

野村DC・JPX日経400ファンド

運用報告書(全体版)

第8期(決算日2022年9月6日)

作成対象期間(2021年9月7日～2022年9月6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	2015年4月27日以降、無期限とします。	
運用方針	JPX日経400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、JPX日経インデックス400の動きに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DC・JPX日経400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。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。 なお、上場投資信託証券に投資する場合があります。
主な投資制限	野村DC・JPX日経400ファンド	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/>

○最近5期の運用実績

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
		税金分配	期中騰落率	J P X 日経 インデックス400	期中騰落率			
4期(2018年9月6日)	円 10,760	円 5	% 8.0	14,960.51	% 6.0	% 97.1	% 2.8	百万円 396
5期(2019年9月6日)	10,097	5	△6.1	13,748.91	△8.1	97.9	2.1	581
6期(2020年9月7日)	10,927	5	8.3	14,546.93	5.8	98.2	1.8	794
7期(2021年9月6日)	14,129	5	29.3	18,474.37	27.0	98.4	1.5	1,224
8期(2022年9月6日)	13,572	5	△3.9	17,378.90	△5.9	97.1	2.8	1,414

*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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	J P X 日経 インデックス400	騰落率			
(期首) 2021年9月6日	円 14,129	% -	18,474.37	% -	% 98.4	% 1.5
9月末	14,101	△0.2	18,293.30	△1.0	96.8	3.1
10月末	13,895	△1.7	18,029.06	△2.4	97.4	2.5
11月末	13,406	△5.1	17,400.98	△5.8	96.3	3.7
12月末	13,889	△1.7	17,990.97	△2.6	98.5	1.5
2022年1月末	13,189	△6.7	17,087.09	△7.5	97.2	2.7
2月末	13,103	△7.3	16,973.17	△8.1	96.9	3.0
3月末	13,699	△3.0	17,557.08	△5.0	98.3	1.7
4月末	13,359	△5.4	17,122.20	△7.3	96.9	3.0
5月末	13,462	△4.7	17,245.93	△6.6	97.7	2.3
6月末	13,137	△7.0	16,811.46	△9.0	97.6	2.4
7月末	13,643	△3.4	17,462.60	△5.5	98.5	1.5
8月末	13,812	△2.2	17,679.30	△4.3	97.7	2.3
(期末) 2022年9月6日	13,577	△3.9	17,378.90	△5.9	97.1	2.8

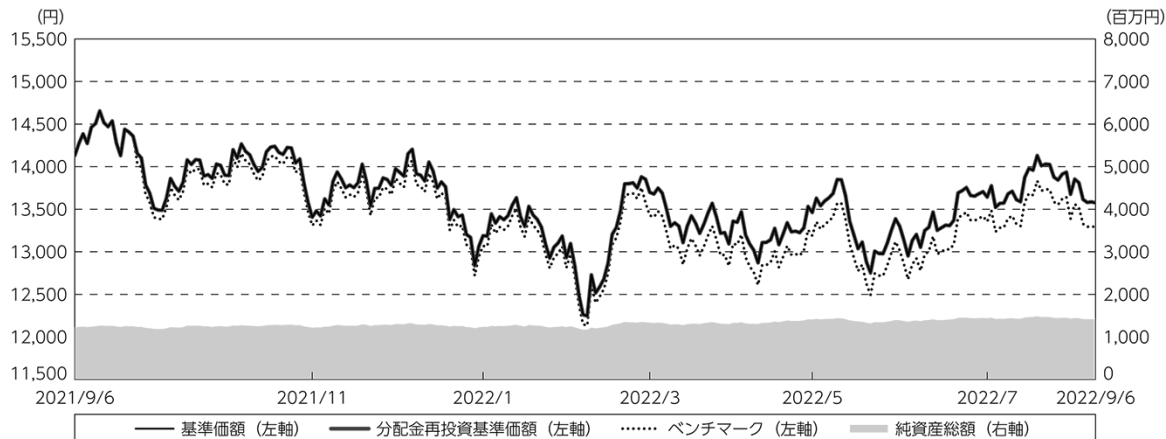
*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

*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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：14,129円

期末：13,572円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：△ 3.9%（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9月6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、JPX日経インデックス400です。ベンチマークは、作成期首（2021年9月6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、期首より菅首相の退陣発表を受けて国内政治の先行きへの期待感が高まったことなどから上昇しましたが、その後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。2021年11月下旬には、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により下落しましたが、その後はオミクロン株の重症化リスクについて楽観的な見方が広がったことなどから上昇しました。

2022年1月以降は、国内でのオミクロン株による新型コロナウイルス感染の再拡大や、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立、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、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）においてパウエル議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式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。しかし、8月下旬には米国の金融引き締め局面の長期化観測が広がり下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

【野村DC・JPX日経400ファンド】

主要投資対象である「JPX日経400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、実質株式組入比率を高位に維持しました。

【JPX日経400マザーファンド】

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。

○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-3.9%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の-5.9%を2.0ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

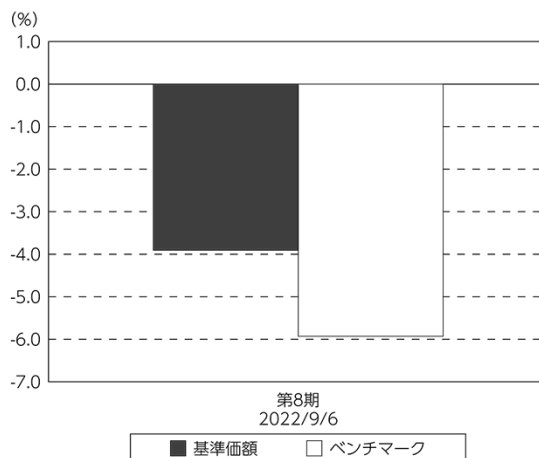
（プラス要因）

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、JPX日経インデックス400です。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案し、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ないます。

◎分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第8期
	2021年9月7日～ 2022年9月6日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.037%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,280

(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DC・JPX日経400ファンド]

主要投資対象である[JPX日経400マザーファンド]受益証券を高位に組み入れ、引き続き、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指します。

[JPX日経400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、JPX日経インデックス400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。

<p>①「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」という。)及び株式会社日本経済新聞社(以下「日経」という。)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、JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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。</p> <p>②「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJPX総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属している。</p> <p>③「野村DC・JPX日経400ファンド」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研及び日経は、その運用及び「野村DC・JPX日経400ファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。</p> <p>④JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」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。</p> <p>⑤JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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。</p>
--

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 37	% 0.275	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(19)	(0.143)	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)	(13)	(0.099)	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)	(4)	(0.033)	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	0.007	(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)	(0.007)	
(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	38	0.285	
期中の平均基準価額は、13,557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。

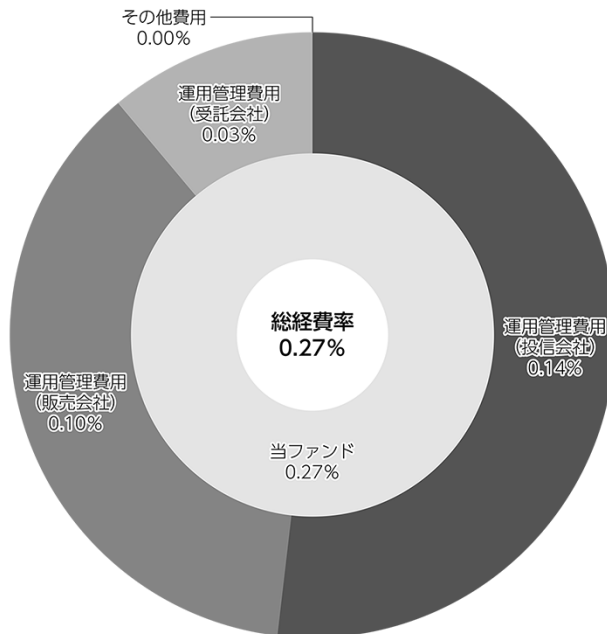
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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0.27%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9月7日～2022年9月6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
JPX日経400マザーファンド	千口 224,542	千円 422,922	千口 100,997	千円 193,350

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年9月7日～2022年9月6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
	JPX日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,004,993千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,186,037千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

*(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9月7日～2022年9月6日)

利害関係人の発行する有価証券等

<JPX日経400マザーファンド>

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	10	3	51

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。

○組入資産の明細

(2022年9月6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
JPX日経400マザーファンド	千口 621,859	千口 745,404	千円 1,413,883

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2022年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
JPX日経400マザーファンド	千円 1,413,883	% 99.6
コール・ローン等、その他	5,516	0.4
投資信託財産総額	1,419,399	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9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,419,399,937
コール・ローン等	3,986,712
JPX日経400マザーファンド(評価額)	1,413,883,530
未収入金	1,529,695
(B) 負債	5,374,993
未払収益分配金	520,935
未払解約金	2,943,772
未払信託報酬	1,887,694
未払利息	4
その他未払費用	22,588
(C) 純資産総額(A-B)	1,414,024,944
元本	1,041,870,968
次期繰越損益金	372,153,976
(D) 受益権総口数	1,041,870,968口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,572円

(注) 期首元本額は866,459,383円、期中追加設定元本額は440,025,063円、期中一部解約元本額は264,613,478円、1口当たり純資産額は1.3572円です。

○損益の状況 (2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 335
支払利息	△ 335
(B) 有価証券売買損益	△ 30,807,381
売買益	9,116,441
売買損	△ 39,923,822
(C) 信託報酬等	△ 3,653,722
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 34,461,438
(E) 前期繰越損益金	190,841,652
(F) 追加信託差損益金	216,294,697
(配当等相当額)	(226,186,400)
(売買損益相当額)	(△ 9,891,703)
(G) 計(D+E+F)	372,674,911
(H) 収益分配金	△ 520,935
次期繰越損益金(G+H)	372,153,976
追加信託差損益金	216,294,697
(配当等相当額)	(227,725,044)
(売買損益相当額)	(△ 11,430,347)
分配準備積立金	218,215,307
繰越損益金	△ 62,356,028

*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9月7日～2022年9月6日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年9月7日～ 2022年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	27,894,590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	227,725,044円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	190,841,652円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	446,461,286円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,285円
g. 分配金	520,935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
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

JPX日経400マザーファンド

運用報告書

第9期（決算日2022年9月6日）

作成対象期間（2021年9月7日～2022年9月6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	JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。 投資する株式は、原則として、東京証券取引所に上場している（上場予定を含みます。）銘柄のうち、JPX日経インデックス400に採用されているものおよび採用が決定されたものとします。 投資する上場投資信託証券は、野村アセットマネジメント株式会社が委託者であり、JPX日経インデックス400に連動する投資効果を目指して運用されるものとします。 株式の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。なお、上場投資信託証券に投資する場合があります。
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
	期騰落	期中率	JPX日経インデックス400	期騰落			
	円	%			%	%	百万円
5期(2018年9月6日)	14,847	8.3	14,960.51	6.0	97.1	2.8	14,511
6期(2019年9月6日)	13,978	△5.9	13,748.91	△8.1	97.9	2.1	12,785
7期(2020年9月7日)	15,175	8.6	14,546.93	5.8	98.2	1.8	11,065
8期(2021年9月6日)	19,684	29.7	18,474.37	27.0	98.4	1.5	12,267
9期(2022年9月6日)	18,968	△3.6	17,378.90	△5.9	97.1	2.8	12,635

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研（以下「JPX総研」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」という。）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、JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」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「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJPX総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属している。
- ③「JPX日経400マザーファンド」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研及び日経は、その運用及び「JPX日経400マザーファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」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。
- ⑤JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

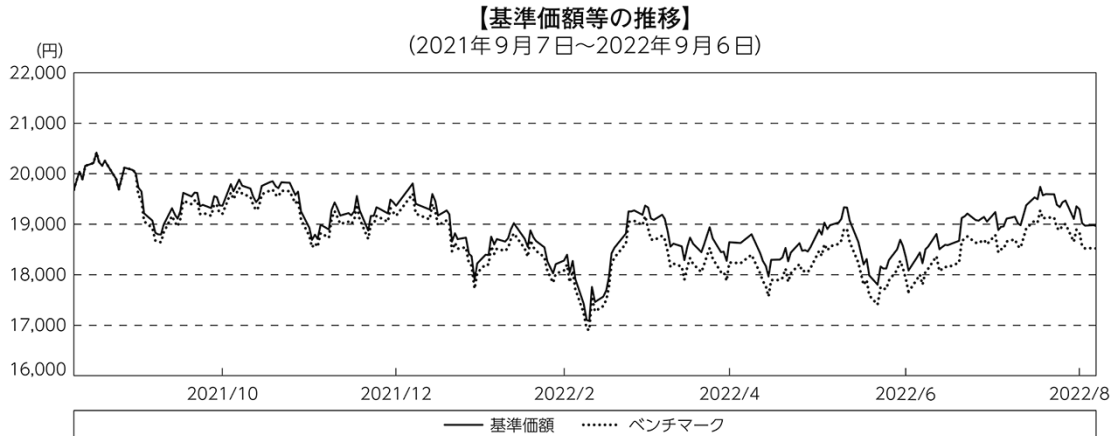
年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	JPX日経インデックス400	騰落		
(期首)	円	%			%	%
2021年9月6日	19,684	—	18,474.37	—	98.4	1.5
9月末	19,649	△0.2	18,293.30	△1.0	96.8	3.1
10月末	19,366	△1.6	18,029.06	△2.4	97.4	2.5
11月末	18,689	△5.1	17,400.98	△5.8	96.3	3.7
12月末	19,367	△1.6	17,990.97	△2.6	98.5	1.5
2022年1月末	18,395	△6.5	17,087.09	△7.5	97.3	2.7
2月末	18,279	△7.1	16,973.17	△8.1	97.0	3.0
3月末	19,116	△2.9	17,557.08	△5.0	98.3	1.7
4月末	18,645	△5.3	17,122.20	△7.3	96.9	3.0
5月末	18,793	△4.5	17,245.93	△6.6	97.7	2.3
6月末	18,344	△6.8	16,811.46	△9.0	97.6	2.4
7月末	19,055	△3.2	17,462.60	△5.5	98.5	1.5
8月末	19,296	△2.0	17,679.30	△4.3	97.7	2.3
(期末)						
2022年9月6日	18,968	△3.6	17,378.90	△5.9	97.1	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。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPX日経インデックス400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、期首より菅首相の退陣発表を受けて国内政治の先行きへの期待感が高まったことなどから上昇しましたが、その後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。2021年11月下旬には、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により下落しましたが、その後はオミクロン株の重症化リスクについて楽観的な見方が広がったことなどから上昇しました。

2022年1月以降は、国内でのオミクロン株による新型コロナウイルス感染の再拡大や、ウクライナを巡るロシアと欧米との対立、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、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）においてパウエル議長が利上げペースの緩和を示唆したことで米国株式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。しかし、8月下旬には米国の金融引き締め局面の長期化観測が広がり下落しました。

○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

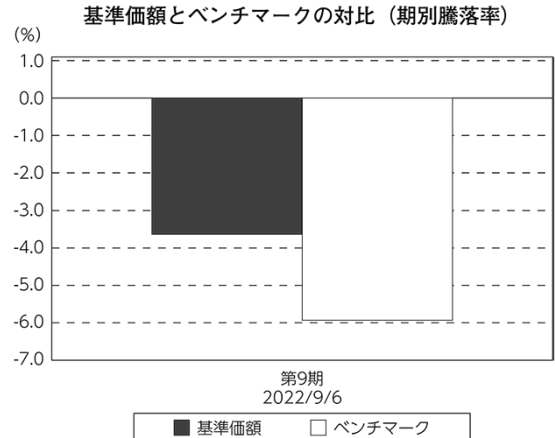
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。

○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-3.6%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の-5.9%を2.3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、JPX日経インデックス400です。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても引き続き実質株式組入比率を高位に維持し、JPX日経インデックス400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9月7日～2022年9月6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	0.007	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(1)	(0.007)	
期中の平均基準価額は、18,916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

(2021年9月7日～2022年9月6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		1,039	2,929,727	740	2,075,265
		(70)	(-)		

*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		5,007	4,835	-	-

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年9月7日～2022年9月6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	5,004,993千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,186,037千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

* (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9月7日～2022年9月6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 10	百万円 3	百万円 51

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。

(2022年9月6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	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)			
日本水産	7.5	8.6	4,747
鉱業 (0.4%)			
INPEX	32.3	29.5	45,548
建設業 (2.4%)			
ウエストホールディングス	—	0.8	3,588
ショーボンドホールディングス	—	1.1	6,523
ミライト・ワン	2.8	3	4,626
安藤・間	5.2	4.2	3,662
東急建設	2.4	—	—
コムシスホールディングス	2.9	3	7,671
東建コーポレーション	0.2	—	—
大成建設	5.8	6	25,260
大林組	18.6	20	19,180
清水建設	17.4	18.5	14,097
長谷工コーポレーション	6.1	5.8	9,303
鹿島建設	13.6	14.6	21,184
西松建設	1.3	1.3	5,252
三井住友建設	4.5	—	—
前田建設工業	4.7	—	—
戸田建設	7.7	8.2	5,510
熊谷組	0.9	1.1	2,902
大東建託	2	2.2	30,932
NIPPO	1.5	—	—
五洋建設	7.9	7.9	5,688
住友林業	4.8	4.3	9,885
大和ハウス工業	17.2	17	52,071
積水ハウス	20.2	20.4	50,398
関電工	3	3.5	2,901
エクシオグループ	2.8	3	6,345
九電工	1.3	1.4	3,908
インフロニア・ホールディングス	—	7.5	7,687
食料品 (3.8%)			
森永製菓	1.4	1.4	5,432
カルビー	2.7	3.1	8,428

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
森永乳業	1.1	1.2	4,824
ヤクルト本社	4.1	4.4	35,288
明治ホールディングス	3.9	3.8	24,776
プリマハム	0.8	0.9	1,898
日本ハム	2.3	2.4	9,420
アサヒグループホールディングス	14	12.9	58,798
キリンホールディングス	21.9	25.3	55,900
宝ホールディングス	—	3.8	4,043
サントリー食品インターナショナル	4	3.9	19,383
伊藤園	1.8	—	—
キッコーマン	4.3	4.1	34,809
味の素	14.1	13.7	52,046
キュービー	3.3	3	6,717
カゴメ	2.3	2.6	7,839
アリアケジャパン	0.5	—	—
ニチレイ	2.8	2.6	6,364
東洋水産	3.1	3.1	17,856
日清食品ホールディングス	2.3	2.2	21,516
日本たばこ産業	31.9	36.9	87,286
繊維製品 (0.4%)			
帝人	5.5	5.9	8,614
東レ	42	41.7	32,555
ゴールドウイン	1	1.1	8,503
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	26.1	25.9	14,374
大王製紙	2.8	2.9	3,561
レンゴー	6	5.2	4,201
化学 (7.0%)			
クラレ	8.5	9.1	9,664
旭化成	38.5	41.5	42,516
昭和電工	4.1	—	—
住友化学	45.7	45.8	25,006
日産化学	3.2	3	20,700
東ソー	9	8.3	15,305
トクヤマ	1.7	2	3,704

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デンカ	2.1	2.3	7,728
信越化学工業	9.2	10.6	171,985
エア・ウォーター	5.9	5.4	9,374
日本酸素ホールディングス	4.8	5.5	13,552
三菱瓦斯化学	5.8	5.2	10,722
三井化学	5	5.2	15,990
三菱ケミカルグループ	38.8	41.7	30,345
KHネオケム	—	0.9	2,291
ダイセル	7.8	9	7,920
積水化学工業	12.1	12.8	24,012
日本ゼオン	5.2	4.9	6,762
アイカ工業	1.6	1.6	4,984
UBE	2.9	3.2	6,624
日油	2.2	1.9	10,051
花王	13.1	14.2	83,254
日本ペイントホールディングス	21.8	25.2	25,704
関西ペイント	6.5	5.8	12,069
D I C	2.5	—	—
富士フイルムホールディングス	10.4	12	84,072
資生堂	11	11.9	59,678
ライオン	7.2	6.8	10,730
ファンケル	2.2	2.8	7,739
コーセー	1.1	1.2	15,504
ポーラ・オルビスホールディングス	2.5	—	—
小林製薬	1.7	1.7	13,634
タカラバイオ	—	1.8	3,342
デクセリアルズ	—	1.8	6,885
日東電工	3.6	4.1	35,424
エフピコ	1.1	1.3	4,270
ニフコ	2.2	2.3	7,049
ユニ・チャーム	11.4	11.9	54,751
医薬品 (6.9%)			
協和キリン	7	6.9	21,355
武田薬品工業	46.2	46.8	178,916
アステラス製薬	51.4	58.6	115,676
住友ファーマ	4.4	4.2	4,296
塩野義製薬	7.5	8	54,584
日本新薬	1.7	1.5	11,025
中外製薬	18.5	17.9	63,652
科研製薬	1	1	3,785

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エーザイ	6.5	7.6	43,168
ロート製薬	2.8	3.3	13,777
小野薬品工業	13.6	13.2	44,286
参天製薬	10.3	11.9	11,721
J C Rファーマ	1.7	1.9	3,910
東和薬品	0.9	1	2,172
第一三共	46.6	49.7	209,684
大塚ホールディングス	12.3	13.1	59,303
ペプチドリーム	3.1	2.8	4,519
サワイグループホールディングス	1.3	—	—
石油・石炭製品 (0.7%)			
出光興産	6.6	7	24,640
ENEOSホールディングス	89.1	103.1	53,405
コスモエネルギーホールディングス	1.9	2.7	10,800
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	3.4	3.2	7,382
TOYO TIRE	3.1	3.3	5,527
ブリヂストン	17.1	18.2	94,421
住友ゴム工業	5.3	5.6	6,725
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	5.4	5.8	27,521
太平洋セメント	3.4	3.9	8,073
東海カーボン	5	4.8	4,867
TOTO	4.2	4.1	19,249
日本碍子	6.5	6.7	13,078
日本特殊陶業	4.5	4.8	13,684
MARUWA	—	0.2	3,376
ニチアス	1.5	1.4	3,299
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	—	28.3	63,717
J F Eホールディングス	—	15.7	23,330
東京製鐵	—	2	2,622
非鉄金属 (0.7%)			
三井金属鉱業	1.6	1.8	5,706
住友金属鉱山	7.5	7.4	31,464
DOWAホールディングス	—	1.6	8,304
住友電気工業	20.4	23.7	37,765
アサヒホールディングス	2.2	2.7	5,556
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	7.5	11.2	21,481

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三和ホールディングス	5.5	6.4	8,691
リンナイ	1.1	1.2	12,660
機械 (5.8%)			
日本製鋼所	1.8	—	—
三浦工業	2.5	2.7	7,770
アマダ	8.6	10.7	11,748
F U J I	2.3	2.7	5,416
オーエスジー	2.7	—	—
DMG森精機	3.5	3.5	6,139
ディスコ	0.8	1	33,500
オプトラン	0.7	0.8	1,781
ナブテスコ	3.3	3.6	11,862
SMC	1.7	2	129,780
小松製作所	26.8	31.1	89,459
住友重機械工業	3.4	3.7	10,763
日立建機	2.8	2.7	7,713
ローツェ	—	0.3	2,499
クボタ	28.9	30.6	64,841
荏原製作所	2.5	2.4	12,552
ダイキン工業	7.5	7.5	180,225
ダイフク	3.3	3.2	24,864
竹内製作所	1	1	2,633
ホシザキ	1.7	3.7	14,818
日本精工	12.2	—	—
マキタ	7.7	7.7	24,162
三菱重工業	9.3	10.1	53,600
I H I	4	4.3	16,426
電気機器 (17.1%)			
イビデン	—	3.3	14,190
ブラザー工業	7.2	7.8	20,022
ミネベアミツミ	10.2	10.9	25,691
日立製作所	27	27.8	192,264
三菱電機	59.3	64	88,576
富士電機	3.6	3.8	22,230
安川電機	6.4	6.8	30,906
日本電産	13.3	15.2	138,365
オムロン	4.9	5.7	40,766
MC J	1.9	2.4	2,347
日本電気	7.5	8.1	39,852
富士通	5.3	6.2	100,037

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ルネサスエレクトロニクス	32	37.4	48,171
セイコーエプソン	7.4	7.7	16,470
ワコム	4.3	5.3	4,240
アルバック	1.1	1.4	7,630
エレコム	1.4	1.6	2,580
パナソニック ホールディングス	63.2	73.1	80,738
シャープ	—	6.5	6,506
アンリツ	3.6	4.3	6,957
ソニーグループ	15.9	16.1	173,477
T D K	2.9	9.9	49,104
横河電機	5.9	6.3	15,101
アズビル	4	4	15,760
日本光電工業	2.4	2.6	8,203
堀場製作所	1.1	1.3	8,190
アドバンテス	4.4	5.1	39,372
キーエンス	3.1	3.9	201,669
シスメックス	4.6	4.9	39,400
フェローテックホールディングス	—	1.6	4,960
レーザーテック	2.6	2.8	52,766
スタンレー電気	4.1	—	—
カシオ計算機	4.8	4.2	5,506
ファナック	5.2	6	135,330
浜松ホトニクス	4.3	4.6	26,910
新光電気工業	—	2	7,460
京セラ	9	9.6	73,795
太陽誘電	2.6	3	12,645
村田製作所	17.4	18.7	137,912
小糸製作所	3.5	3.4	16,303
S C R E E Nホールディングス	1	1.1	10,109
東京エレクトロン	3.5	4	170,800
輸送用機器 (6.1%)			
トヨタ紡織	1.7	2.4	4,761
豊田自動織機	4.8	4.9	36,946
デンソー	13	13.4	96,587
いすゞ自動車	15.7	19.9	33,770
トヨタ自動車	17.7	85.1	174,327
日野自動車	7.4	—	—
アイシン	4.3	5	20,400
本田技研工業	46.7	50.1	181,462
スズキ	11.7	13.6	66,300

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SUBARU	17	18	44,820
ヤマハ発動機	7.7	8.9	25,418
豊田合成	1.9	1.9	4,478
シマノ	2.4	2.3	55,522
テイ・エス テック	2.8	2.9	4,442
精密機器 (3.5%)			
テルモ	18.2	19.4	86,427
島津製作所	7.6	8.2	33,538
ブイ・テクノロジー	0.3	—	—
東京精密	1	1.1	5,060
オリンパス	31.1	32.8	97,580
HOYA	11.6	13.2	191,004
朝日インテック	6.5	7.5	18,060
その他製品 (2.1%)			
バンダイナムコホールディングス	4.9	5.7	56,025
パイロットコーポレーション	1	0.9	4,509
ヤマハ	3.5	4	21,240
ビジョン	3.6	3.6	7,254
任天堂	2.7	3	171,240
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	18.1	19.4	27,179
関西電力	22.5	24	31,512
中国電力	8.5	—	—
東北電力	13.9	—	—
九州電力	13.1	13.1	10,768
北海道電力	5.5	6	3,036
電源開発	4.7	5.1	10,710
イーレックス	0.9	0.9	2,502
レノバ	1	1.3	3,984
東京瓦斯	11.4	12.2	31,195
大阪瓦斯	10.7	11.5	26,093
陸運業 (1.3%)			
SBSホールディングス	—	0.5	1,448
東海旅客鉄道	4.9	4.8	76,896
阪急阪神ホールディングス	7.5	—	—
日本通運	1.9	—	—
ヤマトホールディングス	7.9	8.9	19,206
山九	1.4	1.6	6,800
センコーグループホールディングス	3.1	3	2,898
日立物流	1.2	1.3	11,492

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸和運輸機関	1.2	1.1	1,692
九州旅客鉄道	4.3	—	—
SGホールディングス	10.6	10.9	24,448
NIPPON EXPRESSホールディン	—	2.1	15,708
海運業 (0.9%)			
日本郵船	4.7	5.4	55,242
商船三井	3.3	10	34,950
川崎汽船	—	2	16,820
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
三井倉庫ホールディングス	—	0.6	1,989
近鉄エクスプレス	1.1	—	—
情報・通信業 (9.6%)			
NECネットエスアイ	1.9	2.2	3,726
システナ	2.1	9.6	4,060
日鉄ソリューションズ	0.8	1.2	4,464
T I S	5.8	5.9	24,278
コーエーテクモホールディングス	1.5	2.1	9,639
ネクソン	13.1	15.4	43,628
ティーガイア	0.6	0.6	996
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.6	1.7	3,847
GMOペイメントゲートウェイ	1.1	1.3	13,884
インターネットイニシアティブ	—	1.8	8,532
ラクス	2.3	3.1	4,984
アカツキ	0.2	—	—
チェンジ	—	1.4	2,518
野村総合研究所	10.1	11.7	43,348
インフォコム	0.5	0.7	1,362
オービック	1.8	2.1	42,693
ジャストシステム	0.8	1	3,370
Zホールディングス	79.9	97	39,624
トレンドマイクロ	3.1	3.3	27,291
日本オラクル	1.2	1.1	9,196
伊藤忠テクノソリューションズ	2.6	3.1	10,679
大塚商会	3.1	3.2	14,416
電通国際情報サービス	0.8	0.7	3,090
東映アニメーション	0.2	0.3	3,870
デジタルガレージ	1	1.1	4,136
ネットワンシステムズ	—	2.5	7,400
B I P R O G Y	2	2.1	6,415
USEN-NEXT HOLDINGS	0.6	0.5	1,005

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電信電話	59.3	45.9	171,069
KDD I	46.6	41.7	177,391
ソフトバンク	—	101.9	153,716
光通信	0.7	0.8	13,616
GMOインターネットグループ	—	2.1	5,420
東宝	3.4	4	20,840
エヌ・ティ・ティ・データ	15.5	17.9	34,564
D T S	—	1.3	4,524
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.5	3.1	18,848
カプコン	5	6.2	22,630
S C S K	1.3	4.7	10,593
N S D	—	2.1	5,216
コナミグループ	2.1	2.4	16,944
ソフトバンクグループ	22.1	34.1	186,833
卸売業 (6.6%)			
双日	32.2	6.9	15,980
アルフレッサ ホールディングス	6.1	7	11,634
神戸物産	4.5	4.7	16,144
ダイワボウホールディングス	2.7	2.9	5,547
T O K A I ホールディングス	2.8	3.3	2,900
シップヘルスケアホールディングス	2.1	1.9	4,972
コメダホールディングス	1.3	—	—
メディカルホールディングス	5.8	6.2	11,606
日本ライフライン	1.9	—	—
伊藤忠商事	40.8	40.5	149,890
丸紅	57.6	58.5	81,549
豊田通商	5.9	6	28,800
兼松	2.3	2.3	3,408
三井物産	46.6	48.9	156,431
住友商事	36.8	39.9	76,927
三菱商事	35.5	44.3	193,236
阪和興業	—	1.2	4,326
岩谷産業	1.4	1.5	8,190
P A L T A C	0.9	0.9	3,555
日鉄物産	0.4	0.4	2,140
ミスミグループ本社	7.3	8.5	28,517
小売業 (4.0%)			
ローソン	1.5	1.5	6,975
エービーシー・マート	0.9	1.1	6,545
日本マクドナルドホールディングス	2.7	3.4	16,711

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セリア	1.4	1.6	4,145
ビックカメラ	3.5	—	—
M o n o t a R O	7.4	8.5	20,281
マツキヨココカラ&カンパニー	2.4	4	21,040
Z O Z O	3.4	4.6	13,648
ウエルシアホールディングス	3.1	3.6	10,206
クリエイトSDホールディングス	0.9	1	3,025
ネクステージ	—	1.4	4,354
コスモス薬品	0.6	0.7	10,024
セブン&アイ・ホールディングス	22.8	22.6	125,656
ツルハホールディングス	1.3	1.5	11,325
クスリのアオキホールディングス	0.6	0.6	3,618
FOOD & L I F E C O M P A N I E	3.4	3.5	7,409
ノジマ	1	1.1	2,960
良品計画	6.7	7.8	9,812
コーナン商事	0.8	1	3,310
バン・バシフィック・インターナショナルホ	11.7	13.5	33,507
ゼンショーホールディングス	3.1	3.3	11,748
ワークマン	0.8	0.7	3,612
スギホールディングス	1.2	1.3	7,436
日本瓦斯	—	3.2	6,812
ライフコーポレーション	0.5	0.5	1,311
丸井グループ	4.9	4.9	11,799
イズミ	1.2	1.1	3,218
ヤオコー	0.7	0.8	5,200
ケーズホールディングス	5	5.7	6,942
アインホールディングス	0.8	—	—
ニトリホールディングス	2.3	2.7	33,709
ファーストリテイリング	0.8	0.9	72,603
サンドラッグ	2.2	2.5	8,412
銀行業 (5.3%)			
めぶきフィナンシャルグループ	30.4	27.8	7,367
コンコルディア・フィナンシャルグループ	35.6	33.5	14,706
新生銀行	4.8	4.4	8,456
あおぞら銀行	3.5	3.8	10,184
三菱UFJフィナンシャル・グループ	286.1	245	175,983
りそなホールディングス	67.4	71.5	36,700
三井住友トラスト・ホールディングス	11	11.2	47,465
三井住友フィナンシャルグループ	40.4	43.9	184,906
千葉銀行	19.5	19.1	14,076

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ふくおかフィナンシャルグループ	5.3	4.9	11,946
セブン銀行	19.5	20.1	5,266
みずほフィナンシャルグループ	79.4	81.1	129,719
証券、商品先物取引業 (0.7%)			
F P G	2	—	—
GMOフィナンシャルホールディングス	1.1	1.3	964
S B I ホールディングス	7.2	—	—
ジャフコ グループ	0.7	2.3	4,979
大和証券グループ本社	43.8	43.4	26,304
野村ホールディングス	89.2	103.2	51,362
マネックスグループ	—	5.7	2,798
保険業 (2.9%)			
S O M P Oホールディングス	10.3	9.6	56,486
MS&ADインシュアランスグループホール	14.2	13.9	57,059
第一生命ホールディングス	28.8	32.9	76,805
東京海上ホールディングス	19.2	18.8	142,560
T & Dホールディングス	17.5	15	22,350
その他金融業 (1.4%)			
全国保証	1.5	1.6	7,416
芙蓉総合リース	0.6	0.6	4,782
みずほリース	0.9	0.8	2,624
東京センチュリー	1.4	1	4,670
イオンフィナンシャルサービス	3.6	3.7	5,302
アコム	11.5	13.3	4,295
オリエントコーポレーション	15.8	18.3	2,159
オリックス	35.5	40.2	90,349
三菱HCキャピタル	20.2	21.9	14,541
日本取引所グループ	15.8	15.7	31,949
不動産業 (2.3%)			
いちご	6.5	—	—
ヒューリック	12.4	13.1	13,794
野村不動産ホールディングス	3.4	3.5	11,935
サムティ	0.8	—	—
ブレサンスコーポレーション	1	0.7	1,045
オープンハウスグループ	1.9	2.1	10,941
東急不動産ホールディングス	15.9	18.4	13,634
飯田グループホールディングス	4.9	5.5	11,649
ケイアイスター不動産	—	0.3	1,450
三井不動産	26.6	26.4	74,329
三菱地所	38.4	38.5	72,226
東京建物	5.8	5.3	10,992
住友不動産	13.1	12.2	40,870
スターツコーポレーション	0.7	0.9	2,374

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日本エスコン	1.1	1.3	1,028	
イオンモール	2.9	3.4	5,620	
カチタス	1.4	1.7	5,703	
サービス業 (4.0%)				
ミクシィ	1.4	—	—	
日本M&Aセンターホールディングス	9.3	—	—	
U T グループ	0.8	0.9	2,448	
エス・エム・エス	1.9	2.2	6,597	
パーソルホールディングス	5.7	6.5	18,083	
総合警備保障	2.3	2.4	8,472	
カカコム	4.2	4.8	12,187	
ディップ	0.9	1.2	4,062	
ベネフィット・ワン	2.1	2.4	4,802	
エムスリー	10	11.6	50,146	
アウトソーシング	3.2	—	—	
博報堂D Yホールディングス	7.9	8.3	10,233	
バリュエコマース	—	0.4	973	
H. U. グループホールディングス	—	1.7	4,669	
オリエンタルランド	6	—	—	
ビー・エム・エル	—	0.8	2,788	
ユニー・エス・エス	6.3	7.3	17,388	
サイバーエージェント	—	14	18,480	
フルキャストホールディングス	0.5	0.6	1,477	
エン・ジャパン	1	1.2	2,821	
テクノプロ・ホールディングス	3.4	3.9	11,856	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.2	—	—	
ジャパンマテリアル	1.7	2	3,808	
リクルートホールディングス	31.4	44.7	207,139	
ベルシステム24ホールディングス	0.9	0.9	1,277	
ペイカレント・コンサルティング	0.4	0.5	20,350	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	1.6	2.1	3,832	
リログループ	3.1	3.6	7,855	
カナモト	1	—	—	
トランス・コスモス	—	0.8	2,972	
セコム	5.6	6.5	56,329	
メイテック	0.7	2.3	5,471	
イオンディライト	0.7	0.8	2,243	
合 計	株 数・金 額	3,950	4,319	12,274,147
	銘柄数<比率>	400	400	<97.1%>

*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	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	J P X日経400	百万円 357	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年9月6日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
株式	千円 12,274,147	% 96.9
コール・ローン等、その他	395,407	3.1
投資信託財産総額	12,669,554	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9月6日現在)

項目	当期末
(A) 資産	12,669,554,788 円
コール・ローン等	364,195,202
株式(評価額)	12,274,147,960
未収配当金	7,949,125
差入委託証拠金	23,262,501
(B) 負債	34,414,670
未払金	8,505,130
未払解約金	25,909,167
未払利息	373
(C) 純資産総額(A-B)	12,635,140,118
元本	6,661,209,500
次期繰越損益金	5,973,930,618
(D) 受益権総口数	6,661,209,500口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,968円

(注) 期首元本額は6,232,070,393円、期中追加設定元本額は1,960,945,166円、期中一部解約元本額は1,531,806,059円、1口当たり純資産額は1.8968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・JPX日経400 4,616,403,771円
 ・JPX日経400ファンド 1,299,401,084円
 ・野村DC・JPX日経400ファンド 745,404,645円

○損益の状況

(2021年9月7日~2022年9月6日)

項目	当期
(A) 配当等収益	303,624,877 円
受取配当金	299,229,477
その他収益金	4,440,438
支払利息	△ 45,038
(B) 有価証券売買損益	△ 655,927,037
売買益	811,634,059
売買損	△1,467,561,096
(C) 先物取引等取引損益	△ 3,984,618
取引益	90,734,353
取引損	△ 94,718,971
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 356,286,778
(E) 前期繰越損益金	6,035,056,626
(F) 追加信託差損益金	1,719,636,698
(G) 解約差損益金	△1,424,475,928
(H) 計(D+E+F+G)	5,973,930,618
次期繰越損益金(H)	5,973,930,618

*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。