

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2期(決算日2020年12月7日)

作成対象期間(2020年6月9日～2020年12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。

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
2期(2020年12月7日)	11,532	5	15.2	26,547	14.5	97.7	2.3	1,297

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*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	騰落率	ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
			日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(期首) 2020年6月8日	円 10,013	% —	円 23,178	% —	% 98.1	% 1.8
6月末	9,637	△ 3.8	22,288	△ 3.8	96.6	3.4
7月末	9,383	△ 6.3	21,710	△ 6.3	97.6	2.3
8月末	10,000	△ 0.1	23,140	△ 0.2	97.8	2.2
9月末	10,077	0.6	23,185	0.0	97.2	2.8
10月末	9,984	△ 0.3	22,977	△ 0.9	97.4	2.6
11月末	11,488	14.7	26,434	14.0	98.1	1.8
(期末) 2020年12月7日	円 11,537	% 15.2	円 26,547	% 14.5	% 97.7	% 2.3

*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

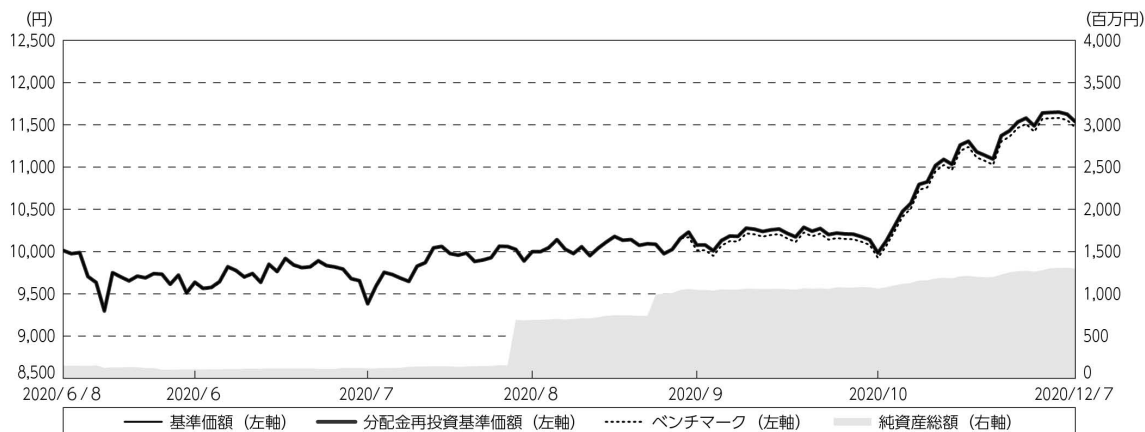
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日経平均株価（日経225）に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：10,013円

期 末：11,532円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：15.2%（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（2020年6月8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6月8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、期首から新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大への不安と経済活動再開による景気回復期待が交錯する形となり一進一退で推移しましたが、2020年8月以降は、新型コロナウイルスの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」状態が続くとの観測から、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

[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

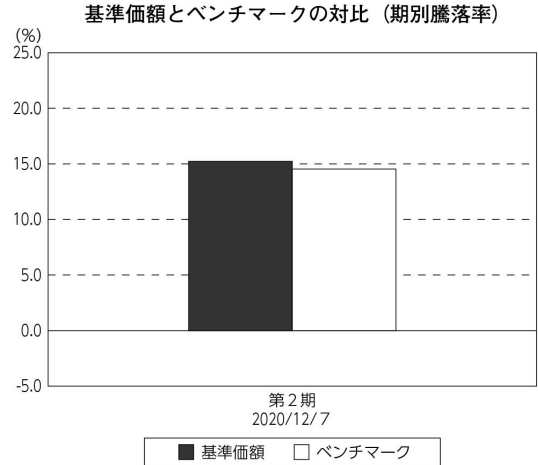
今期の基準価額の騰落率は+15.2%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+14.5%を0.7ポイント上回りました。

（プラス要因）

保有銘柄の配当が計上されたこと

（マイナス要因）

ファンドでは信託報酬などのコスト負担が日々生じること



(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て決定さ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
	2020年6月9日～ 2020年12月7日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.043%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,298

(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6月9日～2020年12月7日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	14	0.134	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(10)	(0.101)	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 ）	(2)	(0.016)	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)	(0.016)	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	0.002	(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)	(0.002)	
(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	14	0.137	
期中の平均基準価額は、10,094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。

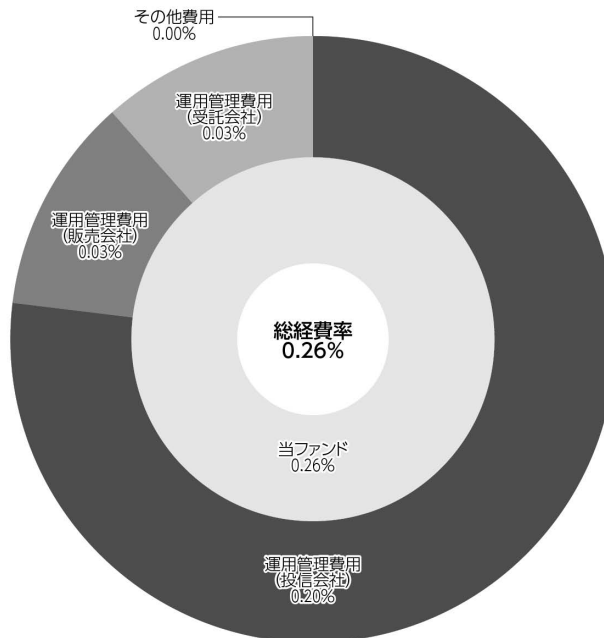
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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6月9日～2020年12月7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 735,894	千円 1,082,217	千口 65,654	千円 93,531

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年6月9日～2020年12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
	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	18,172,147千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	68,720,705千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26

* (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6月9日～2020年12月7日)

利害関係人との取引状況

<野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）>
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 5,024	百万円 139	% 2.8	百万円 13,147	百万円 38	% 0.3

平均保有割合 1.1%

※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 2	百万円 9	百万円 55

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

(2020年6月9日～2020年12月7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

(2020年12月7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 103,612	千口 773,852	千円 1,297,828

*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12月7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 1,297,828	% 99.9
コール・ローン等、その他	1,543	0.1
投資信託財産総額	1,299,371	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12月7日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,299,371,595
コール・ローン等	941,374
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	1,297,828,790
未収入金	601,431
(B) 負債	1,412,318
未払収益分配金	562,772
未払信託報酬	839,325
その他未払費用	10,221
(C) 純資産総額(A-B)	1,297,959,277
元本	1,125,545,613
次期繰越損益金	172,413,664
(D) 受益権総口数	1,125,545,613口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,532円

(注) 期首元本額は150,434,594円、期中追加設定元本額は1,083,910,469円、期中一部解約元本額は108,799,450円、1口当たり純資産額は1.1532円です。

○損益の状況（2020年6月9日～2020年12月7日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 63
支払利息	△ 63
(B) 有価証券売買損益	159,479,160
売買益	162,463,529
売買損	△ 2,984,369
(C) 信託報酬等	△ 849,546
(D) 当期損益金(A+B+C)	158,629,551
(E) 前期繰越損益金	14,396,123
(F) 追加信託差損益金	△ 49,238
(配当等相当額)	(196,490,640)
(売買損益相当額)	(△196,539,878)
(G) 計(D+E+F)	172,976,436
(H) 収益分配金	△ 562,772
次期繰越損益金(G+H)	172,413,664
追加信託差損益金	△ 49,238
(配当等相当額)	(198,825,237)
(売買損益相当額)	(△198,874,475)
分配準備積立金	172,462,902

* 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6月9日～2020年12月7日）は以下の通りです。

項目	当期
	2020年6月9日～ 2020年12月7日
a. 配当等収益(経費控除後)	6,844,389円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	151,785,162円
c. 信託約款に定める収益調整金	198,825,237円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	14,396,123円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	371,850,911円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,303円
g. 分配金	562,772円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	5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

（2020年12月7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（45,007,059千口）の内容です。

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	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)					パルプ・紙 (0.1%)				
日本水産	112	100	42,100		王子ホールディングス	112	100	51,300	
マルハニチロ	11.2	10	21,840		日本製紙	11.2	10	11,920	
鉱業 (0.0%)					化学 (8.1%)				
国際石油開発帝石	44.8	40	22,920		クラレ	112	100	111,500	
建設業 (1.7%)					旭化成	112	100	104,900	
コムシスホールディングス	112	100	312,000		昭和電工	11.2	10	20,640	
大成建設	22.4	20	75,700		住友化学	112	100	42,300	
大林組	112	100	94,600		日産化学	112	100	644,000	
清水建設	112	100	81,500		東ソー	56	50	85,700	
長谷工コーポレーション	22.4	20	23,560		トクヤマ	22.4	20	46,680	
鹿島建設	56	50	69,000		デンカ	22.4	20	73,200	
大和ハウス工業	112	100	332,400		信越化学工業	112	100	1,730,000	
積水ハウス	112	100	195,850		三井化学	22.4	20	58,640	
日揮ホールディングス	112	100	92,600		三菱ケミカルホールディングス	56	50	32,265	
食料品 (3.6%)					宇部興産	11.2	10	19,190	
日清製粉グループ本社	112	100	170,200		日本化薬	112	—	—	
明治ホールディングス	22.4	20	146,000		花王	112	100	776,700	
日本ハム	56	50	235,250		D I C	11.2	10	26,100	
サッポロホールディングス	22.4	20	41,120		富士フイルムホールディングス	112	100	569,500	
アサヒグループホールディングス	112	100	443,800		資生堂	112	100	740,000	
キリンホールディングス	112	100	242,150		日東電工	112	100	868,000	
宝ホールディングス	112	100	123,500		医薬品 (8.0%)				
キッコーマン	112	100	665,000		協和キリン	112	100	288,900	
味の素	112	100	224,450		武田薬品工業	112	100	387,000	
ニチレイ	56	50	137,000		アステラス製薬	560	500	753,750	
日本たばこ産業	112	100	214,000		大日本住友製薬	112	100	131,300	
繊維製品 (0.2%)					塩野義製薬	112	100	565,500	
東洋紡	11.2	10	13,430		中外製薬	112	300	1,511,400	
ユニチカ	11.2	10	3,920		エーザイ	112	100	761,500	
帝人	22.4	20	38,720		第一三共	112	300	1,045,200	
東レ	112	100	61,670		大塚ホールディングス	112	100	439,700	

野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）

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 (0.2%)			
出光興産	44.8	40	87,920
E.N.E.O.Sホールディングス	112	100	35,940
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	56	50	79,750
ブリヂストン	112	100	371,100
ガラス・土石製品 (1.1%)			
A.G.C	22.4	20	70,600
日本板硝子	11.2	10	4,340
日本電気硝子	33.6	30	71,010
住友大阪セメント	11.2	10	32,550
太平洋セメント	11.2	10	28,280
東海カーボン	112	100	114,000
T.O.T.O	56	50	295,500
日本碍子	112	100	170,600
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	11.2	10	13,320
神戸製鋼所	11.2	10	5,240
ジェイ エフ イー ホールディングス	11.2	10	10,320
大太平洋金属	11.2	10	20,830
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	112	10	19,280
三井金属鉱業	11.2	10	31,300
東邦亜鉛	11.2	10	21,980
三菱マテリアル	11.2	10	20,410
住友金属鉱山	56	50	209,000
D.O.W.Aホールディングス	22.4	20	72,900
古河電気工業	11.2	10	29,060
住友電気工業	112	100	125,250
フジクラ	112	100	45,200
金属製品 (0.2%)			
S.U.M.C.O	11.2	10	23,220
東洋製織グループホールディングス	112	100	109,000
機械 (5.1%)			
日本製鋼所	22.4	20	55,560
オークマ	22.4	20	118,000
アマダ	112	100	109,500
小松製作所	112	100	270,200
住友重機械工業	22.4	20	45,160
日立建機	112	100	295,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クボタ	112	100	215,550
荏原製作所	22.4	20	69,600
ダイキン工業	112	100	2,322,000
日本精工	112	100	90,600
N.T.N	112	100	24,400
ジェイテクト	112	100	79,800
日立造船	22.4	20	8,140
三菱重工業	11.2	10	25,805
I.H.I	11.2	10	16,930
電気機器 (21.4%)			
日清紡ホールディングス	112	100	80,000
コニカミノルタ	112	100	35,000
ミネベアミツミ	112	100	221,500
日立製作所	22.4	20	81,300
三菱電機	112	100	153,300
富士電機	22.4	20	70,000
安川電機	112	100	487,500
オムロン	112	100	920,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22.4	20	52,680
日本電気	11.2	10	54,800
富士通	11.2	10	135,750
沖電気工業	11.2	10	9,070
セイコーエプソン	224	200	327,200
パナソニック	112	100	114,300
シャープ	—	100	137,700
ソニー	112	100	967,500
T.D.K	112	100	1,454,000
アルプスアルパイン	112	100	133,300
横河電機	112	100	196,700
アドバンテス	224	200	1,502,000
カシオ計算機	112	100	188,200
ファナック	112	100	2,586,500
京セラ	224	200	1,239,800
太陽誘電	112	100	466,000
S.C.R.E.E.Nホールディングス	22.4	20	142,400
キヤノン	168	150	294,375
リコー	112	100	73,800
東京エレクトロン	112	100	3,689,000
輸送用機器 (4.2%)			
デンソー	112	100	579,500

野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）

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E&Sホールディングス	11.2	10	3,690	
川崎重工業	11.2	10	15,860	
日産自動車	112	100	53,260	
いすゞ自動車	56	50	51,550	
トヨタ自動車	112	100	720,400	
日野自動車	112	100	92,100	
三菱自動車工業	11.2	10	1,910	
マツダ	22.4	20	12,980	
本田技研工業	224	200	623,600	
スズキ	112	100	551,100	
SUBARU	112	100	212,200	
ヤマハ発動機	112	100	216,200	
精密機器 (3.6%)				
テルモ	448	400	1,661,600	
ニコン	112	100	66,200	
オリンパス	448	400	896,800	
シチズン時計	112	100	29,000	
その他製品 (2.4%)				
パンダイナムコホールディングス	112	100	938,400	
凸版印刷	56	50	80,400	
大日本印刷	56	50	95,300	
ヤマハ	112	100	643,000	
電気・ガス業 (0.1%)				
東京電力ホールディングス	11.2	10	2,750	
中部電力	11.2	10	12,415	
関西電力	11.2	10	9,253	
東京瓦斯	22.4	20	44,360	
大阪瓦斯	22.4	20	39,780	
陸運業 (1.6%)				
東武鉄道	22.4	20	61,000	
東急	56	50	63,450	
小田急電鉄	56	50	158,250	
京王電鉄	22.4	20	154,200	
京成電鉄	56	50	184,250	
東日本旅客鉄道	11.2	10	69,110	
西日本旅客鉄道	11.2	10	53,850	
東海旅客鉄道	11.2	10	143,000	
日本通運	11.2	10	70,000	
ヤマトホールディングス	112	100	258,500	

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
海運業 (0.1%)				
日本郵船	11.2	10	23,950	
商船三井	11.2	10	29,480	
川崎汽船	11.2	10	19,130	
空運業 (0.0%)				
ANAホールディングス	11.2	10	23,570	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	56	50	152,250	
情報・通信業 (12.0%)				
ネクソン	—	200	601,000	
Zホールディングス	44.8	40	24,512	
トレンドマイクロ	112	100	566,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	11.2	10	5,000	
日本電信電話	44.8	40	101,340	
KDD I	672	600	1,781,400	
ソフトバンク	—	100	126,350	
N T T ドコモ	11.2	—	—	
東宝	11.2	10	41,550	
エヌ・ティ・ティ・データ	560	500	694,500	
コナミホールディングス	112	100	597,000	
ソフトバンクグループ	672	600	4,273,800	
卸売業 (1.8%)				
双日	11.2	10	2,340	
伊藤忠商事	112	100	290,250	
丸紅	112	100	63,850	
豊田通商	112	100	377,000	
三井物産	112	100	191,000	
住友商事	112	100	134,350	
三菱商事	112	100	251,600	
小売業 (12.9%)				
J. フロント リテイリング	56	50	43,300	
三越伊勢丹ホールディングス	112	100	56,500	
セブン&アイ・ホールディングス	112	100	350,300	
ファミリーマート	448	—	—	
高島屋	56	50	41,950	
丸井グループ	112	100	190,900	
イオン	112	100	301,800	
ファーストリテイリング	112	100	8,527,000	
銀行業 (0.5%)				
コンコルディア・フィナンシャルグループ	112	100	38,000	

野村日経225インデックス（野村SMA・EW向け）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新生銀行	11.2	10	12,620
あおぞら銀行	11.2	10	18,750
三菱UFJフィナンシャル・グループ	112	100	44,850
りそなホールディングス	11.2	10	3,771
三井住友トラスト・ホールディングス	11.2	10	31,760
三井住友フィナンシャルグループ	11.2	10	30,820
千葉銀行	112	100	59,400
ふくおかフィナンシャルグループ	22.4	20	37,360
静岡銀行	112	100	76,300
みずほフィナンシャルグループ	112	10	13,325
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	112	100	46,950
野村ホールディングス	112	100	55,260
松井証券	112	100	82,100
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	28	25	102,975
MS&ADインシュアランスグループホール	33.6	30	94,830
ソニーフィナンシャルホールディングス	22.4	—	—
第一生命ホールディングス	11.2	10	16,600
東京海上ホールディングス	56	50	263,650
T&Dホールディングス	22.4	20	24,420
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	112	100	126,000

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本取引所グループ	—	100	259,400
不動産業 (1.2%)			
東急不動産ホールディングス	112	100	54,100
三井不動産	112	100	224,000
三菱地所	112	100	177,800
東京建物	56	50	74,350
住友不動産	112	100	354,800
サービス業 (6.7%)			
エムスリー	268.8	240	2,028,000
ディー・エヌ・エー	33.6	30	57,120
電通グループ	112	100	351,500
サイバーエージェント	22.4	20	136,400
楽天	112	100	99,700
リクルートホールディングス	336	300	1,216,800
日本郵政	112	100	77,890
セコム	112	100	976,000
合 計	株数・金額	20,109	18,145
	銘柄数<比率>	225	225 <97.7%>

*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	百万円
	日経225	1,753	—

*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	率	日経平均株価	騰落率			
	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	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。

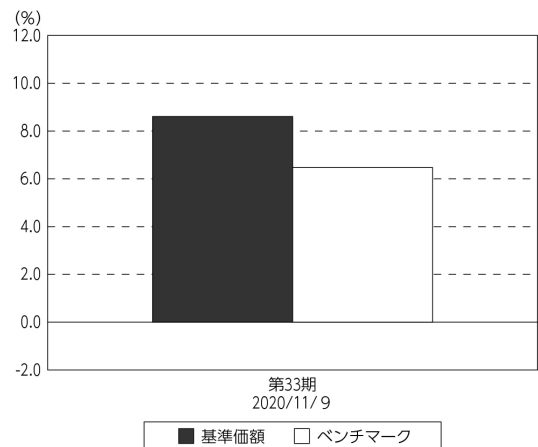
○当ファンドのベンチマークとの差異

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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（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	
富士フイ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%)			
AGC	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
TOTO	51	52	278,200
日本硝子	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
NTN	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
ミネベアアミツミ	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
TDK	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U F J 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	百万円
	日経225	1,864	—

*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FoFs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。