

JP日米バランスファンド

<愛称：JP日米>

運用報告書（全体版）

第6期（決算日 2019年8月15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。
「JP日米バランスファンド」は、2019年8月15日に第6期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き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／内外／資産複合		
信 託 期 間	無期限（2016年10月27日設定）		
運 用 方 針	日本と米国の債券に90%、日本株式に5%、米国株式に5%投資することを基本とします。 債券運用で利子収入を獲得し、安定的な収益の確保を目指します。また、株式に投資することで中長期的な成長の享受を目指します。 株式に投資する投資対象ファンドは、日経平均株価、ダウ・ジョーンズ工業株価平均と連動する投資成果を目指して運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 <基本組入比率>		
	日 米 債 券	日 本 株 式	米 国 株 式
	90%	5%	5%
主 な 投 資 対 象	J P 日 米 バ ラ ン ス フ ァ ン ド	野村FoFs用・日米債券ファンド（適格機関投資家専用）、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）、野村FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用）を主要投資対象とします。	
	野 村 F o F s 用 ・ 日 米 債 券 フ ァ ン ド （ 適 格 機 関 投 資 家 専 用 ）	日米の国債および日本国債と同等程度以上の信用格付けを有する日米の社債（日本の社債には、財投機関債を含みます）を主要投資対象とします。	
	野 村 F o F s 用 ・ 日 経 2 2 5 イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド （ 適 格 機 関 投 資 家 専 用 ）	日本株式を主要投資対象とします。	
	野 村 F o F s 用 ・ N Y ダ ウ イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド （ 適 格 機 関 投 資 家 専 用 ）	米国株式を主要投資対象とします。	
主 な 投 資 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。		
	一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。		
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。		
	留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。		

JP投信株式会社

東京都中央区日本橋本町一丁目5番11号

<照会先>

ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp

サポートダイヤル：0120-104-017

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

目 次

J P 日米バランスファンド	1
----------------	---

（ご参考）投資対象先の直近の内容

野村FoFs用・日米債券ファンド（適格機関投資家専用）	12
-----------------------------	----

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）	20
------------------------------------	----

野村FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用）	33
-----------------------------------	----

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 券 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率		
	円	円		%	%	百万円
２期(2017年８月15日)	10,033	30		2.2	99.0	3,223
３期(2018年２月15日)	9,729	30		△2.7	99.3	3,616
４期(2018年８月15日)	9,720	30		0.2	99.7	3,583
５期(2019年２月15日)	9,731	30		0.4	99.1	3,670
６期(2019年８月15日)	10,087	30		4.0	99.5	3,613

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

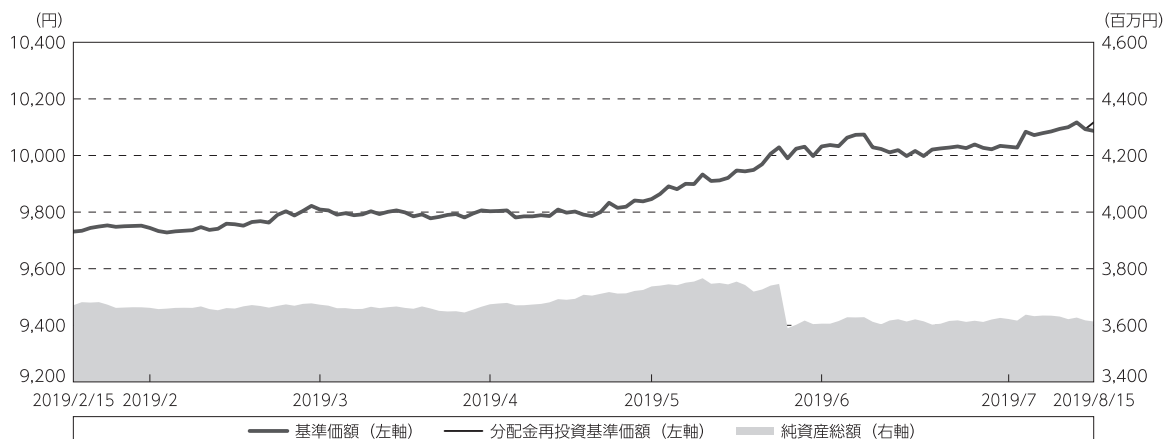
年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 券 率
		騰 落	率	
(期 首) 2019年２月15日	円		%	%
	9,731		—	99.1
２月末	9,744		0.1	99.5
３月末	9,809		0.8	99.5
４月末	9,803		0.7	99.1
５月末	9,846		1.2	99.1
６月末	10,032		3.1	99.9
７月末	10,031		3.1	99.7
(期 末) 2019年８月15日				
	10,117		4.0	99.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

○運用経過

(2019年2月16日～2019年8月15日)

期中の基準価額等の推移



期 首：9,731円

期 末：10,087円 (既払分配金(税込み)：30円)

騰落率：4.0% (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。
- (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、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2019年2月15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) 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

基準価額は、期首9,731円から期末10,087円となりました。なお、当期末には1万口当たり30円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は386円となりました。

投資対象とする3本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、日米債券が上昇し、日本株式および米国株式が下落しました。日米債券の上昇が主な値上がり要因となりました。

投資環境

日本債券市場	期を通じて、日本債券市場は利回りが低下（価格が上昇）しました。2019年2月中旬から3月上旬は米中通商協議進展への期待感などを受けて債券が売られましたが、下旬にかけてFOMC（米連邦公開市場委員会）で年内の利上げ見送りが示されたことなどから債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.1%近辺まで低下しました。4月上旬から中旬は米中通商協議で最終合意が間近であるとの報道などを受けて債券が売られました。その後、4月下旬から6月下旬にかけて米中貿易摩擦長期化への懸念や米欧の金融緩和観測などによって債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.19%台まで低下しました。7月上旬から中旬は良好な米雇用統計によって過度な米利下げ観測が後退したことなどから債券が売られました。7月下旬から8月中旬はトランプ米大統領が対中追加関税の第4弾を発動すると表明したことなどから債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.24%台まで低下しました。
米国債券市場	期を通じて、米国債券市場は利回りが低下（価格が上昇）しました。2019年2月中旬から3月下旬は世界景気の減速懸念、FOMCで年内は利上げを見送る方針が示されたことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは2.3%台と約1年3カ月ぶりの低水準を付けました。4月上旬から中旬は米国株式市場の上昇や米中通商協議進展への期待感などから債券が売られました。その後、4月下旬から6月下旬にかけて米中貿易摩擦の長期化懸念、FOMCで早期利下げの可能性が示唆されたことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは2%を下回る場面がありました。7月はFRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策を巡り一進一退の展開となりましたが、8月上旬から中旬はトランプ米大統領が対中追加関税の第4弾を発動すると表明したことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは1.5%台まで低下しました。
日本株式市場	期を通じて、日本株式市場は下落しました。2019年2月中旬から下旬は米中通商協議進展への期待感などを受けて、日本株式市場は上昇しました。3月上旬から4月下旬はECB（欧州中央銀行）による経済見通しの引き下げ・利上げ延期の表明、米中通商協議進展への期待感などを受けて一進一退の展開となりました。5月はトランプ米大統領による対中関税引き上げ、メキシコへの追加関税の表明などを嫌気して、日本株式市場は下落しました。6月に入り、日経平均株価が20,500円を下回る場面がありましたが、7月下旬にかけてトランプ米大統領による対メキシコ関税の発動見送り、米政府高官が訪中し貿易交渉を再開するとの報道などを好感して日本株式市場は上昇し、日経平均株価は21,500円を上回りました。8月上旬から中旬は米中貿易摩擦激化への懸念、世界経済の減速懸念などを嫌気して日本株式市場は下落し、日経平均株価は20,500円を下回りました。
米国株式市場	期を通じて、米国株式市場（NYダウ）は下落しました。2019年2月中旬から下旬は米中通商協議進展への期待感などを受けて米国株式市場は上昇しました。3月に入り、世界景気減速への警戒感から下落する場面がありましたが、4月下旬にかけてパウエルFRB議長が利上げを「急ぐ必要はない」と発言したことなどを好感して、米国株式市場は上昇しました。5月はトランプ米大統領が対中関税引き上げ、メキシコへの追加関税を表明したことなどを嫌気して、米国株式市場は下落し、NYダウは25,000ドルを下回りました。6月上旬から7月下旬はFOMCで早期の米利下げ観測の高まり、米中首脳会談での貿易協議再開への合意などから米国株式市場は上昇し、NYダウは最高値を更新しました。8月上旬から中旬は米中貿易摩擦激化への懸念、世界経済の減速懸念などを嫌気して米国株式市場は下落し、NYダウは一時25,500ドルを下回りました。

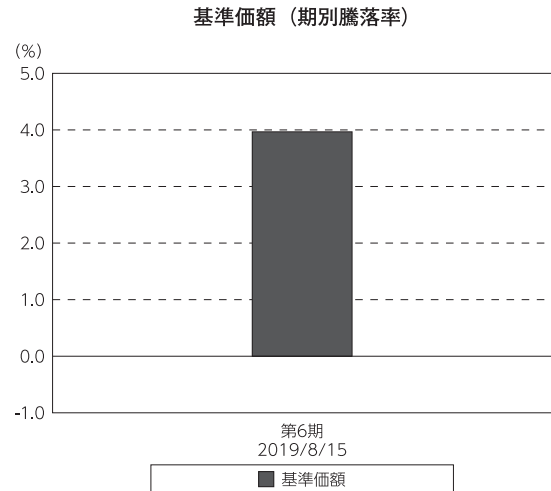
当ファンドのポートフォリオ

組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、当ファンドの追加解約に伴う売買に対応した日々のリバランスを行うことなどにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

右記のグラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案し以下のとおりといたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、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、1万口当たり・税込み）

項 目	第 6 期
	2019年2月16日～ 2019年8月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.297%
当期の収益	30
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	220

（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

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日米債券、日本株式、米国株式に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行います。

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 2 月16日～2019年 8 月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 22	% 0.225	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(10)	(0.096)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0.112)	交付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、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) 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)	(0.002)	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	22	0.227	
期中の平均基準価額は、9,877円です。			

(注) 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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

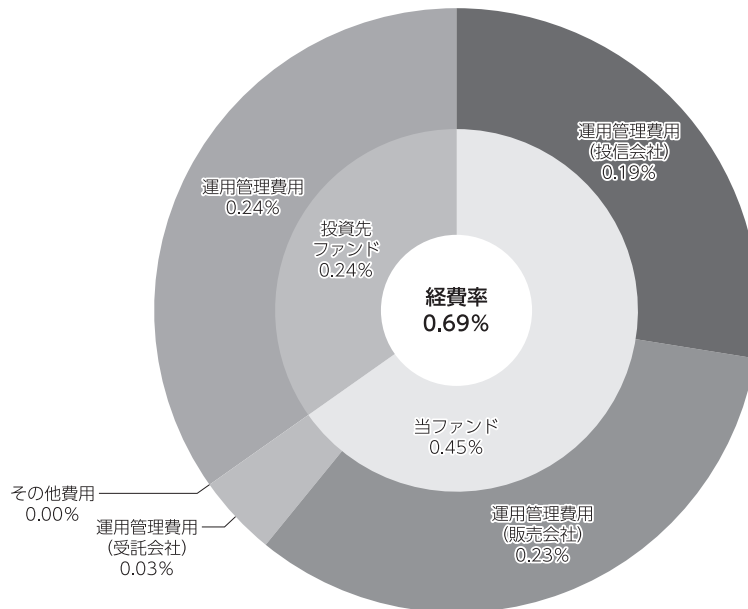
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(注) 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)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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、売買委託手数料およ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経費率（年率）は0.69%です。



(単位：%)

経費率 (①+②)	0.69
①当ファンドの費用の比率	0.45
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.24

(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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注) 当ファンドの費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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

(2019年２月16日～2019年８月15日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内		口	千円	口	千円
	野村FoFs用・日米債券ファンド(適格機関投資家専用)	162,200,724	153,220	331,248,626	315,000
	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)	36,743,044	45,500	39,522,791	49,400
	野村FoFs用・NIダウインデックスファンド(適格機関投資家専用)	24,661,870	33,800	31,785,064	44,100
合 計		223,605,638	232,520	402,556,481	408,500

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2019年２月16日～2019年８月15日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年２月16日～2019年８月15日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年２月16日～2019年８月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2019年８月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
野村FoFs用・日米債券ファンド（適格機関投資家専用）		3,543,135,275	3,374,087,373	3,265,779	90.4
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）		142,521,199	139,741,452	166,627	4.6
野村FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用）		130,388,201	123,265,007	163,634	4.5
合 計		3,816,044,675	3,637,093,832	3,596,041	99.5

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2019年８月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	3,596,041	98.5
コール・ローン等、その他	54,849	1.5
投資信託財産総額	3,650,890	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年8月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,650,890,898
コール・ローン等	52,849,727
投資信託受益証券(評価額)	3,596,041,171
未収入金	2,000,000
(B) 負債	37,403,740
未払収益分配金	10,747,331
未払解約金	18,331,609
未払信託報酬	8,246,177
未払利息	144
その他未払費用	78,479
(C) 純資産総額(A－B)	3,613,487,158
元本	3,582,443,787
次期繰越損益金	31,043,371
(D) 受益権総口数	3,582,443,787口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,087円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,772,225,300円、期中追加設定元本額は409,776,219円、期中一部解約元本額は599,557,732円です。
 (注) 1口当たり純資産額は1.0087円です。

○損益の状況 (2019年2月16日～2019年8月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	19,261,804
受取配当金	19,277,273
支払利息	△ 15,469
(B) 有価証券売買損益	120,388,047
売買益	139,453,884
売買損	△ 19,065,837
(C) 信託報酬等	△ 8,324,656
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	131,325,195
(E) 前期繰越損益金	△ 59,276,739
(F) 追加信託差損益金	△ 30,257,754
(配当等相当額)	(17,808,611)
(売買損益相当額)	(△ 48,066,365)
(G) 計(D＋E＋F)	41,790,702
(H) 収益分配金	△ 10,747,331
次期繰越損益金(G＋H)	31,043,371
追加信託差損益金	△ 30,257,754
(配当等相当額)	(17,808,611)
(売買損益相当額)	(△ 48,066,365)
分配準備積立金	61,301,125

(注) 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。
 (注) 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。
 (注) 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(2019年2月16日～2019年8月15日)は以下の通りです。

項 目	2019年2月16日～ 2019年8月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	18,113,834円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	31,250,667円
c. 信託約款に定める収益調整金	17,808,611円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	22,683,955円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	89,857,067円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	250円
g. 分配金	10,747,331円
h. 分配金(1万口当たり)	30円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	30円
-----------------	-----

○お知らせ

2019年 2 月16日から2019年 8 月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

野村FoFs用・日米債券ファンド（適格機関投資家専用）

第 6 期(2019年 2 月 8 日～2019年 8 月 7 日)

○当ファンドの仕組み

商 品 分 類	－
信 託 期 間	2016年10月26日以降、無期限とします。
運 用 方 針	日米の国債および日本国債と同等程度以上の信用格付けを有する社債（日本の社債には、財投機関債を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。日米の債券の比率は、毎月末の日本および米国の10年国債の利回り（米国は為替ヘッジ後。）に基づいて概ね 5 %刻みで見直しを行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	日米の国債および日本国債と同等程度以上の信用格付けを有する社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産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利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、利子・配当等収益等の水準及び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。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	達 配	騰 落 率			
	円		円	%	%	%	百万円
2 期(2017年 8 月 7 日)	9,714		80	1.6	98.7	—	2,851
3 期(2018年 2 月 7 日)	9,394		50	△2.8	97.6	—	3,321
4 期(2018年 8 月 7 日)	9,239		48	△1.1	96.8	—	3,229
5 期(2019年 2 月 7 日)	9,275		47	0.9	99.1	—	3,319
6 期(2019年 8 月 7 日)	9,636		47	4.4	96.8	—	3,318

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
		騰	落 率			
(期 首)	円		%	%	%	%
2019年 2 月 7 日	9,275		—	99.1	—	—
2 月末	9,282		0.1	99.3	—	—
3 月末	9,368		1.0	98.6	—	—
4 月末	9,322		0.5	98.6	—	—
5 月末	9,428		1.6	97.9	—	—
6 月末	9,594		3.4	96.9	—	—
7 月末	9,576		3.2	97.9	—	—
(期 末)						
2019年 8 月 7 日	9,683		4.4	96.8	—	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、期首9,275円から期末9,636円（分配後）となりました。この間、47円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は408円となりました。

（基準価額の主な上昇要因）

債券を保有していたことで、利息収入を得られたこと。

世界景気の減速からFRB（米連邦準備制度理事会）など主要中央銀行による金融緩和への期待が高まる中で、米国及び日本の債券利回りが低下（価格は上昇）したこと。

（基準価額の主な下落要因）

対円で為替ヘッジを行なったことで、金利差相当分の費用がかかったこと。

【運用経過】

<日米の債券の投資比率>

期首は、投資する債券に占める米国と日本の比率は、それぞれ、20%程度、80%程度としておりました。その後、米国及び日本の10年国債利回りの変動を受けて米国の組み入れ比率を20%程度から100%程度の範囲で動かしてまいりました。期末時点では、米国を60%程度、日本を40%程度組み入れました。

また、債券種別について、国債と社債（日本の社債には財投機関債を含みます）がほぼ同額程度となるように投資してまいりました。

<残存期間>

残存期間が5～10年の債券を中心に投資を行なってまいりました。

<為替>

期首から期末まで、対円でほぼフルヘッジとしました。

【分配金】

当期は、配当等収益等から、1万口あたり47円の収益分配を行ないました。尚、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。

【今後の運用方針】

今後の運用につきましては、引き続き米国及び日本の10年国債の利回り水準等を比較しながら、国別の債券の投資比率を決定し、債券の組み入れを行なってまいります。投資する債券については、国債と社債が概ね半々となるように投資を行なってまいります。また、投資する債券の残存期間は5～10年程度を中心とします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年 2 月 8 日～2019年 8 月 7 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 12	% 0.123	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(10)	(0.107)	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)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.011)	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) そ の 他 費 用	1	0.014	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(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	13	0.137	
期中の平均基準価額は、9,428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。

○ 売買及び取引の状況

(2019年 2 月 8 日～2019年 8 月 7 日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券		千円 734,990	千円 1,403,934
	特殊債券		203,243	446,478
	社債券（投資法人債券を含む）		447,901	876,499
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 12,709	千米ドル 7,254
		社債券（投資法人債券を含む）	12,677	7,361

* 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
* 単位未満は切り捨て。
* 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年2月8日～2019年8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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 4,175	百万円 101	% 2.4	百万円 4,300	百万円 —	% —

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

(2019年8月7日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	550,000	651,885	19.6	—	19.6	—	—
特殊債券 (除く金融債)	200,000 (200,000)	203,672 (203,672)	6.1 (6.1)	— (—)	6.1 (6.1)	— (—)	— (—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	430,000 (430,000)	437,414 (437,414)	13.2 (13.2)	— (—)	13.2 (13.2)	— (—)	— (—)
合 計	1,180,000 (630,000)	1,292,971 (641,086)	39.0 (19.3)	— (—)	39.0 (19.3)	— (—)	— (—)

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付（20年）第75回	2.1	110,000	125,038	2025/3/20
国庫債券	利付（20年）第87回	2.2	120,000	140,148	2026/3/20
国庫債券	利付（20年）第94回	2.1	160,000	189,697	2027/3/20
国庫債券	利付（20年）第101回	2.4	130,000	160,256	2028/3/20
国庫債券	利付（20年）第110回	2.1	30,000	36,745	2029/3/20
小	計		550,000	651,885	
特殊債券(除く金融債)					
日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回		0.235	100,000	101,597	2027/10/13
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第117回		0.274	100,000	102,075	2028/8/25
小	計		200,000	203,672	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力	第508回	0.455	10,000	10,163	2027/4/23
関西電力	第510回	0.49	60,000	61,096	2027/7/23
北海道電力	第345回	0.27	60,000	60,307	2024/9/25
電通	第3回社債間限定同順位特約付	0.424	100,000	102,069	2028/10/25
東日本旅客鉄道	第115回社債間限定同順位特約付	0.06	100,000	99,899	2026/7/28
ファーストリテイリング	第4回特定社債間限定同順位特約付	0.749	100,000	103,879	2025/12/18
小	計		430,000	437,414	
合	計		1,180,000	1,292,971	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,160	18,073	1,918,876	57.8	—	57.8	—	—
合 計	17,160	18,073	1,918,876	57.8	—	57.8	—	—

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	2.375	870	904	96,004	2024/8/15	
	US TREASURY N/B	2.0	870	889	94,446	2025/2/15	
	US TREASURY N/B	2.0	880	900	95,582	2025/8/15	
	US TREASURY N/B	1.625	930	930	98,753	2026/2/15	
	US TREASURY N/B	1.5	950	940	99,868	2026/8/15	
	US TREASURY N/B	2.25	900	938	99,606	2027/2/15	
	US TREASURY N/B	2.25	870	907	96,372	2027/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	840	910	96,651	2028/2/15	
	US TREASURY N/B	2.875	820	899	95,479	2028/8/15	
	US TREASURY N/B	2.625	830	894	95,012	2029/2/15	
普通社債券 (含む投資法人債券)	ACE INA HOLDINGS	3.35	50	53	5,649	2026/5/3	
	AFLAC INC	3.625	238	253	26,896	2024/11/15	
	ALLSTATE CORP	3.28	160	170	18,153	2026/12/15	
	AMAZON.COM INC	5.2	100	117	12,458	2025/12/3	
	AMERICAN EXPRESS CREDIT	3.3	79	84	8,967	2027/5/3	
	APPLE INC	3.35	156	165	17,604	2027/2/9	
	APPLE INC	3.0	236	246	26,143	2027/11/13	
	APPLIED MATERIALS INC	3.9	70	76	8,109	2025/10/1	
	APPLIED MATERIALS INC	3.3	20	21	2,253	2027/4/1	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND C	2.5	88	88	9,404	2026/8/11	
	AUTOMATIC DATA PROCESSNG	3.375	140	149	15,866	2025/9/15	
	BANK OF AMERICA CORP	3.248	136	141	14,971	2027/10/21	
	BANK OF AMERICA CORP	3.593	180	189	20,126	2028/7/21	
	BANK OF NY MELLON CORP	3.0	147	152	16,159	2025/2/24	
	BANK OF NY MELLON CORP	2.45	100	100	10,660	2026/8/17	
	BANK OF NY MELLON CORP	3.442	170	179	19,058	2028/2/7	
	BANK OF NY MELLON CORP	3.85	160	178	18,906	2028/4/28	
	BERKSHIRE HATHAWAY ENERG	3.25	90	95	10,136	2028/4/15	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC	3.125	100	104	11,104	2026/3/15	
	BLACKROCK INC	3.2	60	63	6,755	2027/3/15	
	CHEVRON CORP	2.954	196	205	21,786	2026/5/16	
	CHUBB INA HOLDINGS INC	3.15	60	63	6,703	2025/3/15	
	CISCO SYSTEMS INC	2.5	108	110	11,742	2026/9/20	
	CME GROUP	3.0	79	82	8,748	2025/3/15	
	COMCAST CORP	3.95	70	76	8,072	2025/10/15	
	COMCAST CORP	3.3	150	156	16,624	2027/2/1	
	COMCAST CORP	4.15	75	83	8,872	2028/10/15	
	EXXON MOBIL CORPORATION	3.043	100	105	11,167	2026/3/1	
	GENERAL DYNAMICS CORP	3.75	70	78	8,284	2028/5/15	
	HOME DEPOT INC	3.9	110	122	13,054	2028/12/6	
	INTEL CORP	3.7	40	43	4,599	2025/7/29	
	INTEL CORP	3.15	70	74	7,913	2027/5/11	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE	3.75	80	86	9,175	2025/12/1	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE	3.75	170	187	19,908	2028/9/21	
	JP MORGAN CHASE & CO	3.54	35	37	3,929	2028/5/1	

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債株)	JPMORGAN CHASE & CO	3.9	86	92	9,855	2025/7/15
		JPMORGAN CHASE & CO	2.95	40	40	4,329	2026/10/1
		JPMORGAN CHASE & CO	3.509	210	221	23,564	2029/1/23
		MERCK & CO INC	2.75	109	112	11,967	2025/2/10
		MERCK & CO INC	3.4	210	227	24,107	2029/3/7
		ORACLE CORP	2.95	100	103	11,011	2025/5/15
		ORACLE CORP	3.25	96	101	10,825	2027/11/15
		PEPSICO INC	3.0	98	103	10,960	2027/10/15
		PEPSICO INC	7.0	100	136	14,538	2029/3/1
		PFIZER INC	3.6	65	70	7,494	2028/9/15
		PHILIP MORRIS INTL INC	3.25	100	104	11,095	2024/11/10
		PHILIP MORRIS INTL INC	3.375	84	88	9,378	2025/8/11
		PHILIP MORRIS INTL INC	3.125	108	113	12,057	2027/8/17
		PHILIP MORRIS INTL INC	3.125	170	175	18,671	2028/3/2
		PNC FINANCIAL SERVICES	3.15	260	271	28,858	2027/5/19
		PRECISION CASTPARTS CORP	3.25	226	237	25,249	2025/6/15
		PROLOGIS LP	3.75	70	76	8,089	2025/11/1
		PROLOGIS LP	3.875	70	77	8,264	2028/9/15
		SALESFORCE.COM INC	3.7	45	49	5,253	2028/4/11
		SIMON PROPERTY GROUP LP	3.3	71	74	7,901	2026/1/15
		SIMON PROPERTY GROUP LP	3.25	171	179	19,015	2026/11/30
		SIMON PROPERTY GROUP LP	3.375	198	208	22,162	2027/6/15
		STATE STREET CORP	3.55	84	90	9,560	2025/8/18
		TARGET CORP	2.5	134	136	14,495	2026/4/15
		UNITED PARCEL SERVICE	3.05	36	37	4,026	2027/11/15
		UNITED PARCEL SERVICE	3.4	210	227	24,144	2029/3/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	3.1	104	108	11,527	2026/3/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	3.45	230	245	26,084	2027/1/15
		UNITEDHEALTH GROUP INC	3.85	46	50	5,368	2028/6/15
		US BANCORP	2.375	146	146	15,548	2026/7/22
		US BANCORP	3.15	154	162	17,242	2027/4/27
		VISA INC	3.15	147	155	16,492	2025/12/14
		WAL-MART STORES INC	5.875	120	150	15,942	2027/4/5
		WALMART INC	3.55	150	161	17,155	2025/6/26
		WALMART INC	3.7	120	132	14,108	2028/6/26
		WALT DISNEY COMPANY/THE	1.85	100	97	10,378	2026/7/30
		WALT DISNEY COMPANY/THE	2.95	39	41	4,395	2027/6/15
		合	計				1,918,876

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年8月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 3,211,847	% 88.5
コール・ローン等、その他	417,957	11.5
投資信託財産総額	3,629,804	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（2,257,389千円）の投資信託財産総額（3,629,804千円）に対する比率は62.2%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝106.17円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年8月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,832,932,586
コール・ローン等	25,706,401
公社債(評価額)	3,211,847,738
未収入金	2,570,028,929
未収利息	13,864,351
前払費用	11,485,167
(B) 負債	2,514,690,198
未払金	2,493,360,600
未払収益分配金	16,185,653
未払解約金	1,001,999
未払信託報酬	4,106,293
未払利息	12
その他未払費用	35,641
(C) 純資産総額(A－B)	3,318,242,388
元本	3,443,756,138
次期繰越損益金	△ 125,513,750
(D) 受益権総口数	3,443,756,138口
1万口当たり基準価額(C／D)	9,636円

(注) 期首元本額は3,579,236,171円、期中追加設定元本額は176,883,969円、期中一部解約元本額は312,364,002円、1口当たり純資産額は0.9636円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額1,041,732円。

○損益の状況 (2019年2月8日～2019年8月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	32,439,932
受取利息	32,402,275
その他収益金	45,534
支払利息	△ 7,877
(B) 有価証券売買損益	109,517,742
売買益	278,839,813
売買損	△169,322,071
(C) 信託報酬等	△ 4,565,136
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	137,392,538
(E) 前期繰越損益金	△135,246,471
(F) 追加信託差損益金	△111,474,164
(配当等相当額)	(23,173,086)
(売買損益相当額)	(△134,647,250)
(G) 計(D＋E＋F)	△109,328,097
(H) 収益分配金	△ 16,185,653
次期繰越損益金(G＋H)	△125,513,750
追加信託差損益金	△111,474,164
(配当等相当額)	(23,173,086)
(売買損益相当額)	(△134,647,250)
分配準備積立金	65,003,521
繰越損益金	△ 79,043,107

*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。

○お知らせ

該当事項はございません。

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）

第 6 期(2019年 2 月 8 日～2019年 8 月 7 日)

○当ファンドの仕組み

商 品 分 類	－	
信 託 期 間	2016年10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、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FoFs用・日経225インデックスファンド	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FoFs用・日経225インデックスファンド	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、配当等収益等の水準及び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。	

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	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
		税 込 分 配	み 金 期 騰 落	中 率	日経平均株価 (日経225)	期 騰 落	中 率	
	円	円		%	円	%	%	百万円
2期(2017年8月7日)	11,567	90	7.0		20,056	6.1	96.6	157
3期(2018年2月7日)	12,486	100	8.8		21,645	7.9	96.8	167
4期(2018年8月7日)	13,081	110	5.6		22,663	4.7	97.6	176
5期(2019年2月7日)	11,978	115	△7.6		20,751	△8.4	98.4	180
6期(2019年8月7日)	11,844	125	△0.1		20,517	△1.1	97.3	168

* 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。

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。

○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 (日経225)	騰 落 率		
(期 首) 2019年2月7日	円 11,978	% —	円 20,751	% —	% 98.4	% 1.5
2月末	12,351	3.1	21,385	3.1	98.5	1.5
3月末	12,345	3.1	21,206	2.2	96.6	3.4
4月末	12,963	8.2	22,259	7.3	96.9	3.1
5月末	12,000	0.2	20,601	△0.7	96.5	3.4
6月末	12,412	3.6	21,276	2.5	96.5	3.5
7月末	12,553	4.8	21,522	3.7	97.2	2.7
(期 末) 2019年8月7日	円 11,969	% △0.1	円 20,517	% △1.1	% 97.3	% 2.7

* 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。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、期首11,978円から期末11,969円（分配金込み）に9円の値下がりとなりました。

期首より米国株式市場が上昇したことや、米中貿易協議の進展が期待されたことなどから上昇しました。5月には、国内企業の2019年3月期決算発表において新年度業績見通しが慎重であったことなどから下落しましたが、6月には、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が政策金利引き下げの可能性を示唆したことなどから米国株式市場が上昇したことなどを受けて上昇しました。8月には、FRB議長が持続的な利下げを否定したことや、米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから世界的な株安となり下落し、基準価額は下落しました。

【運用経過】

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」の運用につきましては、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。

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や日経平均株価（日経225）採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。

【分配金】

収益分配金は、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し、1万口当たり125円とさせていただきます。

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。

【今後の運用方針】

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」の運用につきましては、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

(2019年 2 月 8 日～2019年 8 月 7 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 9	% 0.075	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(7)	(0.059)	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 ）	(1)	(0.005)	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 ）	(1)	(0.011)	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	0.002	(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)	(0.002)	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	9	0.079	
期中の平均基準価額は、12,437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。

○ 売買及び取引の状況

(2019年 2 月 8 日～2019年 8 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 35,262	千円 45,954	千口 44,380	千円 58,054

* 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年2月8日～2019年8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	22,263,276千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	66,730,721千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.33

* (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2月8日～2019年8月7日)

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
	百万円	百万円	百万円
株式	5	8	45

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

(2019年2月8日～2019年8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

(2019年8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 143,219	千口 134,102	千円 168,955

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年8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 168,955	% 98.9
コール・ローン等、その他	1,938	1.1
投資信託財産総額	170,893	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 (2019年8月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	170,893,286
コール・ローン等	154,233
ミリオン・インデックスマザーファンド(評価額)	168,955,295
未収入金	1,783,758
(B) 負債	1,920,874
未払収益分配金	1,783,301
未払信託報酬	134,743
その他未払費用	2,830
(C) 純資産総額(A－B)	168,972,412
元本	142,664,102
次期繰越損益金	26,308,310
(D) 受益権総口数	142,664,102口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,844円

(注) 期首元本額は150,662,611円、期中追加設定元本額は37,379,593円、期中一部解約元本額は45,378,102円、1口当たり純資産額は1.1844円です。

○損益の状況 (2019年2月8日～2019年8月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1
支払利息	△ 1
(B) 有価証券売買損益	△ 1,322,254
売買益	1,737,109
売買損	△ 3,059,363
(C) 信託報酬等	△ 137,573
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 1,459,828
(E) 前期繰越損益金	2,128,550
(F) 追加信託差損益金	27,422,889
(配当等相当額)	(19,130,268)
(売買損益相当額)	(8,292,621)
(G) 計(D＋E＋F)	28,091,611
(H) 収益分配金	△ 1,783,301
次期繰越損益金(G＋H)	26,308,310
追加信託差損益金	27,422,889
(配当等相当額)	(19,187,605)
(売買損益相当額)	(8,235,284)
分配準備積立金	11,602,362
繰越損益金	△12,716,941

*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。

○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

第31期(計算期間：2017年11月8日～2018年11月7日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【当期の運用経過】

- (1) 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。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や日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどによる除数の変更に応じてポートフォリオの修正を行いました。
- なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。
- (2) 基準価額は、期首13,626円から期末13,379円となりました。ベンチマークとしている日経平均株価が3.7%の下落となったのに対して、基準価額は1.8%の下落となりました。

【今後の運用方針】

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。

- | |
|---|
| <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
|---|

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年11月 8 日～2018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	0.006	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.006)	
合 計	1	0.006	
期中の平均基準価額は、13,516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

(2017年11月 8 日～2018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 14,842 (△ 666)	千円 51,936,706 ()	千株 9,034	千円 32,148,274

*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 82,950	百万円 82,088	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年11月8日～2018年11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
(a) 期中の株式売買金額	84,084,981千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	60,025,405千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.40

* (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

(2017年11月8日～2018年11月7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 52	百万円 31	百万円 58

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

(2018年11月7日現在)

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	千株	株 数	千円		株 数	千株	株 数	千円
水産・農林業 (0.2%)					日本製紙	7.8	11.2		22,265
日本水産	78	112	76,160		化学 (8.5%)				
マルハニチロ	7.8	11.2	45,584		クラレ	78	112	174,832	
鉱業 (0.1%)					旭化成	78	112	138,152	
国際石油開発帝石	31.2	44.8	56,425		昭和電工	7.8	11.2	57,680	
建設業 (2.4%)					住友化学	78	112	67,312	
コムシスホールディングス	78	112	325,248		日産化学	78	112	647,360	
大成建設	15.6	22.4	112,224		東ソー	39	56	85,344	
大林組	78	112	115,248		トクヤマ	15.6	22.4	59,830	
清水建設	78	112	103,600		デンカ	15.6	22.4	77,952	
長谷工コーポレーション	15.6	22.4	32,121		信越化学工業	78	112	1,123,360	
鹿島建設	78	56	84,616		三井化学	15.6	22.4	61,644	
大和ハウス工業	78	112	374,752		三菱ケミカルホールディングス	39	56	52,113	
積水ハウス	78	112	185,472		宇部興産	7.8	11.2	27,776	
日揮	78	112	231,056		日本化薬	78	112	155,344	
千代田化工建設	78	112	46,592		花王	78	112	864,192	
食料品 (4.6%)					富士フイルムホールディングス	78	112	534,576	
日清製粉グループ本社	78	112	253,232		資生堂	78	112	841,008	
明治ホールディングス	15.6	22.4	172,704		日東電工	78	112	681,520	
日本ハム	78	56	228,200		医薬品 (8.7%)				
サッポロホールディングス	15.6	22.4	53,222		協和発酵キリン	78	112	250,320	
アサヒグループホールディングス	78	112	557,424		武田薬品工業	78	112	520,464	
キリンホールディングス	78	112	285,264		アステラス製薬	390	560	939,960	
宝ホールディングス	78	112	157,024		大日本住友製薬	78	112	316,848	
キッコーマン	78	112	674,240		塩野義製薬	78	112	817,824	
味の素	78	112	211,568		中外製薬	78	112	758,240	
ニチレイ	39	56	154,896		エーザイ	78	112	1,108,128	
日本たばこ産業	78	112	313,712		第一三共	78	112	479,696	
繊維製品 (0.2%)					大塚ホールディングス	78	112	614,656	
東洋紡	7.8	11.2	17,942		石油・石炭製品 (0.5%)				
ユニチカ	7.8	11.2	6,507		昭和シェル石油	78	112	227,696	
帝人	15.6	22.4	43,590		J X T G ホールディングス	78	112	82,387	
東レ	78	112	91,089		ゴム製品 (0.9%)				
パルプ・紙 (0.1%)					横浜ゴム	39	56	128,856	
王子ホールディングス	78	112	82,432		ブリヂストン	78	112	485,520	

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 (1.4%)			
A G C	15.6	22.4	83,216
日本板硝子	7.8	11.2	11,614
日本電気硝子	23.4	33.6	99,288
住友大阪セメント	78	11.2	50,064
太平洋セメント	7.8	11.2	38,080
東海カーボン	78	112	214,256
T O T O	39	56	232,120
日本硝子	78	112	187,264
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	7.8	11.2	24,259
神戸製鋼所	7.8	11.2	11,076
ジェイ エフ イー ホールディングス	7.8	11.2	24,432
日新製鋼	7.8	11.2	17,124
大太平洋金属	7.8	11.2	37,520
非鉄金属 (1.0%)			
日本軽金属ホールディングス	78	112	27,888
三井金属鉱業	7.8	11.2	35,392
東邦亜鉛	7.8	11.2	43,232
三菱マテリアル	7.8	11.2	33,264
住友金属鉱山	39	56	209,216
DOWAホールディングス	15.6	22.4	78,400
古河機械金属	7.8	—	—
古河電気工業	7.8	11.2	35,280
住友電気工業	78	112	177,240
フジクラ	78	112	55,216
金属製品 (0.4%)			
S U M C O	7.8	11.2	18,267
東洋製鐵グループホールディングス	78	112	256,816
機械 (4.8%)			
日本製鋼所	15.6	22.4	57,926
オークマ	15.6	22.4	132,160
アマダホールディングス	78	112	124,208
小松製作所	78	112	350,224
住友重機械工業	15.6	22.4	79,408
日立建機	78	112	350,000
クボタ	78	112	206,584
荏原製作所	15.6	22.4	74,256
ダイキン工業	78	112	1,396,080
日本精工	78	112	122,640

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
N T N	78	112	41,888
ジェイテクト	78	112	153,104
日立造船	15.6	22.4	9,116
三菱重工業	7.8	11.2	47,577
I H I	7.8	11.2	44,352
電気機器 (17.3%)			
日清紡ホールディングス	78	112	126,000
コニカミノルタ	78	112	120,288
ミネベアミツミ	78	112	191,408
日立製作所	78	22.4	78,892
三菱電機	78	112	161,560
富士電機	78	22.4	80,528
安川電機	78	112	389,760
ジーエス・ユアサ コーポレーション	78	22.4	54,140
日本電気	7.8	11.2	38,416
富士通	78	11.2	77,940
沖電気工業	7.8	11.2	16,923
セイコーエプソン	156	224	417,536
パナソニック	78	112	132,272
ソニー	78	112	683,760
TDK	78	112	1,133,440
アルプス電気	78	112	298,816
パイオニア	78	112	10,864
横河電機	78	112	261,520
アドバンテスト	156	224	554,176
カシオ計算機	78	112	186,928
ファナック	78	112	2,338,000
京セラ	156	224	1,359,904
太陽誘電	78	112	292,320
S C R E E Nホールディングス	15.6	22.4	138,880
キヤノン	117	168	538,944
リコー	78	112	124,992
東京エレクトロン	78	112	1,729,840
輸送用機器 (5.5%)			
デンソー	78	112	578,032
三井E&Sホールディングス	7.8	11.2	15,444
川崎重工業	7.8	11.2	29,948
日産自動車	78	112	114,352
いすゞ自動車	39	56	88,004
トヨタ自動車	78	112	743,568

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日野自動車	78	112	120,624	
三菱自動車工業	7.8	11.2	8,332	
マツダ	15.6	22.4	27,328	
本田技研工業	156	224	723,296	
スズキ	78	112	613,536	
S U B A R U	78	112	323,232	
ヤマハ発動機	78	112	258,832	
精密機器 (3.2%)				
テルモ	156	224	1,422,400	
ニコン	78	112	222,656	
オリンパス	78	112	402,080	
シチズン時計	78	112	74,928	
その他製品 (1.2%)				
凸版印刷	78	56	90,160	
大日本印刷	39	56	142,520	
ヤマハ	78	112	588,000	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	7.8	11.2	6,361	
中部電力	7.8	11.2	17,399	
関西電力	7.8	11.2	19,314	
東京瓦斯	15.6	22.4	60,558	
大阪瓦斯	15.6	22.4	45,718	
陸運業 (2.2%)				
東武鉄道	15.6	22.4	70,000	
東京急行電鉄	39	56	102,368	
小田急電鉄	39	56	131,768	
京王電鉄	15.6	22.4	135,072	
京成電鉄	39	56	193,200	
東日本旅客鉄道	7.8	11.2	110,432	
西日本旅客鉄道	7.8	11.2	84,425	
東海旅客鉄道	7.8	11.2	240,072	
日本通運	7.8	11.2	79,072	
ヤマトホールディングス	78	112	320,320	
海運業 (0.1%)				
日本郵船	7.8	11.2	21,492	
商船三井	7.8	11.2	30,968	
川崎汽船	7.8	11.2	18,715	
空運業 (0.1%)				
A N Aホールディングス	7.8	11.2	43,052	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	39	56	148,848	
情報・通信業 (10.2%)				
ヤフー	31.2	44.8	14,784	
トレンドマイクロ	78	112	751,520	
スカパー J S A Tホールディングス	7.8	11.2	5,756	
日本電信電話	15.6	22.4	100,710	
K D D I	468	672	1,641,696	
N T T ドコモ	7.8	11.2	27,944	
東宝	7.8	11.2	40,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	390	560	777,280	
コナミホールディングス	78	112	549,920	
ソフトバンクグループ	234	336	2,875,152	
卸売業 (2.3%)				
双日	7.8	11.2	4,580	
伊藤忠商事	78	112	227,360	
丸紅	78	112	97,104	
豊田通商	78	112	442,960	
三井物産	78	112	207,872	
住友商事	78	112	194,488	
三菱商事	78	112	348,432	
小売業 (14.7%)				
J．フロント リテイリング	39	56	87,360	
三越伊勢丹ホールディングス	78	112	155,680	
セブン&アイ・ホールディングス	78	112	551,936	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	78	112	1,601,600	
高島屋	78	56	102,368	
丸井グループ	78	112	271,152	
イオン	78	112	298,312	
ファーストリテイリング	78	112	6,770,400	
銀行業 (0.9%)				
コンソルディア・フィナンシャルグループ	78	112	58,800	
新生銀行	7.8	11.2	19,678	
あおぞら銀行	7.8	11.2	43,848	
三菱U F Jフィナンシャル・グループ	78	112	75,432	
りそなホールディングス	7.8	11.2	6,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	7.8	11.2	51,004	
三井住友フィナンシャルグループ	7.8	11.2	49,705	
千葉銀行	78	112	82,320	
ふくおかフィナンシャルグループ	78	22.4	64,019	

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	78	112	115,360
みずほフィナンシャルグループ	78	112	21,672
証券、商品先物取引業（0.4%）			
大和証券グループ本社	78	112	71,545
野村ホールディングス	78	112	58,732
松井証券	78	112	135,632
保険業（1.0%）			
SOMPOホールディングス	19.5	28	134,848
MS&ADインシュアランスグループホール	23.4	33.6	115,617
ソニーフィナンシャルホールディングス	15.6	22.4	59,382
第一生命ホールディングス	7.8	11.2	24,444
東京海上ホールディングス	39	56	303,800
T&Dホールディングス	15.6	22.4	41,395
その他金融業（0.3%）			
クレディセゾン	78	112	201,712
不動産業（1.6%）			
東急不動産ホールディングス	78	112	72,464
三井不動産	78	112	291,424

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	78	112	206,752
東京建物	39	56	69,384
住友不動産	78	112	451,136
サービス業（4.6%）			
ディー・エヌ・エー	23.4	33.6	69,283
電通	78	112	605,920
サイバーエージェント	—	22.4	115,136
楽天	78	112	98,896
リクルートホールディングス	234	336	1,013,376
日本郵政	78	112	149,968
東京ドーム	39	56	55,440
セコム	78	112	998,704
合 計	株 数 ・ 金 額	13,568	18,709
	銘柄数<比率>	225	225

*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	日経225	百万円 百万円 2,411 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年11月7日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
株式	千円 % 66,770,140 96.5
コール・ローン等、その他	2,457,402 3.5
投資信託財産総額	69,227,542 100.0

*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（2018年11月7日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,227,542,163
コール・ローン等	1,882,883,937
株式（評価額）	66,770,140,640
未収入金	61,467,026
未収配当金	481,920,560
差入委託証拠金	31,130,000
(B) 負債	28,834,900
未払解約金	28,830,936
未払利息	3,964
(C) 純資産総額（A－B）	69,198,707,263
元本	51,721,526,486
次期繰越損益金	17,477,180,777
(D) 受益権総口数	51,721,526,486口
1万口当たり基準価額（C／D）	13,379円

(注) 期首元本額は36,598,712,762円、期中追加設定元本額は51,332,495,607円、期中一部解約元本額は36,209,681,883円、1口当たり純資産額は1,3379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 29,482,535,868円
 ・ミリオン（インデックスポートフォリオ）14,830,719,479円
 ・野村日経225インデックスファンド（確定拠出年金向け）2,484,458,947円
 ・日経225インデックスファンド（適格機関投資家専用）2,156,660,282円
 ・日経225インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）1,178,585,168円
 ・野村つみたて日本株投信 924,659,484円
 ・ミリオン（バランスポートフォリオ）535,107,613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）128,799,645円

○損益の状況（2017年11月8日～2018年11月7日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,171,234,830
受取配当金	1,172,489,474
受取利息	280
その他収益金	78,581
支払利息	△ 1,333,505
(B) 有価証券売買損益	△ 1,235,412,740
売買益	6,687,791,616
売買損	△ 7,923,204,356
(C) 先物取引等取引損益	△ 83,036,346
取引益	787,831,594
取引損	△ 870,867,940
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 147,214,256
(E) 前期繰越損益金	13,272,476,163
(F) 追加信託差損益金	17,720,880,689
(G) 解約差損益金	△13,368,961,819
(H) 計（D＋E＋F＋G）	17,477,180,777
次期繰越損益金（H）	17,477,180,777

* 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。

野村FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用）

第6期(2019年2月8日～2019年8月7日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	—	
信託期間	2016年10月26日以降、無期限とします。	
運用方針	NYダウ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、ダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
主な投資対象	野村FoFs用・NYダウインデックスファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	主としてダウ・ジョーンズ工業株価平均に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村FoFs用・NYダウインデックスファンド	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、配当等収益等の水準及び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。	

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配)	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
		税込 分配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期(2017年8月7日)	12,003	110	10.2	123.02	10.7	90.6	7.2	336
3期(2018年2月7日)	13,411	110	12.6	138.90	12.9	91.4	7.3	372
4期(2018年8月7日)	13,579	120	2.1	142.30	2.5	90.4	7.5	379
5期(2019年2月7日)	13,374	120	△ 0.6	141.72	△ 0.4	92.4	7.3	382
6期(2019年8月7日)	13,539	135	2.2	145.35	2.6	88.7	7.4	372

* 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。

※ベンチマーク（＝ダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、円ヘッジ・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、円ヘッジ・円ベース）を使用しております。なお、設定時を100として再指数化しています。

※「Dow Jones Industrial Average」（ダウ・ジョーンズ工業株価平均）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが野村アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、DJIA®、The Dow®、Dow Jones®およびDow Jones Industrial Average®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが野村アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。野村アセットマネジメント株式会社の当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Dow Jones Industrial Averageの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

○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		騰 落 率		
(期 首) 2019年 2 月 7 日	円 13,374	% —	141.72	% —	% 92.4	% 7.3
2 月 末	13,711	2.5	145.38	2.6	93.1	7.5
3 月 末	13,555	1.4	143.77	1.4	90.8	7.5
4 月 末	13,922	4.1	147.76	4.3	92.2	7.6
5 月 末	13,254	△0.9	140.71	△0.7	88.4	7.3
6 月 末	13,962	4.4	148.22	4.6	88.8	7.4
7 月 末	14,286	6.8	151.83	7.1	89.6	7.5
(期 末) 2019年 8 月 7 日	13,674	2.2	145.35	2.6	88.7	7.4

* 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。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、期首13,374円から期末13,674円（分配金込み）に300円の値上がりとなりました。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均は、期首から堅調な欧米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待、FOMC（米連邦公開市場委員会）で年内の利上げ見送りなどの方針が示されたことなどを背景に上昇しました。2019年5月に入ると、中国の対米報復関税や中国の通信機器大手企業に対する米国の輸出規制措置の発表などが警戒され下落したものの、6月以降は、対メキシコ関税発動の見送り、市場予想を下回る5月の米雇用統計などを受けた利下げ観測の高まりなどから堅調に推移しました。8月には、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が持続的な利下げを否定したことや、米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどから世界的な株安となり下落したものの、期を通じて上昇したため、基準価額は上昇しました。

【運用経過】

【NYダウインデックスマザーファンド】 受益証券を主要な投資対象とし、期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行いました。

【NYダウインデックスマザーファンド】 の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じて高位に維持しました。ダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース）に連動する投資成果を目指し、ダウ・ジョーンズ工業株価平均に採用されている銘柄に等株数投資を行い、期中の資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【分配金】

収益分配金は、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し、1万口当たり135円とさせていただきます。

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。

【今後の運用方針】

主要投資対象である【NYダウ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、ダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果を目指します。

【NYダウインデックスマザーファンド】 の運用につきましては、引き続き、ダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年2月8日～2019年8月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 12	% 0.086	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(10)	(0.070)	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)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.011)	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	0.005	(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)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.002)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	9	0.064	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(9)	(0.063)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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	22	0.155	
期中の平均基準価額は、13,781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、有価証券取引税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。

○売買及び取引の状況

(2019年2月8日～2019年8月7日)

先物取引の種類別取引状況

種 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 28	百万円 28	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

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
NYダウインデックススマザーファンド	千口 29,505	千円 45,642	千口 44,179	千円 69,392

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2019年2月8日～2019年8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
	NYダウインデックススマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	74,507千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	347,572千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.21

* (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2月8日～2019年8月7日)

利害関係人との取引状況

<野村FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用）>

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	$\frac{D}{C}$	
為替先物取引	百万円 2,273	百万円 3	% 0.1	百万円 2,283	百万円 1	% 0.0

<NYダウ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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 45	百万円 1	% 2.2	百万円 69	百万円 3	% 4.3

平均保有割合 100.0%

※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信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2019年2月8日～2019年8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 150	百万円 —	百万円 —	百万円 150	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2019年8月7日現在)

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期	未
			買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	DJIAVMN	百万円 13	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期	未
	口 数	口 数	評 価 額
NYダウインデックスマザーファンド	千口 244,643	千口 229,970	千円 350,267

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年8月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
NYダウインデックスマザーファンド	350,267	93.0
コール・ローン等、その他	26,189	7.0
投資信託財産総額	376,456	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*NYダウインデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（353,388千円）の投資信託財産総額（353,994千円）に対する比率は99.8%です。

*当期末における外貨建て純資産（6,159千円）の投資信託財産総額（376,456千円）に対する比率は1.6%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝106.17円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年8月7日現在）

○損益の状況（2019年2月8日～2019年8月7日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	748,182,014
コール・ローン等	5,869,784
NYダウインデックスマザーファンド(評価額)	350,267,709
未収入金	385,775,331
差入委託証拠金	6,269,190
(B) 負債	375,883,411
未払金	371,834,931
未払収益分配金	3,712,194
未払信託報酬	330,150
未払利息	5
その他未払費用	6,131
(C) 純資産総額(A－B)	372,298,603
元本	274,977,335
次期繰越損益金	97,321,268
(D) 受益権総口数	274,977,335口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,539円

(注) 期首元本額は286,137,730円、期中追加設定元本額は25,187,305円、期中一部解約元本額は36,347,700円、1口当たり純資産額は1.3539円です。

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	39,619
その他収益金	43,915
支払利息	△ 4,296
(B) 有価証券売買損益	7,436,595
売買益	25,272,669
売買損	△ 17,836,074
(C) 先物取引等取引損益	292,711
取引益	402,066
取引損	△ 109,355
(D) 信託報酬等	△ 336,281
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	7,432,644
(F) 前期繰越損益金	57,264,308
(G) 追加信託差損益金	36,336,510
(配当等相当額)	(28,243,851)
(売買損益相当額)	(8,092,659)
(H) 計(E＋F＋G)	101,033,462
(I) 収益分配金	△ 3,712,194
次期繰越損益金(H＋I)	97,321,268
追加信託差損益金	36,336,510
(配当等相当額)	(28,303,304)
(売買損益相当額)	(8,033,206)
分配準備積立金	60,984,758

*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。

○お知らせ

該当事項はございません。

NYダウインデックスマザーファンド

第3期(計算期間：2018年2月8日～2019年2月7日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【運用経過】

- (1) 株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じて高位に維持しました。ダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース）に連動する投資成果を目指し、ダウ・ジョーンズ工業株価平均に採用されている銘柄に等株数投資を行い、期中の資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。
- (2) 基準価額は、期首14,610円から期末15,238円となりました。ベンチマークとしているダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース）が2.4%の上昇となったのに対して、基準価額は4.3%の上昇となりました。

【今後の運用方針】

引き続き、ダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

※ベンチマーク（＝ダウ・ジョーンズ工業株価平均（円換算ベース））は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のダウ・ジョーンズ工業株価平均（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が独自に円換算しています。

※「Dow Jones Industrial Average」（ダウ・ジョーンズ工業株価平均）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが野村アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、DJIA®, The Dow®, Dow Jones®およびDow Jones Industrial Average®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが野村アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。野村アセットマネジメント株式会社の当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Dow Jones Industrial Averageの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年 2 月 8 日～2019年 2 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	0.009	
(投 資 信 託 証 券)	(1)	(0.005)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	20	0.134	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(20)	(0.131)	
(そ の 他)	(0)	(0.003)	
合 計	21	0.144	
期中の平均基準価額は、14,898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

(2018年 2 月 8 日～2019年 2 月 7 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		50	541	50	533

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	SPDR DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE ETF TR	3,634	899	3,661	897

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

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
外国	株式先物取引	百万円 55	百万円 55	百万円 －	百万円 －

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2018年2月8日～2019年2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
(a) 期中の株式売買金額	118,162千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	339,055千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.34

* (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

(2018年2月8日～2019年2月7日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 100	百万円 11	% 11.0	百万円 107	百万円 17	% 15.9

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2019年2月7日現在)

外国株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千米ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
AMERICAN EXPRESS CO	8	8	90	9,912	消費者金融
APPLE INC	8	8	149	16,454	コンピュータ・周辺機器
BOEING CO	8	8	353	38,824	航空宇宙・防衛
CATERPILLAR INC DEL	8	8	112	12,327	機械
CHEVRON CORP	8	8	102	11,226	石油・ガス・消耗燃料
CISCO SYSTEMS	8	8	40	4,483	通信機器
COCA COLA CO	8	8	42	4,652	飲料
DISNEY (WALT) CO	8	8	95	10,521	娯楽
DOWDUPONT INC	8	8	45	5,025	化学
EXXON MOBIL CORP	8	8	64	7,107	石油・ガス・消耗燃料
GENERAL ELEC CO	8	—	—	—	コングロマリット
GOLDMAN SACHS GROUP	8	8	168	18,568	資本市場
HOME DEPOT	8	8	158	17,444	専門小売り
INTEL CORP	8	8	42	4,712	半導体・半導体製造装置
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	8	8	117	12,873	情報技術サービス
JPMORGAN CHASE & CO	8	8	89	9,797	銀行
JOHNSON & JOHNSON	8	8	114	12,560	医薬品
MCDONALD'S CORP	8	8	151	16,638	ホテル・レストラン・レジャー
MERCK & CO INC	8	8	66	7,308	医薬品
MICROSOFT CORP	8	8	91	10,013	ソフトウェア
NIKE INC-B	8	8	71	7,811	繊維・アパレル・贅沢品
PFIZER INC	8	8	36	3,997	医薬品
PROCTER & GAMBLE CO	8	8	84	9,247	家庭用品
3M CORP	8	8	174	19,130	コングロマリット
TRAVELERS COS INC/THE	8	8	107	11,856	保険
UNITED TECHNOLOGIES	8	8	104	11,461	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	8	8	231	25,451	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	8	8	46	5,079	各種電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	8	8	121	13,362	情報技術サービス
WALMART INC	8	8	82	9,032	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	—	8	61	6,749	食品・生活必需品小売り
合 計	株 数 ・ 金 額	258	257	3,216	353,632
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	30	—	<94.9%>

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
SPDR DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE ETF TR		201	174	44	4,856	1.3
合 計	口 数 ・ 金 額	201	174	44	4,856	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<1.3%>	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
外国	株式先物取引	DJIAVMN	百万円 13 百万円 —

* 単位未満は切り捨て。

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2019年2月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 353,632	% 92.3
投資信託受益証券	4,856	1.3
コール・ローン等、その他	24,637	6.4
投資信託財産総額	383,125	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建て純資産（378,909千円）の投資信託財産総額（383,125千円）に対する比率は98.9%です。

* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝109.94円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年2月7日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	389,601,720
コール・ローン等	8,112,640
株式(評価額)	353,632,368
投資信託受益証券(評価額)	4,856,421
未収入金	17,638,210
未収配当金	233,053
差入委託証拠金	5,129,028
(B) 負債	16,813,647
未払金	8,242,567
未払解約金	8,519,276
未払利息	4
その他未払費用	51,800
(C) 純資産総額(A－B)	372,788,073
元本	244,643,650
次期繰越損益金	128,144,423
(D) 受益権総口数	244,643,650口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,238円

(注) 期首元本額は246,286,615円、期中追加設定元本額は70,081,506円、期中一部解約元本額は71,724,471円、1口当たり純資産額は1.5238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FoFs用・NYダウインデックスファンド（適格機関投資家専用） 244,643,650円

○損益の状況（2018年2月8日～2019年2月7日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,148,701
受取配当金	7,043,233
受取利息	52,279
その他収益金	53,735
支払利息	△ 546
(B) 有価証券売買損益	12,804,466
売買益	33,152,961
売買損	△ 20,348,495
(C) 先物取引等取引損益	237,910
取引益	1,574,121
取引損	△ 1,336,211
(D) 保管費用等	△ 486,239
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	19,704,838
(F) 前期繰越損益金	113,536,696
(G) 追加信託差損益金	30,532,494
(H) 解約差損益金	△ 35,629,605
(I) 計(E＋F＋G＋H)	128,144,423
次期繰越損益金(I)	128,144,423

* 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(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。

* 損益の状況の中で(H)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。