

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第36期 (決算日2023年2月17日)

作成対象期間 (2022年2月18日～2023年2月17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	無期限(1987年2月18日設定)
運用方針	日経平均株価と連動する投資成果を目標として運用します。原則として日経平均株価に採用されている銘柄のうち200銘柄以上に等株数投資を行ない、株式の組入比率は高位に保ちます。
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。
分配方針	毎年1回決算を行ない、原則として利子・配当収入等を中心として分配します。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	標準価額			ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	純資 産額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円	
32期(2019年2月18日)	7,693	70	△2.6	21,282	△3.9	96.8	3.1	27,909	
33期(2020年2月17日)	8,542	85	12.1	23,523	10.5	97.7	2.2	25,387	
34期(2021年2月17日)	11,032	110	30.4	30,292	28.8	97.7	2.2	28,412	
35期(2022年2月17日)	9,933	80	△9.2	27,233	△10.1	96.5	3.4	28,815	
36期(2023年2月17日)	10,087	100	2.6	27,513	1.0	98.8	1.2	30,916	

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*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 2 2 5)	騰 落 率		
(期首) 2022年2月17日	円	%	円	%	%	%
	9,933	—	27,233	—	96.5	3.4
2月末	9,681	△2.5	26,527	△2.6	95.1	4.8
3月末	10,233	3.0	27,821	2.2	95.9	4.1
4月末	9,871	△0.6	26,848	△1.4	95.7	4.3
5月末	10,029	1.0	27,280	0.2	96.5	3.4
6月末	9,710	△2.2	26,393	△3.1	95.4	4.5
7月末	10,222	2.9	27,802	2.1	96.6	3.3
8月末	10,328	4.0	28,092	3.2	96.2	3.7
9月末	9,612	△3.2	25,937	△4.8	95.6	4.2
10月末	10,216	2.8	27,587	1.3	95.0	4.9
11月末	10,355	4.2	27,969	2.7	96.3	3.7
12月末	9,671	△2.6	26,095	△4.2	97.4	2.5
2023年1月末	10,122	1.9	27,327	0.3	97.3	2.7
(期末) 2023年2月17日	10,087	2.6	27,513	1.0	98.8	1.2

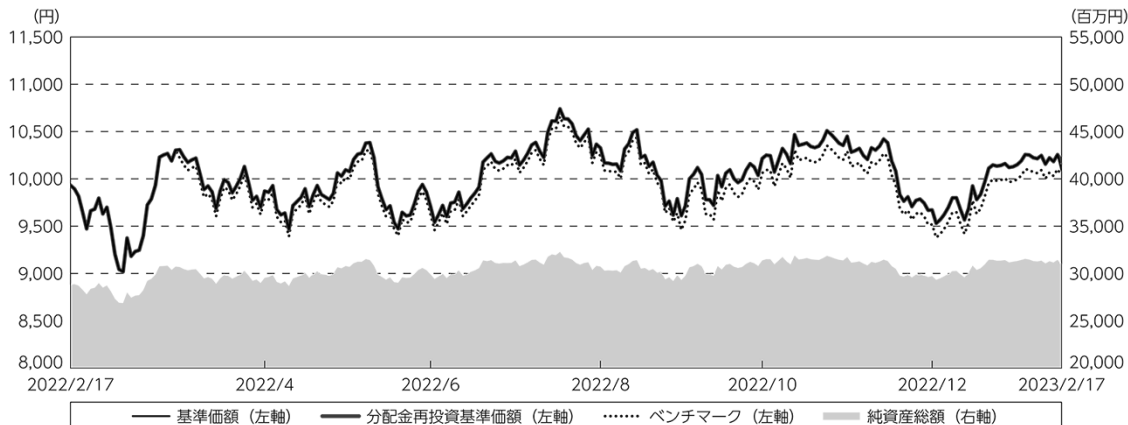
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「日経平均株価」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、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」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「日経平均株価」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「株式インデックス 225」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「株式インデックス 225」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、「日経平均株価」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、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」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



期 首：9,933円

期 末：10,087円 (既払分配金(税込み):100円)

騰落率： 2.6% (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(2022年2月17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(2022年2月17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が、2022年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。6月中旬以降は、欧米諸国の金融引き締めによる世界景気低迷への懸念などから下落しましたが、7月以降は、円安米ドル高進行による輸出企業の収益改善期待や、FOMC(米連邦公開市場委員会)においてパウエルFRB(米連邦準備制度理事会)議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式市場が大幅高となったことなどから概ね堅調に推移しました。8月下旬以降は、米国の金融

引き締め局面の長期化観測が広がったことなどから下落しました。10月以降は、米長期金利上昇が一服したことで米国株式市場が堅調に推移したことや、岸田政権の総合経済対策が発表されたことなどから上昇しました。

11月下旬以降は、中国において新型コロナウイルス新規感染者数が過去最多を更新し、同国における行動制限を通じた企業活動への悪影響が懸念されたことなどから、国内株式市場は下落しました。12月中旬以降は、同月開催したFOMCの結果などから利上げ継続と景気減速への警戒感が広がり米国株式市場が下落したことや、日銀の金融政策決定会合において10年国債利回りの許容変動幅拡大など金融緩和策の一部修正が決定されたことなどから、金融関連を除く幅広い業種が下落し市場全体でも下落しました。

2023年1月中旬以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したことで上昇しました。下旬にかけても、FRBによる利上げ停止の可能性が高まったとの見方から米ハイテク株が上昇し国内株式市場も堅調に推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式の実質組入比率（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、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+2.6%となり、ベンチマークである日経平均株価の+1.0%を1.6ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

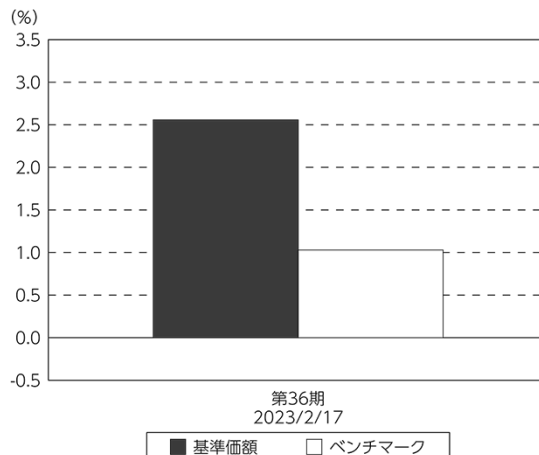
(プラス要因)

保有銘柄の配当が計上されたこと

(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

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、今期の経費控除後の配当等収益から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せん。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第36期
	2022年2月18日～ 2023年2月17日
当期分配金	100
(対基準価額比率)	0.982%
当期の収益	100
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	12,335

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても、株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価と連動する投資成果を目指して参ります。

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

(2022年2月18日～2023年2月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	68	0.682	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(30)	(0.297)	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 ）	(33)	(0.330)	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 ）	(6)	(0.055)	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	0.003	(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	68	0.686	
期中の平均基準価額は、10,004円です。			

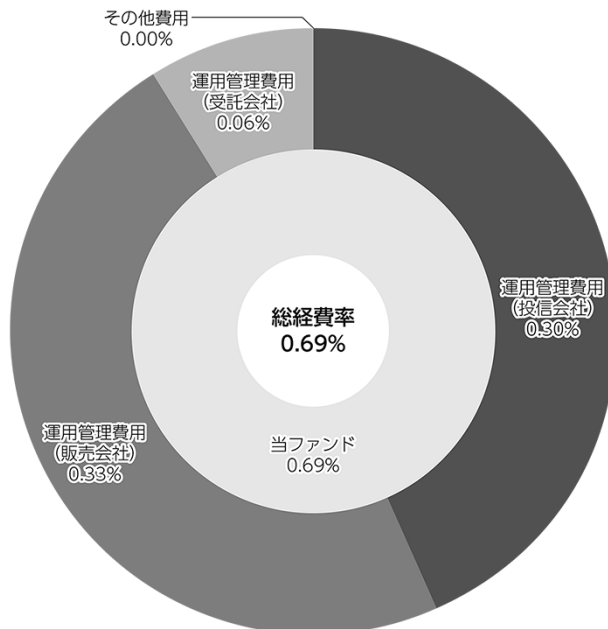
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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0.69%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) 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

(2022年2月18日～2023年2月17日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		846	3,907,916	394	1,640,331
		(92)	(-)		

*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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		11,761	12,487	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年2月18日～2023年2月17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	5,548,247千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,132,385千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.19

* (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

(2022年2月18日～2023年2月17日)

利害関係人との取引状況

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B	$\frac{B}{A}$	うち利害関係人 との取引状況D		$\frac{D}{C}$		
株式	百万円 3,907	百万円 733			百万円 1,640	百万円 12	% 0.7

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
	百万円	百万円	百万円
株式	1	0.992729	20

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。

〇組入資産の明細

(2023年2月17日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)			銘 柄	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				繊維製品 (0.1%)			
ニッスイ	36	38	20,406	東洋紡	3.6	3.8	3,891
マルハニチロ	3.6	—	—	ユニチカ	3.6	—	—
鉱業 (0.1%)				帝人	7.2	7.6	10,814
I N P E X	14.4	15.2	21,857	東レ	36	38	29,944
建設業 (1.7%)				パルプ・紙 (0.1%)			
コムシスホールディングス	36	38	94,164	王子ホールディングス	36	38	20,026
大成建設	7.2	7.6	32,908	日本製紙	3.6	3.8	3,667
大林組	36	38	36,822	化学 (7.1%)			
清水建設	36	38	27,512	クラレ	36	38	44,992
長谷工コーポレーション	7.2	7.6	11,536	旭化成	36	38	35,651
鹿島建設	18	19	30,324	レゾナック・ホールディングス	3.6	3.8	8,724
大和ハウス工業	36	38	118,142	住友化学	36	38	17,974
積水ハウス	36	38	95,741	日産化学	36	38	222,680
日揮ホールディングス	36	38	66,462	東ソー	18	19	33,212
食料品 (3.4%)				トクヤマ	7.2	7.6	15,648
日清製粉グループ本社	36	38	59,052	デンカ	7.2	7.6	22,070
明治ホールディングス	7.2	7.6	48,640	信越化学工業	36	38	732,450
日本ハム	18	19	70,490	三井化学	7.2	7.6	24,244
サッポロホールディングス	7.2	7.6	23,408	三菱ケミカルグループ	18	19	15,310
アサヒグループホールディングス	36	38	177,384	U B E	3.6	3.8	7,786
キリンホールディングス	36	38	75,867	花王	36	38	193,040
宝ホールディングス	36	38	40,470	D I C	3.6	3.8	9,021
キッコーマン	36	38	247,760	富士フイルムホールディングス	36	38	243,162
味の素	36	38	153,444	資生堂	36	38	234,042
ニチレイ	18	19	50,882	日東電工	36	38	318,820
日本たばこ産業	36	38	105,298	医薬品 (7.4%)			
				協和キリン	36	38	111,720

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
武田薬品工業	36	38	158,916
アステラス製薬	180	190	366,130
住友ファーマ	36	38	32,376
塩野義製薬	36	38	233,586
中外製薬	108	114	405,384
エーザイ	36	38	289,750
第一三共	108	114	490,200
大塚ホールディングス	36	38	158,650
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	14.4	15.2	47,044
E.N.E.O.Sホールディングス	36	38	17,457
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	18	19	42,085
ブリヂストン	36	38	195,624
ガラス・土石製品 (1.0%)			
A.G.C.	7.2	7.6	37,392
日本板硝子	3.6	3.8	2,576
日本電気硝子	10.8	11.4	27,987
住友大阪セメント	3.6	3.8	14,288
太平洋セメント	3.6	3.8	9,150
東海カーボン	36	38	49,058
TOTO	18	19	86,640
日本碍子	36	38	67,906
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3.6	3.8	11,590
神戸製鋼所	3.6	3.8	3,332
J.F.E.ホールディングス	3.6	3.8	6,479
大平洋金属	3.6	3.8	7,543
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	3.6	3.8	5,437
三井金属鉱業	3.6	3.8	12,825
東邦亜鉛	3.6	3.8	7,801
三菱マテリアル	3.6	3.8	8,094
住友金属鉱山	18	19	98,477
DOWAホールディングス	7.2	7.6	34,124
古河電気工業	3.6	3.8	9,116
住友電気工業	36	38	64,163
フジクラ	36	38	36,746
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	3.6	3.8	7,098
機械 (5.7%)			
日本製鋼所	7.2	7.6	19,874
オークマ	7.2	7.6	39,368

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アマダ	36	38	45,372
SMC	—	3.8	254,980
小松製作所	36	38	123,956
住友重機械工業	7.2	7.6	22,214
日立建機	36	38	116,470
クボタ	36	38	77,786
荏原製作所	7.2	7.6	42,180
ダイキン工業	36	38	877,230
日本精工	36	38	28,158
NTN	36	38	12,692
ジェイテクト	36	38	38,608
三井E&Sホールディングス	3.6	3.8	1,626
日立造船	7.2	7.6	6,741
三菱重工業	3.6	3.8	19,319
I.H.I.	3.6	3.8	14,041
電気機器 (23.6%)			
コニカミノルタ	36	38	22,306
ミネベアミツミ	36	38	91,960
日立製作所	7.2	7.6	53,108
三菱電機	3.6	3.8	58,102
富士電機	7.2	7.6	39,748
安川電機	36	38	194,940
日本電産	—	30.4	213,560
オムロン	36	38	277,590
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.2	7.6	18,703
日本電気	3.6	3.8	18,126
富士通	3.6	3.8	67,241
沖電気工業	3.6	—	—
セイコーエプソン	72	76	140,828
パナソニック ホールディングス	36	38	45,733
シャープ	36	38	36,822
ソニーグループ	36	38	436,240
T.D.K.	108	114	523,830
アルプスアルパイン	36	38	54,834
横河電機	36	38	79,268
アドバンテスト	72	76	763,800
キーエンス	3.6	3.8	223,706
カシオ計算機	36	38	51,490
ファナック	36	38	864,880
京セラ	72	76	503,576
太陽誘電	36	38	159,410
村田製作所	28.8	30.4	228,456
S.C.R.E.E.N.ホールディングス	7.2	7.6	78,204

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キヤノン	54	57	167,181
リコー	36	38	39,178
東京エレクトロン	36	38	1,755,220
輸送用機器 (4.6%)			
デンソー	36	38	281,352
川崎重工業	3.6	3.8	11,552
日産自動車	36	38	19,710
いすゞ自動車	18	19	31,179
トヨタ自動車	180	190	362,425
日野自動車	36	38	21,584
三菱自動車工業	3.6	3.8	2,052
マツダ	7.2	7.6	8,907
本田技研工業	72	76	261,288
スズキ	36	38	182,780
SUBARU	36	38	84,170
ヤマハ発動機	36	38	128,630
精密機器 (4.1%)			
テルモ	144	152	566,808
ニコン	36	38	48,260
オリンパス	144	152	349,828
HOYA	—	19	255,930
シチズン時計	36	38	30,400
その他製品 (2.7%)			
パンダイナムコホールディングス	36	38	326,458
凸版印刷	18	19	45,125
大日本印刷	18	19	68,685
ヤマハ	36	38	188,100
任天堂	3.6	38	207,328
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	3.6	3.8	1,786
中部電力	3.6	3.8	5,399
関西電力	3.6	3.8	4,864
東京瓦斯	7.2	7.6	20,352
大阪瓦斯	7.2	7.6	16,286
陸運業 (1.3%)			
東武鉄道	7.2	7.6	22,792
東急	18	19	29,906
小田急電鉄	18	19	30,590
京王電鉄	7.2	7.6	35,416
京成電鉄	18	19	72,295
東日本旅客鉄道	3.6	3.8	26,011
西日本旅客鉄道	3.6	3.8	19,824
東海旅客鉄道	3.6	3.8	57,836

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	36	38	88,160
NIPPON EXPRESSホールディン	3.6	3.8	28,652
海運業 (0.4%)			
日本郵船	3.6	11.4	38,247
商船三井	3.6	11.4	39,159
川崎汽船	3.6	11.4	38,019
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	3.6	3.8	10,609
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	18	19	58,900
情報・通信業 (11.3%)			
ネクソン	72	76	233,700
Zホールディングス	14.4	15.2	5,803
トレンドマイクロ	36	38	240,920
日本電信電話	14.4	15.2	59,097
KDDI	216	228	909,948
ソフトバンク	36	38	58,026
東宝	3.6	3.8	18,126
エヌ・ティ・ティ・データ	180	190	356,440
コナミグループ	36	38	243,200
ソフトバンクグループ	216	228	1,314,192
卸売業 (2.8%)			
双日	3.6	3.8	9,815
伊藤忠商事	36	38	157,130
丸紅	36	38	66,690
豊田通商	36	38	212,800
三井物産	36	38	150,100
住友商事	36	38	89,718
三菱商事	36	38	178,448
小売業 (12.0%)			
J. フロント リテイリング	18	19	23,693
三越伊勢丹ホールディングス	36	38	52,440
セブン&アイ・ホールディングス	36	38	231,154
高島屋	18	19	35,378
丸井グループ	36	38	78,090
イオン	36	38	99,332
ファーストリテイリング	36	38	3,149,820
銀行業 (0.7%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	38	41,724
コンコルディア・フィナンシャルグループ	36	38	21,812
SBI新生銀行	3.6	—	—
あおぞら銀行	3.6	3.8	10,001
三菱UFJフィナンシャル・グループ	36	38	37,278

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
りそなホールディングス	3.6	3.8	2,791
三井住友トラスト・ホールディングス	3.6	3.8	18,563
三井住友フィナンシャルグループ	3.6	3.8	22,511
千葉銀行	36	38	37,430
ふくおかフィナンシャルグループ	7.2	7.6	23,180
静岡銀行	36	—	—
みずほフィナンシャルグループ	3.6	3.8	8,092
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	36	38	23,788
野村ホールディングス	36	38	20,827
松井証券	36	38	30,172
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	7.2	7.6	42,871
MS&ADインシュアランスグループホール	10.8	11.4	50,046
第一生命ホールディングス	3.6	3.8	11,354
東京海上ホールディングス	18	57	161,167
T&Dホールディングス	7.2	7.6	16,180
その他金融業 (0.8%)			
クレディセゾン	36	38	68,096
オリックス	—	38	89,376
日本取引所グループ	36	38	74,290

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 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	36	38	24,130	
三井不動産	36	38	93,366	
三菱地所	36	38	61,636	
東京建物	18	19	30,020	
住友不動産	36	38	117,040	
サービス業 (4.4%)				
エムスリー	86.4	91.2	305,337	
ディー・エヌ・エー	10.8	11.4	20,360	
電通グループ	36	38	164,160	
サイバーエージェント	28.8	30.4	36,784	
楽天グループ	36	38	25,802	
リクルートホールディングス	108	114	437,874	
日本郵政	36	38	45,486	
セコム	36	38	295,336	
合 計	株 数 ・ 金 額	6,728	7,273	30,531,752
	銘柄数<比率>	225	225	<98.8%>

*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 356	百万円 —
	日経225		

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年2月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 30,531,752	% 97.3
コール・ローン等、その他	844,606	2.7
投資信託財産総額	31,376,358	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 (2023年2月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	31,376,207,055
コール・ローン等	766,527,710
株式(評価額)	30,531,752,460
未収入金	28,901,685
未収配当金	49,025,200
(B) 負債	459,234,177
未払収益分配金	306,492,690
未払解約金	44,618,756
未払信託報酬	105,810,628
未払利息	177
その他未払費用	511,926
前受金	1,800,000
(C) 純資産総額(A-B)	30,916,972,878
元本	30,649,269,063
次期繰越損益金	267,703,815
(D) 受益権総口数	30,649,269,063口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,087円

(注) 期首元本額は29,008,317,920円、期中追加設定元本額は7,969,597,040円、期中一部解約元本額は6,328,645,897円、1口当たり純資産額は1.0087円です。

○損益の状況 (2022年2月18日～2023年2月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	576,633,473
受取配当金	576,894,531
受取利息	△ 5
その他収益金	15,777
支払利息	△ 276,830
(B) 有価証券売買損益	340,975,072
売買益	2,194,505,009
売買損	△ 1,853,529,937
(C) 先物取引等取引損益	91,114,917
取引益	309,843,515
取引損	△ 218,728,598
(D) 信託報酬等	△ 207,859,490
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	800,863,972
(F) 前期繰越損益金	3,927,525,353
(G) 追加信託差損益金	△ 4,154,192,820
(配当等相当額)	(31,552,104,767)
(売買損益相当額)	(△35,706,297,587)
(H) 計(E+F+G)	574,196,505
(I) 収益分配金	△ 306,492,690
次期繰越損益金(H+I)	267,703,815
追加信託差損益金	△ 4,154,192,820
(配当等相当額)	(31,552,104,767)
(売買損益相当額)	(△35,706,297,587)
分配準備積立金	6,254,718,683
繰越損益金	△ 1,832,822,048

* 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(D)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(G)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(2022年2月18日～2023年2月17日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年2月18日～ 2023年2月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	457,820,989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	31,552,104,767円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	6,103,390,384円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	38,113,316,140円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,435円
g. 分配金	306,492,690円
h. 分配金(1万口当たり)	100円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	100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。