

# 野村DC・JPX日経400ファンド

## 運用報告書(全体版)

第9期(決算日2023年9月6日)

作成対象期間(2022年9月7日～2023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



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
		税金配分	騰落率	J P X 日経 インデックス400	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
9期(2023年9月6日)	17,307	5	27.6	21,621.32	24.4	98.9	1.1	2,537

\*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	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) 2022年9月6日	円 13,572	% -	17,378.90	% -	97.1	2.8	
9月末	13,008	△ 4.2	16,468.29	△ 5.2	96.7	3.3	
10月末	13,678	0.8	17,322.84	△ 0.3	98.1	1.9	
11月末	14,135	4.1	17,899.26	3.0	97.6	2.4	
12月末	13,476	△ 0.7	17,039.51	△ 2.0	96.5	3.5	
2023年1月末	14,077	3.7	17,804.63	2.4	97.6	2.4	
2月末	14,211	4.7	17,972.44	3.4	98.3	1.7	
3月末	14,448	6.5	18,057.76	3.9	96.5	3.4	
4月末	14,814	9.2	18,520.14	6.6	97.6	2.3	
5月末	15,464	13.9	19,331.68	11.2	97.8	2.2	
6月末	16,631	22.5	20,765.91	19.5	97.8	2.2	
7月末	16,851	24.2	21,043.08	21.1	97.7	2.3	
8月末	16,880	24.4	21,080.70	21.3	98.3	1.6	
(期末) 2023年9月6日	円 17,312	% 27.6	21,621.32	% 24.4	98.9	1.1	

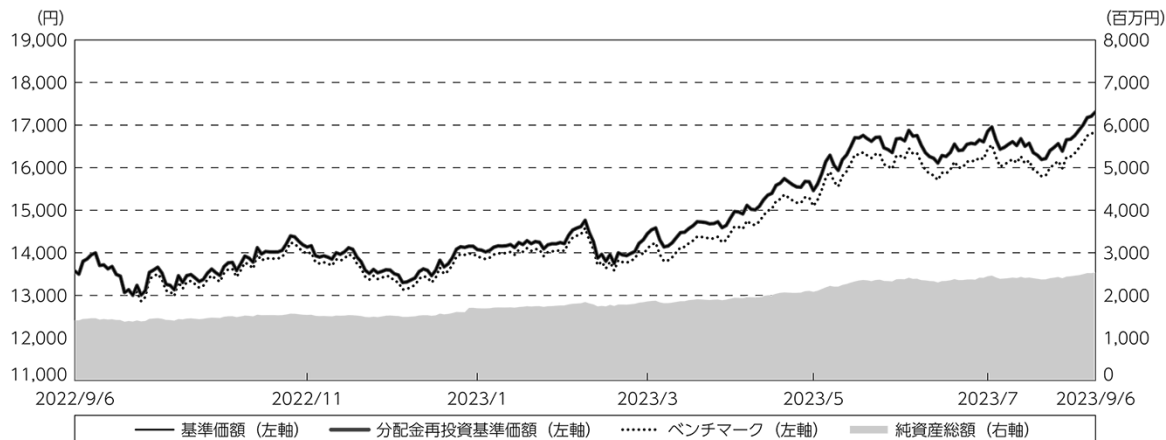
\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\*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



- (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(2022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、期首より日米金利差拡大などから円安米ドル高が進行し輸出企業の収益改善が期待されたことなどから上昇して始まりましたが、FRB(米連邦準備制度理事会)が市場想定よりも金融引き締めに積極的な姿勢を示したことなどから、下落基調となりました。

2022年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下落しました。

2023年1月以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したことやFRBによる利上げペースの減速期待から米国株式市場が上昇したことなどから上昇しました。3月以降は、東京証券取引所による低PBR（株価純資産倍率）企業への改善策開示などを求める方針を受けて日本企業の資本効率の底上げへの期待が高まったことなどから上昇しました。その後も政府による新型コロナウイルスの感染症法上の分類見直しを受けて国内経済の回復期待が高まったことや米連邦政府の債務上限引き上げ法案の成立が好感されたことなどから上昇しました。

7月以降は、米ドル円の動きや米国の追加利上げの行方を巡り、一進一退となりました。8月下旬には、米国の経済指標を受けて米国の追加利上げ観測が後退し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

### [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+27.6%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+24.4%を3.2ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

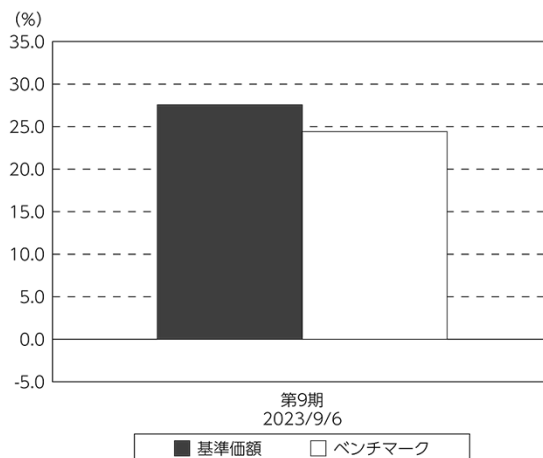
### (プラス要因)

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9期
	2022年9月7日～ 2023年9月6日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.029%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,306

(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。

- 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 「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。
- ④ JPX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。
- ⑤ JPX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。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 41	% 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 ）	(21)	(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 ）	(15)	(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 ）	( 5)	(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	42	0.285	
期中の平均基準価額は、14,806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。

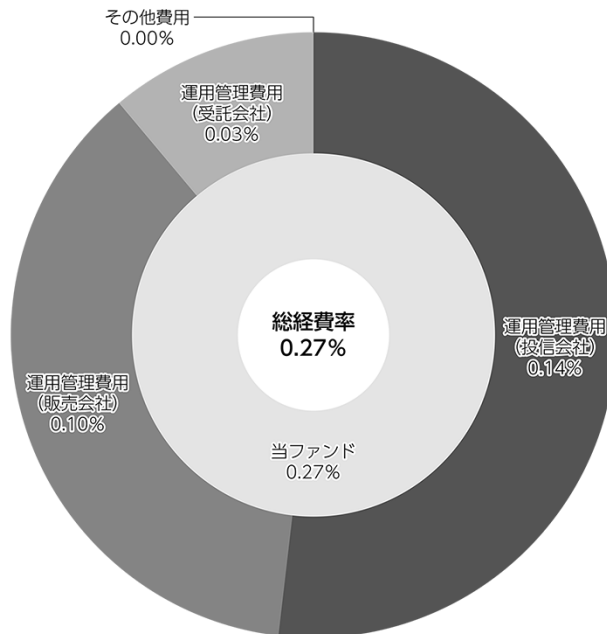
\* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 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、売買委託手数料およ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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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

(2022年9月7日～2023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 377,127	千円 784,679	千口 76,979	千円 163,423

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2022年9月7日～2023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	5,745,753千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,336,131千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.43	

\*(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9月7日～2023年9月6日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村DC・JPX日経400ファンド&gt;

該当事項はございません。

&lt;JPX日経400マザーファンド&gt;

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 3,002	百万円 4	% 0.1	百万円 2,743	百万円 4	% 0.1

平均保有割合 13.8%

※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

## &lt;JPX日経400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 13	百万円 7	百万円 68

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

## ○組入資産の明細

(2023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 745,404	千口 1,045,553	千円 2,536,825

\*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

(2023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 2,536,825	% 99.4
コール・ローン等、その他	15,568	0.6
投資信託財産総額	2,552,393	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9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,552,393,315
コール・ローン等	8,091,233
JPX日経400マザーファンド(評価額)	2,536,825,991
未収入金	7,476,091
(B) 負債	15,315,301
未払収益分配金	732,962
未払解約金	11,575,002
未払信託報酬	2,971,724
未払利息	15
その他未払費用	35,598
(C) 純資産総額(A-B)	2,537,078,014
元本	1,465,924,401
次期繰越損益金	1,071,153,613
(D) 受益権総口数	1,465,924,401口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,307円

(注) 期首元本額は1,041,870,968円、期中追加設定元本額は739,543,026円、期中一部解約元本額は315,489,593円、1口当たり純資産額は1.7307円です。

## ○損益の状況 (2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,922
支払利息	△ 1,922
(B) 有価証券売買損益	455,580,758
売買益	502,755,700
売買損	△ 47,174,942
(C) 信託報酬等	△ 5,134,731
(D) 当期損益金(A+B+C)	450,444,105
(E) 前期繰越損益金	121,754,279
(F) 追加信託差損益金	499,688,191
(配当等相当額)	( 456,977,377)
(売買損益相当額)	( 42,710,814)
(G) 計(D+E+F)	1,071,886,575
(H) 収益分配金	△ 732,962
次期繰越損益金(G+H)	1,071,153,613
追加信託差損益金	499,688,191
(配当等相当額)	( 459,104,128)
(売買損益相当額)	( 40,584,063)
分配準備積立金	571,465,422

\* 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(2022年9月7日～2023年9月6日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年9月7日～ 2023年9月6日
a. 配当等収益(経費控除後)	44,995,682円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	356,737,096円
c. 信託約款に定める収益調整金	499,688,191円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	170,465,606円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,071,886,575円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,311円
g. 分配金	732,962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10期（決算日2023年9月6日）

作成対象期間（2022年9月7日～2023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		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	騰落	期中率	JPX日経インデックス400	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
10期(2023年9月6日)	24,263	27.9	21,621.32	24.4	98.9	1.1	15,799

\*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

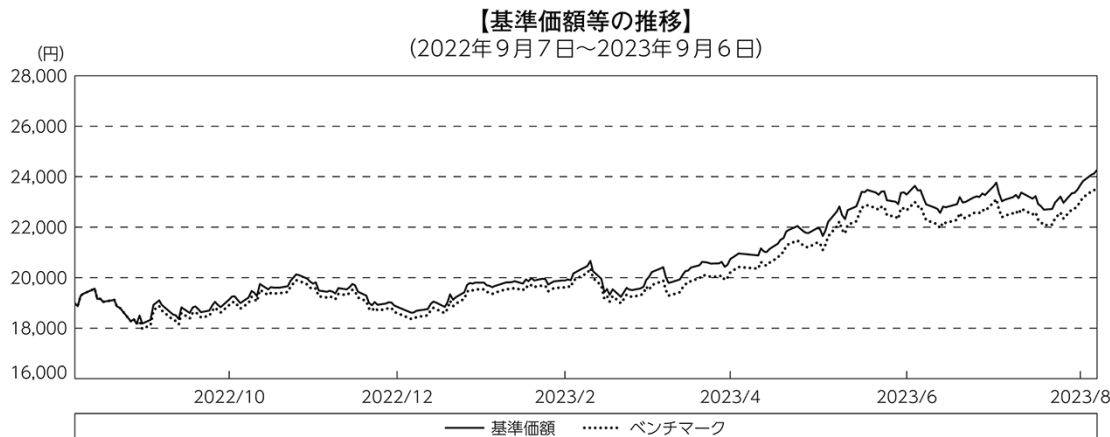
年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	率	JPX日経インデックス400	騰落率		
(期首) 2022年9月6日	円	%		%	%	%
	18,968	—	17,378.90	—	97.1	2.8
9月末	18,183	△ 4.1	16,468.29	△ 5.2	96.7	3.3
10月末	19,124	0.8	17,322.84	△ 0.3	98.1	1.9
11月末	19,768	4.2	17,899.26	3.0	97.6	2.4
12月末	18,851	△ 0.6	17,039.51	△ 2.0	96.5	3.5
2023年1月末	19,696	3.8	17,804.63	2.4	97.6	2.4
2月末	19,888	4.9	17,972.44	3.4	98.3	1.7
3月末	20,224	6.6	18,057.76	3.9	96.5	3.4
4月末	20,741	9.3	18,520.14	6.6	97.6	2.3
5月末	21,657	14.2	19,331.68	11.2	97.8	2.2
6月末	23,296	22.8	20,765.91	19.5	97.8	2.2
7月末	23,610	24.5	21,043.08	21.1	97.7	2.3
8月末	23,656	24.7	21,080.70	21.3	98.3	1.6
(期末) 2023年9月6日						
	24,263	27.9	21,621.32	24.4	98.9	1.1

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎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、期首より日米金利差拡大などから円安米ドル高が進行し輸出企業の収益改善が期待されたことなどから上昇して始まりましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）が市場想定よりも金融引き締めに積極的な姿勢を示したことなどから、下落基調となりました。

2022年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下落しました。

2023年1月以降は、日銀が現行の金融緩和策を維持したことやFRBによる利上げペースの減速期待から米国株式市場が上昇したことなどから上昇しました。3月以降は、東京証券取引所による低PBR（株価純資産倍率）企業への改善策開示などを求める方針を受けて日本企業の資本効率の底上げへの期待が高まったことなどから上昇しました。その後も政府による新型コロナウイルスの感染症法上の分類見直しを受けて国内経済の回復期待が高まったことや米連邦政府の債務上限引き上げ法案の成立が好感されたことなどから上昇しました。

7月以降は、米ドル円の動きや米国の追加利上げの行方を巡り、一進一退となりました。8月下旬には、米国の経済指標を受けて米国の追加利上げ観測が後退し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

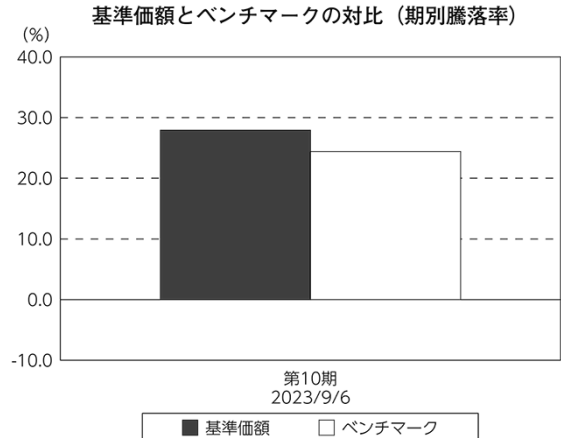
個別銘柄の時価構成比がポートフォリオとJPX日経インデックス400でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。

## ○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+27.9%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400の+24.4%を3.5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

(2022年9月7日～2023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)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.007)	
合 計	2	0.007	
期中の平均基準価額は、20,724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

(2022年9月7日～2023年9月6日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,177 (1,325)	千円 3,002,571 ( )	千株 948	千円 2,743,182

\*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 5,438	百万円 5,700	百万円 —	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。



## ○株式売買比率

(2022年9月7日～2023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	5,745,753千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,336,131千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.43

\*(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9月7日～2023年9月6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 3,002	百万円 4	% 0.1	百万円 2,743	百万円 4	% 0.1

## 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 7	百万円 68

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

## ○組入資産の明細

(2023年9月6日現在)

## 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>				
ニッスイ	8.6	9	6,876	
<b>鉱業 (0.5%)</b>				
三井松島ホールディングス	—	0.4	1,164	
I N P E X	29.5	33.4	73,463	
<b>建設業 (2.2%)</b>				
ウエストホールディングス	0.8	0.8	2,420	
ショーボンドホールディングス	1.1	1.2	7,207	
ミライト・ワン	3	3	5,869	
タマホーム	—	0.6	2,175	
安藤・間	4.2	5.2	6,437	
コムシスホールディングス	3	2.9	8,998	
大成建設	6	5.9	30,149	
大林組	20	22.6	30,713	
清水建設	18.5	17.9	18,177	
長谷工コーポレーション	5.8	6.5	12,132	
鹿島建設	14.6	14	35,028	
西松建設	1.3	—	—	
戸田建設	8.2	—	—	
熊谷組	1.1	—	—	
大東建託	2.2	—	—	
五洋建設	7.9	—	—	
住友林業	4.3	5.5	22,115	
大和ハウス工業	17	17.5	71,697	
積水ハウス	20.4	19.2	58,848	
関電工	3.5	3.5	4,669	
エクシオグループ	3	2.9	9,140	
九電工	1.4	1.5	6,943	
インフロニア・ホールディングス	7.5	6.6	10,111	
<b>食料品 (3.7%)</b>				
森永製菓	1.4	1.1	5,861	
カルビー	3.1	2.9	8,394	
森永乳業	1.2	1.2	7,126	
ヤクルト本社	4.4	4.5	34,420	
明治ホールディングス	3.8	7.8	28,665	

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
プリマハム	0.9	—	—	
日本ハム	2.4	2.5	11,410	
アサヒグループホールディングス	12.9	14.7	84,539	
キリンホールディングス	25.3	26.4	54,502	
宝ホールディングス	3.8	4.3	5,362	
サントリー食品インターナショナル	3.9	4.5	21,433	
キッコーマン	4.1	4.2	35,292	
味の素	13.7	15.3	93,330	
キュービー	3	—	—	
カゴメ	2.6	—	—	
ニチレイ	2.6	2.9	10,248	
東洋水産	3.1	3.2	19,097	
日清食品ホールディングス	2.2	2.2	27,555	
日本たばこ産業	36.9	38.5	123,623	
<b>繊維製品 (0.3%)</b>				
帝人	5.9	—	—	
東レ	41.7	43.2	35,277	
ゴールドウイン	1.1	1.1	11,962	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
王子ホールディングス	25.9	26.9	16,476	
大王製紙	2.9	—	—	
レンゴー	5.2	5.9	5,881	
<b>化学 (6.8%)</b>				
クラレ	9.1	9.4	15,815	
旭化成	41.5	40.3	39,103	
住友化学	45.8	47.9	19,868	
日産化学	3	3	18,906	
東ソー	8.3	8.6	17,010	
トクヤマ	2	2.1	5,066	
デンカ	2.3	2.3	6,466	
信越化学工業	10.6	47.5	226,290	
エア・ウォーター	5.4	6.1	11,364	
日本酸素ホールディングス	5.5	6.3	22,194	
三菱瓦斯化学	5.2	4.8	9,988	
三井化学	5.2	5.3	21,496	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京応化工業	—	1	10,105
三菱ケミカルグループ	41.7	43.5	39,289
KHネオケム	0.9	1	2,321
ダイセル	9	9	11,601
住友ベークライト	—	1	7,116
積水化学工業	12.8	13.1	29,173
日本ゼオン	4.9	3.9	6,347
アイカ工業	1.6	1.6	5,563
UBE	3.2	—	—
扶桑化学工業	—	0.6	2,604
ADEKA	—	2.2	6,296
日油	1.9	2	13,472
花王	14.2	14.6	82,490
日本ペイントホールディングス	25.2	34.3	41,194
関西ペイント	5.8	5.2	12,191
太陽ホールディングス	—	1	2,670
富士フイルムホールディングス	12	12.4	109,430
資生堂	11.9	13.5	80,595
ライオン	6.8	8.5	13,213
ファンケル	2.8	—	—
コーセー	1.2	1.3	15,405
小林製薬	1.7	1.9	13,680
タカラバイオ	1.8	1.7	2,415
デクセリアルズ	1.8	1.8	7,005
日東電工	4.1	4.7	48,574
エフピコ	1.3	—	—
ニフコ	2.3	2.3	10,161
ユニ・チャーム	11.9	13.5	77,706
<b>医薬品 (6.1%)</b>			
協和キリン	6.9	7.8	20,580
武田薬品工業	46.8	50	226,200
アステラス製薬	58.6	61	135,603
住友ファーマ	4.2	—	—
塩野義製薬	8	8.1	52,261
日本新薬	1.5	1.5	9,714
中外製薬	17.9	20.2	89,506
科研製薬	1	—	—
エーザイ	7.6	7.9	71,755
ロート製薬	3.3	6.3	23,996
小野薬品工業	13.2	12.5	34,937

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
参天製薬	11.9	—	—
JCRファーマ	1.9	2.2	2,747
東和薬品	1	—	—
第一三共	49.7	49.8	210,205
大塚ホールディングス	13.1	13.4	74,504
ペプチドリーム	2.8	3.1	5,724
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
出光興産	7	7.2	23,364
ENEOSホールディングス	103.1	109.6	62,932
コスモエネルギーホールディングス	2.7	2.6	14,352
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
横浜ゴム	3.2	3.3	9,805
TOYO TIRE	3.3	3.7	8,273
ブリヂストン	18.2	18.9	108,221
住友ゴム工業	5.6	6.3	10,004
<b>ガラス・土石製品 (0.6%)</b>			
AGC	5.8	6	31,410
太平洋セメント	3.9	—	—
東海カーボン	4.8	—	—
TOTO	4.1	4.3	17,505
日本碍子	6.7	7.5	14,733
日本特殊陶業	4.8	4.9	17,042
MARUWA	0.2	0.2	5,324
フジミインコーポレーテッド	—	1.5	5,062
ニチアス	1.4	1.6	4,928
<b>鉄鋼 (1.0%)</b>			
日本製鉄	28.3	29.8	108,084
JFEホールディングス	15.7	17.8	40,851
東京製鐵	2	1.9	3,376
丸一銅管	—	2	7,586
日本冶金工業	—	0.5	2,460
<b>非鉄金属 (0.6%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	—	0.9	1,356
三井金属鉱業	1.8	1.9	7,351
住友金属鉱山	7.4	7.7	36,028
DOWAホールディングス	1.6	1.5	7,348
住友電氣工業	23.7	22.9	42,136
AREホールディングス	2.7	2.7	5,246
<b>金属製品 (0.3%)</b>			
SUMCO	11.2	11.8	23,576

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	6.4	6.1	13,886
リンナイ	1.2	3.6	10,290
<b>機械 (6.3%)</b>			
三浦工業	2.7	2.7	9,055
アマダ	10.7	10.4	16,156
F U J I	2.7	2.8	6,946
DMG森精機	3.5	3.9	10,557
ディスコ	1	3.1	88,908
オプトラン	0.8	—	—
ナブテスコ	3.6	4.1	11,553
SMC	2	2.1	152,796
小松製作所	31.1	30.5	130,296
住友重機械工業	3.7	3.8	14,478
日立建機	2.7	2.6	12,261
ローツェ	0.3	0.3	3,603
クボタ	30.6	34.1	81,277
荏原製作所	2.4	2.7	20,106
ダイキン工業	7.5	7.7	201,162
オルガノ	—	0.9	3,649
ダイフク	3.2	10.1	28,234
SANKYO	—	1.3	8,269
竹内製作所	1	1.2	5,634
セガサミーホールディングス	—	5.2	14,794
ホシザキ	3.7	3.8	21,990
マキタ	7.7	8.1	32,092
三菱重工業	10.1	11.4	101,596
I H I	4.3	4.1	15,584
<b>電気機器 (17.4%)</b>			
イビデン	3.3	3.7	34,276
ブラザー工業	7.8	8.7	21,454
ミネベアミツミ	10.9	11.3	28,312
日立製作所	27.8	25.4	257,556
三菱電機	64	67.2	129,998
富士電機	3.8	4	28,048
安川電機	6.8	7.7	45,245
ニデック	15.2	15.8	122,276
オムロン	5.7	6	42,606
MC J	2.4	2.7	3,161
日本電気	8.1	9.2	73,774
富士通	6.2	6.5	122,460

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	37.4	42.5	103,742
セイコーエプソン	7.7	8.3	19,226
ワコム	5.3	4.9	3,033
アルバック	1.4	1.5	8,698
エレコム	1.6	1.6	2,825
パナソニック ホールディングス	73.1	76.8	133,171
シャープ	6.5	—	—
アンリツ	4.3	4.6	5,145
ソニーグループ	16.1	17.5	222,075
T D K	9.9	10.3	56,402
ヒロセ電機	—	1	17,850
横河電機	6.3	7.1	21,193
アズビル	4	4.5	22,117
日本光電工業	2.6	3	11,808
堀場製作所	1.3	1.2	9,394
アドバンテスト	5.1	5.1	94,299
キーエンス	3.9	3.3	200,376
シスメックス	4.9	5.6	43,764
フェローテックホールディングス	1.6	1.9	5,890
レーザーテック	2.8	3	67,545
日本電子	—	1.6	7,579
カシオ計算機	4.2	—	—
ファナック	6	31.4	130,812
ローム	—	3	36,120
浜松ホトニクス	4.6	5.2	34,975
三井ハイテック	—	0.7	6,958
新光電気工業	2	2.3	13,903
京セラ	9.6	10	76,060
太陽誘電	3	3.1	13,609
村田製作所	18.7	19.5	166,530
小糸製作所	3.4	7.7	19,096
S C R E E Nホールディングス	1.1	1.1	16,533
東京エレクトロン	4	11	243,265
<b>輸送用機器 (6.7%)</b>			
トヨタ紡織	2.4	2.7	7,622
豊田自動織機	4.9	4.7	50,102
デンソー	13.4	13.3	137,455
いすゞ自動車	19.9	18.7	36,249
トヨタ自動車	85.1	98.1	260,063
K Y B	—	0.6	3,000

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイシン	5	5	25,070
マツダ	—	21.3	35,784
本田技研工業	50.1	52.2	258,912
スズキ	13.6	11.8	71,036
SUBARU	18	20.4	60,027
ヤマハ発動機	8.9	9.3	36,242
豊田合成	1.9	1.9	6,289
シマノ	2.3	2.6	57,174
ティ・エス テック	2.9	—	—
<b>精密機器 (3.0%)</b>			
テルモ	19.4	19.8	86,605
島津製作所	8.2	7.8	33,813
ナカニシ	—	2.7	10,017
東京精密	1.1	1.4	11,592
オリンパス	32.8	39.6	81,021
HOYA	13.2	13.3	221,179
朝日インテック	7.5	7.2	21,031
<b>その他製品 (2.0%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	5.7	17.6	59,540
パイロットコーポレーション	0.9	0.9	4,257
ヤマハ	4	4.1	18,655
ビジョン	3.6	4.1	7,025
任天堂	3	34.6	218,775
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>			
中部電力	19.4	23.7	45,539
関西電力	24	24.9	53,061
九州電力	13.1	—	—
北海道電力	6	—	—
電源開発	5.1	4.8	11,208
イーレックス	0.9	1.1	980
レノバ	1.3	1.7	2,448
東京瓦斯	12.2	13.6	46,933
大阪瓦斯	11.5	13	31,167
<b>陸運業 (0.5%)</b>			
SBSホールディングス	0.5	0.6	1,821
東海旅客鉄道	4.8	—	—
ヤマトホールディングス	8.9	8.2	22,222
山九	1.6	1.6	8,342
センコーグループホールディングス	3	3.4	3,692
日立物流	1.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
AZ-COM丸和ホールディングス	1.1	1.6	3,572
SGホールディングス	10.9	12.3	26,192
NIPPON EXPRESSホールディン	2.1	2.2	16,750
<b>海運業 (0.9%)</b>			
日本郵船	5.4	17.2	68,748
商船三井	10	11.3	48,126
川崎汽船	2	4.8	25,872
NSユナイテッド海運	—	0.3	1,258
<b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b>			
三井倉庫ホールディングス	0.6	0.6	2,505
<b>情報・通信業 (9.1%)</b>			
NECネットエスアイ	2.2	2.2	4,512
システナ	9.6	10.9	3,150
日鉄ソリューションズ	1.2	1.1	4,493
TIS	5.9	7.1	24,495
コーエーテクモホールディングス	2.1	4	9,126
ネクソン	15.4	14.4	42,559
SHIFT	—	0.4	11,774
ティーガイア	0.6	0.7	1,255
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.7	1.7	4,068
GMOペイメントゲートウェイ	1.3	1.3	12,408
インターネットイニシアティブ	1.8	3.5	9,261
ラクス	3.1	3.1	7,520
チェンジホールディングス	1.4	1.6	3,278
野村総合研究所	11.7	12.9	55,289
インフォコム	0.7	—	—
オービック	2.1	2.2	56,133
ジャストシステム	1	0.9	2,760
Zホールディングス	97	91.9	40,803
トレンドマイクロ	3.3	3.1	19,266
日本オラクル	1.1	1.2	12,492
伊藤忠テクノソリューションズ	3.1	3.5	15,137
大塚商会	3.2	3.2	21,043
電通国際情報サービス	0.7	0.8	4,744
東映アニメーション	0.3	0.3	4,029
デジタルガレージ	1.1	1.1	4,103
ネットワンシステムズ	2.5	2.4	6,868
BIPROGY	2.1	2.4	9,367
USEN-NEXT HOLDINGS	0.5	0.7	2,506
日本電信電話	45.9	1,327.9	224,547

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KDD I	41.7	49.9	219,011
ソフトバンク	101.9	103.8	175,837
光通信	0.8	0.8	19,240
GMOインターネットグループ	2.1	2.4	5,814
KADOKAWA	—	3.4	11,311
東宝	4	4	22,400
NTTデータグループ	17.9	20.3	40,153
DTS	1.3	1.4	4,662
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.1	3.2	17,916
カプコン	6.2	6.4	39,987
SCSK	4.7	5.3	13,705
NSD	2.1	2.3	5,715
コナミグループ	2.4	2.8	23,730
ソフトバンクグループ	34.1	31.9	204,160
<b>卸売業 (7.7%)</b>			
双日	6.9	6.8	22,385
アルフレッサ ホールディングス	7	6.8	16,989
神戸物産	4.7	5.3	19,154
ダイワボウホールディングス	2.9	2.8	8,405
マクニカホールディングス	—	1.6	11,280
TOKAIホールディングス	3.3	—	—
シップヘルスケアホールディングス	1.9	2.4	5,822
メディバルホールディングス	6.2	6.5	16,506
IDOM	—	2.1	1,633
伊藤忠商事	40.5	39.8	228,611
丸紅	58.5	53.2	131,749
豊田通商	6	6	54,426
兼松	2.3	2.6	5,699
三井物産	48.9	41.8	236,379
住友商事	39.9	41.2	128,708
三菱商事	44.3	32.7	248,585
キャノンマーケティングジャパン	—	1.6	6,240
阪和興業	1.2	1.2	5,952
岩谷産業	1.5	1.6	12,387
稲畑産業	—	1.3	4,277
伊藤忠エネクス	—	1.7	2,561
加賀電子	—	0.6	4,092
PALTAC	0.9	1.1	5,349
日鉄物産	0.4	—	—
ミスミグループ本社	8.5	10.3	26,599

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>小売業 (4.0%)</b>			
ローソン	1.5	1.7	12,020
エービーシー・マート	1.1	3	8,017
アスクル	—	1.4	2,801
日本マクドナルドホールディングス	3.4	4.2	24,150
セリア	1.6	1.8	4,127
Monotaro	8.5	9.7	16,994
マツキヨココカラ&カンパニー	4	4.1	35,588
ZOZO	4.6	4.5	13,464
ウエルシアホールディングス	3.6	3.5	9,511
クリエイトSDホールディングス	1	1.1	4,185
ネクステージ	1.4	1.6	4,432
コスモス薬品	0.7	0.7	11,840
セブン&アイ・ホールディングス	22.6	23.5	140,812
ツルハホールディングス	1.5	1.4	14,980
クスリのアオキホールディングス	0.6	0.6	5,500
FOOD & LIFE COMPANIE	3.5	3.6	10,400
ノジマ	1.1	2.2	2,866
良品計画	7.8	7.4	14,126
コーナン商事	1	0.9	3,330
パン・パシフィック・インターナショナルホ	13.5	13.8	42,159
ゼンショーホールディングス	3.3	3.7	25,681
ワークマン	0.7	0.8	4,144
VTホールディングス	—	2.6	1,370
スギホールディングス	1.3	1.4	9,104
日本瓦斯	3.2	3.6	8,395
ライフコーポレーション	0.5	0.6	2,214
コメリ	—	1	3,155
しまむら	—	0.8	12,124
丸井グループ	4.9	—	—
イズミ	1.1	1	3,852
ヤオコー	0.8	0.8	6,327
ケーズホールディングス	5.7	4.8	6,535
ニトリホールディングス	2.7	2.8	49,434
ファーストリテイリング	0.9	3.1	105,741
サンドラッグ	2.5	2.6	11,325
<b>銀行業 (6.1%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	27.8	31.5	13,160
コンコルディア・フィナンシャルグループ	33.5	34	23,405
SBI新生銀行	4.4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あおぞら銀行	3.8	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	245	212.6	261,498
りそなホールディングス	71.5	79.7	65,696
三井住友トラスト・ホールディングス	11.2	11.4	65,652
三井住友フィナンシャルグループ	43.9	35.8	250,671
千葉銀行	19.1	17.7	19,257
ふくおかフィナンシャルグループ	4.9	5.1	18,472
セブン銀行	20.1	22.7	7,218
みずほフィナンシャルグループ	81.1	91.7	230,487
<b>証券、商品先物取引業 (0.9%)</b>			
GMOフィナンシャルホールディングス	1.3	—	—
SBIホールディングス	—	9.2	28,823
ジャフコ グループ	2.3	2.1	3,994
大和証券グループ本社	43.4	45.4	39,075
野村ホールディングス	103.2	114.3	68,625
マネックスグループ	5.7	6.8	3,712
<b>保険業 (2.8%)</b>			
SOMPOホールディングス	9.6	10.9	71,187
MS&ADインシュアランスグループホール	13.9	12.9	71,285
第一生命ホールディングス	32.9	31	90,613
東京海上ホールディングス	18.8	62.7	209,418
T&Dホールディングス	15	—	—
<b>その他金融業 (1.5%)</b>			
全国保証	1.6	1.7	8,603
芙蓉総合リース	0.6	0.6	7,524
みずほリース	0.8	0.9	4,432
東京センチュリー	1	1.2	7,110
イオンフィナンシャルサービス	3.7	3.6	4,676
アコム	13.3	11.3	4,088
ジャックス	—	0.7	3,717
オリエントコーポレーション	18.3	1.7	1,946
オリックス	40.2	41.6	119,724
三菱HCキャピタル	21.9	24.7	24,635
日本取引所グループ	15.7	17.8	46,369
<b>不動産業 (2.3%)</b>			
大東建託	—	2.3	37,386
ヒューリック	13.1	14.8	19,772
野村不動産ホールディングス	3.5	4	15,368
ブレサンスコーポレーション	0.7	1	1,980
オープンハウスグループ	2.1	2.3	12,102
東急不動産ホールディングス	18.4	19.1	18,322
飯田グループホールディングス	5.5	5.4	13,807
ケイアイスター不動産	0.3	0.3	1,461
三井不動産	26.4	27.1	92,411

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
三菱地所	38.5	38.3	75,585	
東京建物	5.3	5.5	11,195	
住友不動産	12.2	11.5	46,862	
スターツコーポレーション	0.9	0.9	2,772	
日本エスコ	1.3	—	—	
イオンモール	3.4	—	—	
カチタス	1.7	1.7	4,066	
<b>サービス業 (3.6%)</b>				
日本M&Aセンターホールディングス	—	11.4	9,350	
UTグループ	0.9	1	2,466	
パソナグループ	—	0.8	1,363	
エス・エム・エス	2.2	2.5	7,171	
パーソルホールディングス	6.5	7.3	19,100	
総合警備保障	2.4	12.3	11,575	
カカコム	4.8	4.9	8,604	
ディップ	1.2	1.2	4,326	
ベネフィット・ワン	2.4	3.1	3,825	
エムスリー	11.6	13.1	38,907	
博報堂DYホールディングス	8.3	8.4	11,932	
バリューコマース	0.4	—	—	
H. U. グループホールディングス	1.7	1.9	4,994	
ビー・エム・エル	0.8	0.8	2,340	
ユー・エス・エス	7.3	6.8	17,374	
サイバーエージェント	14	14.6	13,592	
フルキャストホールディングス	0.6	0.6	1,272	
エン・ジャパン	1.2	—	—	
テクノプロ・ホールディングス	3.9	3.9	14,266	
ジャパンマテリアル	2	2	5,270	
リクルートホールディングス	44.7	49	261,611	
ベルシステム24ホールディングス	0.9	0.9	1,444	
ペイカレント・コンサルティング	0.5	5.2	26,904	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	2.1	2.4	5,635	
リログループ	3.6	3.7	6,343	
トランス・コスモス	0.8	0.8	2,588	
セコム	6.5	6.7	68,340	
メイテック	2.3	2.6	6,840	
イオンディライト	0.8	0.7	2,254	
合 計	株 数・金 額	4,319	5,874	15,625,440
	銘柄数<比率>	400	400	<98.9%>

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいてい  
ます。

\*銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

\*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	J P X日経400	百万円 170	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 15,625,440	% 98.5
コール・ローン等、その他	241,427	1.5
投資信託財産総額	15,866,867	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9月6日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	15,866,867,053 円
コール・ローン等	222,806,474
株式(評価額)	15,625,440,920
未収入金	11,533,883
未収配当金	8,749,776
差入委託証拠金	△ 1,664,000
(B) 負債	67,846,578
未払解約金	67,846,161
未払利息	417
(C) 純資産総額(A-B)	15,799,020,475
元本	6,511,674,740
次期繰越損益金	9,287,345,735
(D) 受益権総口数	6,511,674,740口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,263円

(注) 期首元本額は6,661,209,500円、期中追加設定元本額は1,576,995,820円、期中一部解約元本額は1,726,530,580円、1口当たり純資産額は2,4263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 4,300,402,536円  
 ・JPX日経400ファンド 1,165,718,896円  
 ・野村DC・JPX日経400ファンド 1,045,553,308円

## ○損益の状況

(2022年9月7日~2023年9月6日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	356,585,804 円
受取配当金	356,689,611
受取利息	34
その他収益金	5,712
支払利息	△ 109,553
(B) 有価証券売買損益	3,091,904,638
売買益	3,339,655,290
売買損	△ 247,750,652
(C) 先物取引等取引損益	75,494,910
取引益	128,604,138
取引損	△ 53,109,228
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,523,985,352
(E) 前期繰越損益金	5,973,930,618
(F) 追加信託差損益金	1,645,138,502
(G) 解約差損益金	△1,855,708,737
(H) 計(D+E+F+G)	9,287,345,735
次期繰越損益金(H)	9,287,345,735

\*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。