

野村インデックスファンド・ 日経225

愛称：Funds-i 日経225

運用報告書(全体版)

第13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	2010年11月26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、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ないます。	
主な投資対象	野村インデックス ファンド・日経225	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	野村インデックス ファンド・日経225	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、利子・配当等収益等を中心として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
		税金配分	期末騰落率	日経平均株価 (日経225)	期末騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
9期(2019年9月6日)	23,803	0	△ 4.1	21,200	△ 5.7	98.3	1.7	41,137
10期(2020年9月7日)	26,366	0	10.8	23,090	8.9	97.3	2.6	35,596
11期(2021年9月6日)	34,217	0	29.8	29,660	28.5	98.9	1.0	51,306
12期(2022年9月6日)	32,326	0	△ 5.5	27,627	△ 6.9	96.5	3.5	57,865
13期(2023年9月6日)	39,598	0	22.5	33,241	20.3	98.7	1.3	66,944

*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	騰落率	日経平均株価 (日経225)	騰落率		
(期首) 2022年9月6日	円 32,326	% -	円 27,627	% -	% 96.5	% 3.5
9月末	30,592	△ 5.4	25,937	△ 6.1	96.0	4.0
10月末	32,515	0.6	27,587	△ 0.1	97.7	2.3
11月末	32,963	2.0	27,969	1.2	96.3	3.6
12月末	30,792	△ 4.7	26,095	△ 5.5	96.1	3.9
2023年1月末	32,231	△ 0.3	27,327	△ 1.1	98.5	1.5
2月末	32,378	0.2	27,446	△ 0.7	97.0	3.0
3月末	33,378	3.3	28,041	1.5	98.1	1.8
4月末	34,339	6.2	28,856	4.5	97.8	2.1
5月末	36,757	13.7	30,888	11.8	98.0	1.9
6月末	39,530	22.3	33,189	20.1	97.6	2.4
7月末	39,504	22.2	33,172	20.1	97.2	2.8
8月末	38,859	20.2	32,619	18.1	98.4	1.5
(期末) 2023年9月6日	39,598	22.5	33,241	20.3	98.7	1.3

*騰落率は期首比です。

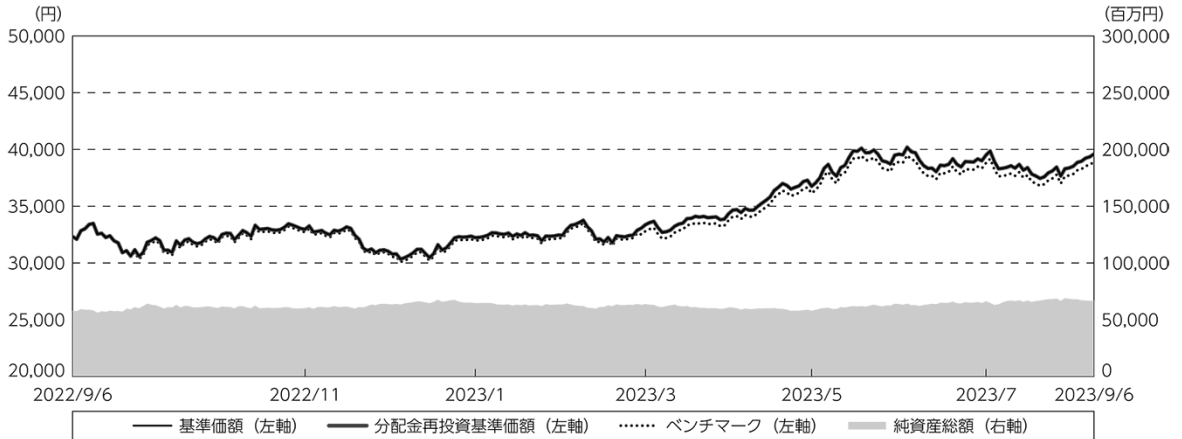
*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

*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：32,326円

期 末：39,598円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 22.5% (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、日経平均株価(日経225)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。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村インデックスファンド・日経225]

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、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（日経225）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。

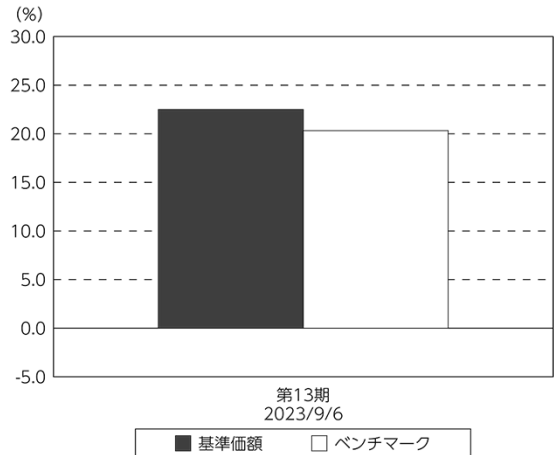
○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+22.5%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の+20.3%を2.2ポイント上回りました。

主な差異要因

- ・保有銘柄の配当が計上されたこと
- ・ファンドでは信託報酬などのコスト負担が日々生じること

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、基準価額水準等を勘案し見送らせていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第13期
	2022年9月7日～ 2023年9月6日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	29,597

(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

[野村インデックスファンド・日経225]

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み入れ、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

(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 152	% 0.440	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(70)	(0.203)	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 ）	(70)	(0.203)	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 ）	(11)	(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	0.003	(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)	(0.003)	
(c) そ の 他 費 用	1	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 ）	(1)	(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	154	0.446	
期中の平均基準価額は、34,486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。

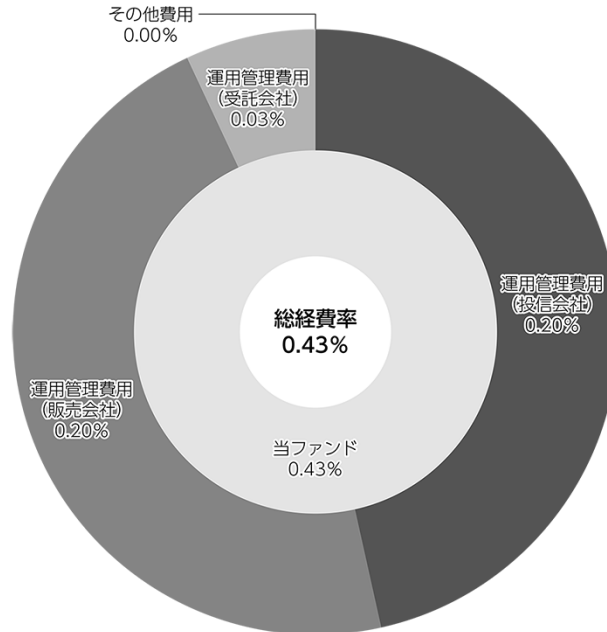
* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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0.43%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
ミリオン・インデックスマザーファンド	29,338,315 千口	55,192,043 千円	31,266,622 千口	59,901,592 千円

*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
	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	69,819,961千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	108,270,792千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.64

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月7日～2023年9月6日)

利害関係人との取引状況

<野村インデックスファンド・日経225>

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 34,827	百万円 2,602	% 7.5	百万円 34,992	百万円 44	% 0.1

平均保有割合 56.5%

※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 18	百万円 21	百万円 74

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

(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
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 32,271,660	千口 30,343,352	千円 66,937,436

*口数・評価額の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	比 率
	評 価 額	
ミリオン・インデックスマザーファンド	千円 66,937,436	% 98.5
コール・ローン等、その他	996,180	1.5
投資信託財産総額	67,933,616	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	67,933,616,630
コール・ローン等	389,639,716
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	66,937,436,598
未収入金	606,540,316
(B) 負債	989,533,651
未払解約金	849,291,373
未払信託報酬	139,197,619
未払利息	738
その他未払費用	1,043,921
(C) 純資産総額(A-B)	66,944,082,979
元本	16,906,124,805
次期繰越損益金	50,037,958,174
(D) 受益権総口数	16,906,124,805口
1万口当たり基準価額(C/D)	39,598円

(注) 期首元本額は17,900,570,451円、期中追加設定元本額は24,456,202,794円、期中一部解約元本額は25,450,648,440円、1口当たり純資産額は3.9598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	△ 82,541
受取利息	150
支払利息	△ 82,691
(B) 有価証券売買損益	8,283,340,232
売買益	13,058,102,707
売買損	△ 4,774,762,475
(C) 信託報酬等	△ 276,487,966
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,006,769,725
(E) 前期繰越損益金	225,508,526
(F) 追加信託差損益金	41,805,679,923
(配当等相当額)	(12,886,937,166)
(売買損益相当額)	(28,918,742,757)
(G) 計(D+E+F)	50,037,958,174
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	50,037,958,174
追加信託差損益金	41,805,679,923
(配当等相当額)	(13,075,165,363)
(売買損益相当額)	(28,730,514,560)
分配準備積立金	8,232,278,251

*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)	1,206,874,731円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	6,540,207,934円
c. 信託約款に定める収益調整金	41,805,679,923円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	485,195,586円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	50,037,958,174円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	29,597円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	0円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

ミリオン・インデックス マザーファンド

運用報告書

第35期（決算日2022年11月7日）

作成対象期間（2021年11月9日～2022年11月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場全体の長期的成長をとらえることを目標に、日経平均株価と連動する投資成果を目指して運用を行いません。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せん。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せん。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
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
34期(2021年11月8日)	18,908	20.5	29,507	18.8	97.9	2.1	97,537
35期(2022年11月7日)	18,008	△ 4.8	27,528	△ 6.7	97.1	2.9	106,015

* 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)	円	%	円	%	%	%
2021年11月8日	18,908	-	29,507	-	97.9	2.1
11月末	17,825	△ 5.7	27,822	△ 5.7	96.4	3.5
12月末	18,479	△ 2.3	28,792	△ 2.4	98.9	1.1
2022年1月末	17,322	△ 8.4	27,002	△ 8.5	97.5	2.5
2月末	17,027	△ 9.9	26,527	△ 10.1	97.4	2.6
3月末	18,009	△ 4.8	27,821	△ 5.7	96.7	3.3
4月末	17,381	△ 8.1	26,848	△ 9.0	97.0	3.0
5月末	17,672	△ 6.5	27,280	△ 7.5	98.0	2.0
6月末	17,123	△ 9.4	26,393	△ 10.6	97.5	2.5
7月末	18,034	△ 4.6	27,802	△ 5.8	98.7	1.3
8月末	18,231	△ 3.6	28,092	△ 4.8	96.9	3.1
9月末	16,972	△ 10.2	25,937	△ 12.1	96.0	4.0
10月末	18,046	△ 4.6	27,587	△ 6.5	97.7	2.3
(期末)						
2022年11月7日	18,008	△ 4.8	27,528	△ 6.7	97.1	2.9

* 騰落率は期首比です。

* 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「日経平均」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」自体及び「日経平均」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。
- ②「日経」及び「日経平均」を示す標準に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③「ミリオン・インデックスマザーファンド」は、野村アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び「ミリオン・インデックスマザーファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、日経平均株価です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

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が、その後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

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

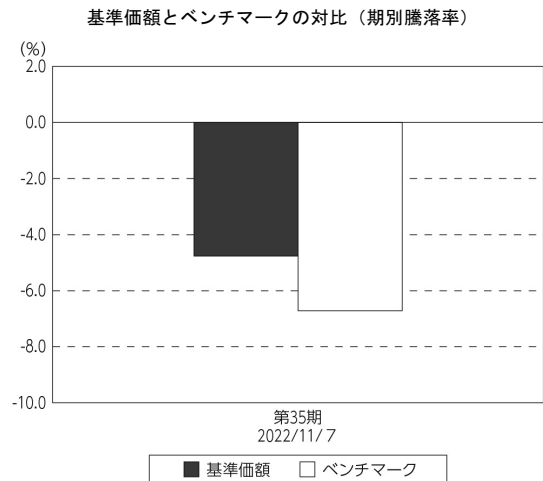
日経平均株価（日経225）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の株数の比率がポートフォリオと日経平均株価（日経225）で同水準になるように投資を行ないました。また、期中の設定・解約に伴う資金増減などに応じてポートフォリオの修正を行ないました。

○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-4.8%となり、ベンチマークである日経平均株価（日経225）の-6.7%を1.9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、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（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

(2021年11月9日～2022年11月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	1	0.003	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.003)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、17,676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11月9日～2022年11月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		9,134	39,122,035	6,266	26,499,159
		(324)	()		

*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
		96,550	95,563	—	—

*単位未満は切り捨て。

(2021年11月9日～2022年11月7日)

○株式売買比率

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	65,621,195千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	99,512,909千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.65

* (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11月9日～2022年11月7日)

利害関係人との取引状況

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 39,122	百万円 2,602	% 6.7	百万円 26,499	百万円 44	% 0.2

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 23	百万円 16	百万円 61

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11月7日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	114	128	64,256	
マルハニチロ	11.4	—	—	
鉱業 (0.1%)				
I N P E X	45.6	51.2	82,483	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	114	128	308,992	
大成建設	22.8	25.6	103,936	
大林組	114	128	122,496	
清水建設	114	128	95,616	
長谷工コーポレーション	22.8	25.6	39,398	
鹿島建設	57	64	89,792	
大和ハウス工業	114	128	388,608	
積水ハウス	114	128	311,488	
日揮ホールディングス	114	128	243,072	
食料品 (3.6%)				
日清製粉グループ本社	114	128	200,448	
明治ホールディングス	22.8	25.6	158,208	
日本ハム	57	64	226,880	
サッポロホールディングス	22.8	25.6	84,736	
アサヒグループホールディングス	114	128	543,872	
キリンホールディングス	114	128	281,664	
宝ホールディングス	114	128	130,560	
キッコーマン	114	128	986,880	
味の素	114	128	527,360	
ニチレイ	57	64	165,952	
日本たばこ産業	114	128	357,888	
繊維製品 (0.1%)				
東洋紡	11.4	12.8	13,158	
ユニチカ	11.4	—	—	
帝人	22.8	25.6	31,462	
東レ	114	128	92,659	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	114	128	65,792	
日本製紙	11.4	12.8	11,353	

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 (6.6%)				
クラレ	114	128	130,560	
旭化成	114	128	123,212	
昭和電工	11.4	12.8	27,840	
住友化学	114	128	60,416	
日産化学	114	128	834,560	
東ソー	57	64	98,048	
トクヤマ	22.8	25.6	44,800	
デンカ	22.8	25.6	88,320	
信越化学工業	114	128	2,019,840	
三井化学	22.8	25.6	71,142	
三菱ケミカルグループ	57	64	42,848	
UBE	11.4	12.8	24,422	
花王	114	128	670,976	
D I C	11.4	12.8	32,128	
富士フィルムホールディングス	114	128	882,560	
資生堂	114	128	653,056	
日東電工	114	128	1,022,720	
医薬品 (7.7%)				
協和キリン	114	128	412,160	
武田薬品工業	114	128	494,848	
アステラス製薬	570	640	1,318,720	
住友ファーマ	114	128	129,920	
塩野義製薬	114	128	844,800	
中外製薬	342	384	1,294,080	
エーザイ	114	128	1,112,576	
第一三共	342	384	1,780,224	
大塚ホールディングス	114	128	582,144	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	45.6	51.2	172,800	
E N E O Sホールディングス	114	128	64,537	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	57	64	147,520	
ブリヂストン	114	128	681,728	

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
ガラス・土石製品 (0.9%)				
AGC	22.8	25.6	110,720	
日本板硝子	11.4	12.8	7,091	
日本電気硝子	34.2	38.4	94,233	
住友大阪セメント	11.4	12.8	39,744	
太平洋セメント	11.4	12.8	25,932	
東海カーボン	114	128	128,512	
TOTO	57	64	271,360	
日本碍子	114	128	223,104	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	11.4	12.8	27,891	
神戸製鋼所	11.4	12.8	8,217	
JFEホールディングス	11.4	12.8	18,944	
大太平洋金属	11.4	12.8	24,076	
非鉄金属 (0.8%)				
日本軽金属ホールディングス	11.4	12.8	19,174	
三井金属鉱業	11.4	12.8	39,872	
東邦亜鉛	11.4	12.8	27,788	
三菱マテリアル	11.4	12.8	25,843	
住友金属鉱山	57	64	286,848	
DOWAホールディングス	22.8	25.6	123,008	
古河電気工業	11.4	12.8	30,092	
住友電気工業	114	128	202,944	
フジクラ	114	128	115,328	
金属製品 (0.0%)				
SUMCO	11.4	12.8	24,588	
機械 (5.5%)				
日本製鋼所	22.8	25.6	81,024	
オークマ	22.8	25.6	128,512	
アマダ	114	128	134,656	
SMC	—	12.8	780,672	
小松製作所	114	128	386,048	
住友重機械工業	22.8	25.6	73,881	
日立建機	114	128	380,672	
クボタ	114	128	268,352	
荏原製作所	22.8	25.6	127,488	
ダイキン工業	114	128	2,923,520	
日本精工	114	128	99,328	
NTN	114	128	36,992	
ジェイテクト	114	128	130,944	

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	11.4	12.8	5,734	
日立造船	22.8	25.6	22,297	
三菱重工業	11.4	12.8	68,364	
IHI	11.4	12.8	43,328	
電気機器 (21.7%)				
コニカミノルタ	114	128	68,096	
ミネベアミツミ	114	128	279,552	
日立製作所	22.8	25.6	180,454	
三菱電機	114	128	168,384	
富士電機	22.8	25.6	150,784	
安川電機	114	128	537,600	
日本電産	—	102.4	834,355	
オムロン	114	128	869,248	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	22.8	25.6	59,955	
日本電気	11.4	12.8	60,096	
富士通	11.4	12.8	224,384	
沖電気工業	11.4	—	—	
セイコーエプソン	228	256	525,568	
パナソニック ホールディングス	114	128	157,632	
シャープ	114	128	109,952	
ソニーグループ	114	128	1,388,160	
TDK	342	384	1,860,480	
アルプスアルパイン	114	128	159,872	
横河電機	114	128	321,280	
アドバンテスト	228	256	1,989,120	
キーエンス	11.4	12.8	729,216	
カシオ計算機	114	128	168,960	
ファナック	114	128	2,550,400	
京セラ	228	256	1,723,392	
太陽誘電	114	128	511,360	
村田製作所	91.2	102.4	730,009	
SCREENホールディングス	22.8	25.6	205,824	
キヤノン	171	192	610,944	
リコー	114	128	132,480	
東京エレクトロン	114	128	5,041,920	
輸送用機器 (4.7%)				
デンソー	114	128	949,120	
川崎重工業	11.4	12.8	33,420	
日産自動車	114	128	62,528	
いすゞ自動車	57	64	113,600	

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
トヨタ自動車	570	640	1,275,520	
日野自動車	114	128	80,384	
三菱自動車工業	11.4	12.8	8,192	
マツダ	22.8	25.6	26,700	
本田技研工業	228	256	870,912	
スズキ	114	128	645,248	
SUBARU	114	128	321,280	
ヤマハ発動機	114	128	404,480	
精密機器 (4.8%)				
テルモ	456	512	2,216,960	
ニコン	114	128	188,288	
オリンパス	456	512	1,568,256	
HOYA	—	64	862,400	
シチズン時計	114	128	80,640	
その他製品 (3.0%)				
バンダイナムコホールディングス	114	128	1,242,624	
凸版印刷	57	64	136,576	
大日本印刷	57	64	185,216	
ヤマハ	114	128	689,920	
任天堂	11.4	128	783,488	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	11.4	12.8	5,798	
中部電力	11.4	12.8	15,577	
関西電力	11.4	12.8	14,208	
東京瓦斯	22.8	25.6	65,254	
大阪瓦斯	22.8	25.6	52,761	
陸運業 (1.4%)				
東武鉄道	22.8	25.6	84,096	
東急	57	64	107,584	
小田急電鉄	57	64	108,096	
京王電鉄	22.8	25.6	127,232	
京成電鉄	57	64	247,680	
東日本旅客鉄道	11.4	12.8	101,721	
西日本旅客鉄道	11.4	12.8	74,931	
東海旅客鉄道	11.4	12.8	217,664	
日本通運	11.4	—	—	
ヤマトホールディングス	114	128	284,800	
NIPPON EXPRESSホールディン	—	12.8	95,616	
海運業 (0.3%)				
日本郵船	11.4	38.4	99,993	

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
商船三井	11.4	38.4	113,203	
川崎汽船	11.4	38.4	89,548	
空運業 (0.0%)				
ANAホールディングス	11.4	12.8	38,118	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	57	64	213,760	
情報・通信業 (12.2%)				
ネクソン	228	256	618,496	
Zホールディングス	45.6	51.2	17,684	
トレンドマイクロ	114	128	916,480	
日本電信電話	45.6	51.2	205,004	
KDDI	684	768	3,267,840	
ソフトバンク	114	128	191,360	
東宝	11.4	12.8	65,920	
エヌ・ティ・ティ・データ	570	640	1,335,680	
コナミグループ	114	128	866,560	
ソフトバンクグループ	684	768	5,069,568	
卸売業 (2.6%)				
双日	11.4	12.8	30,899	
伊藤忠商事	114	128	524,928	
丸紅	114	128	182,464	
豊田通商	114	128	654,080	
三井物産	114	128	464,384	
住友商事	114	128	278,656	
三菱商事	114	128	563,584	
小売業 (12.1%)				
J.フロント リテイリング	57	64	75,648	
三越伊勢丹ホールディングス	114	128	168,064	
セブン&アイ・ホールディングス	114	128	712,448	
高島屋	57	64	117,312	
丸井グループ	114	128	305,920	
イオン	114	128	350,080	
ファーストリテイリング	114	128	10,731,520	
銀行業 (0.6%)				
しずおかフィナンシャルグループ	—	128	119,552	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	114	128	57,600	
新生銀行	11.4	—	—	
あおぞら銀行	11.4	12.8	32,704	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	114	128	90,086	
りそなホールディングス	11.4	12.8	7,288	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	11.4	12.8	54,604
三井住友フィナンシャルグループ	11.4	12.8	54,476
千葉銀行	114	128	103,168
ふくおかフィナンシャルグループ	22.8	25.6	64,844
静岡銀行	114	—	—
みずほフィナンシャルグループ	11.4	12.8	20,672
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	114	128	74,496
野村ホールディングス	114	128	61,529
松井証券	114	128	98,944
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	22.8	25.6	159,616
MS&ADインシュアランスグループホール	34.2	38.4	152,524
第一生命ホールディングス	11.4	12.8	29,836
東京海上ホールディングス	57	192	526,560
T&Dホールディングス	22.8	25.6	37,632
その他金融業 (0.7%)			
クレディセゾン	114	128	200,320
オリックス	—	128	276,864
日本取引所グループ	114	128	245,312

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 (1.2%)			
東急不動産ホールディングス	114	128	94,080
三井不動産	114	128	357,760
三菱地所	114	128	236,800
東京建物	57	64	126,080
住友不動産	114	128	433,664
サービス業 (4.9%)			
エムスリー	273.6	307.2	1,273,651
ディー・エヌ・エー	34.2	38.4	73,804
電通グループ	114	128	574,720
サイバーエージェント	91.2	102.4	114,688
楽天グループ	114	128	84,480
リクルートホールディングス	342	384	1,747,200
日本郵政	114	128	126,822
セコム	114	128	1,058,560
合 計	株数・金額	21,306	24,499
	銘柄数<比率>	225	225
			<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 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円	百万円
	日経225	3,113	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年11月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	102,898,048	94.2
コール・ローン等、その他	6,290,317	5.8
投資信託財産総額	109,188,365	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11月7日現在)

○損益の状況 (2021年11月9日～2022年11月7日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	109,188,184,700
コール・ローン等	2,082,490,554
株式(評価額)	102,898,048,000
未収入金	3,238,070,105
未収配当金	895,920,600
差入委託証拠金	73,655,441
(B) 負債	3,172,606,162
未払解約金	3,172,603,365
未払利息	2,797
(C) 純資産総額(A－B)	106,015,578,538
元本	58,870,561,339
次期繰越損益金	47,145,017,199
(D) 受益権総口数	58,870,561,339口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,008円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,187,343,382
受取配当金	2,184,954,012
受取利息	10
その他収益金	3,032,653
支払利息	△ 643,293
(B) 有価証券売買損益	△ 5,166,033,035
売買益	6,930,212,148
売買損	△12,096,245,183
(C) 先物取引等取引損益	61,512,134
取引益	1,425,463,218
取引損	△ 1,363,951,084
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,917,177,519
(E) 前期繰越損益金	45,952,496,163
(F) 追加信託差損益金	30,027,430,776
(G) 解約差損益金	△25,917,732,221
(H) 計(D+E+F+G)	47,145,017,199
次期繰越損益金(H)	47,145,017,199

(注) 期首元本額は51,585,018,494円、期中追加設定元本額は39,671,849,789円、期中一部解約元本額は32,386,306,944円、1口当たり純資産額は1,8008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 34,353,854,896円
- ・ミリオン(インデックスポートフォリオ) 10,483,848,318円
- ・野村つみたて日本株投信 6,343,909,041円
- ・野村日経225インデックスファンド(確定拠出年金向け) 5,404,339,909円
- ・野村日経225インデックス(野村SMA・EW向け) 1,142,889,365円
- ・日経225インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) 705,875,277円
- ・ミリオン(バランスポートフォリオ) 365,614,777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) 69,429,191円
- ・日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用) 800,565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。