649,600
差入委託証拠金	45,200,000
(B) 負債	1,160,271,189
未払解約金	1,160,269,918
未払利息	1,271
(C) 純資産総額(A-B)	67,958,325,791
元本	47,042,890,090
次期繰越損益金	20,915,435,701
(D) 受益権総口数	47,042,890,090口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,446円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,442,590,718
受取配当金	1,443,602,824
受取利息	1,148
その他収益金	117,989
支払利息	△ 1,131,243
(B) 有価証券売買損益	4,417,352,239
売買益	8,377,831,479
売買損	△ 3,960,479,240
(C) 先物取引等取引損益	148,712,945
取引益	739,596,273
取引損	△ 590,883,328
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,008,655,902
(E) 前期繰越損益金	17,477,180,777
(F) 追加信託差損益金	5,986,160,226
(G) 解約差損益金	△ 8,556,561,204
(H) 計(D+E+F+G)	20,915,435,701
次期繰越損益金(H)	20,915,435,701

(注) 期首元本額は51,721,526,486円、期中追加設定元本額は20,927,465,407円、期中一部解約元本額は25,606,101,803円、1口当たり純資産額は1.4446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 24,323,168,869円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 13,930,713,405円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 2,932,515,127円
- ・野村つみたて日本株投信 2,390,739,969円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 1,785,496,380円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 1,052,961,046円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 500,902,497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) 126,392,797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。