

株式インデックス 225

運用報告書(全体版)

第37期 (決算日2024年2月19日)

作成対象期間 (2023年2月18日～2024年2月19日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型
信託期間	無期限(1987年2月18日設定)
運用方針	日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目標として運用します。原則として日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている銘柄のうち200銘柄以上に等株数投資を行ない、株式の組入比率は高位に保ちます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている銘柄を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算を行ない、原則として利子・配当収入等を中心として分配します。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		株式比率 株組入比率	株式比率 株先物比率	純資産額
		税込 分配	み 金	期 騰落	中 率	日経平均トータル リターン・インデックス			
33期(2020年2月17日)	円 8,542	円 85		% 12.1	38,138.86	% 12.9	% 97.7	% 2.2	百万円 25,387
34期(2021年2月17日)	11,032	110		30.4	50,063.89	31.3	97.7	2.2	28,412
35期(2022年2月17日)	9,933	80	△	9.2	45,759.48	△ 8.6	96.5	3.4	28,815
36期(2023年2月17日)	10,087	100		2.6	47,267.39	3.3	98.8	1.2	30,916
37期(2024年2月19日)	14,173	135		41.8	67,489.99	42.8	98.3	1.6	37,595

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

※2024年2月19日基準の運用報告書より、「配当無し」の指数から「配当込み指数」に変更しております。

○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		株式比率 株組入比率	株式比率 株先物比率
	騰落率	騰落率	日経平均トータル リターン・インデックス	騰落率		
(期首) 2023年2月17日	円 10,087	% —	47,267.39	% —	% 98.8	% 1.2
2月末	10,067	△ 0.2	47,178.76	△ 0.2	97.8	2.2
3月末	10,375	2.9	48,651.96	2.9	96.4	3.5
4月末	10,672	5.8	50,068.10	5.9	95.9	4.1
5月末	11,420	13.2	53,593.44	13.4	96.6	3.3
6月末	12,278	21.7	57,670.18	22.0	96.6	3.4
7月末	12,267	21.6	57,645.38	22.0	96.8	3.1
8月末	12,062	19.6	56,720.29	20.0	96.4	3.6
9月末	11,857	17.5	55,787.13	18.0	95.6	4.3
10月末	11,479	13.8	54,040.84	14.3	95.7	4.2
11月末	12,450	23.4	58,651.09	24.1	96.3	3.6
12月末	12,454	23.5	58,704.41	24.2	97.7	2.2
2024年1月末	13,499	33.8	63,659.32	34.7	96.7	3.2
(期末) 2024年2月19日	14,308	41.8	67,489.99	42.8	98.3	1.6

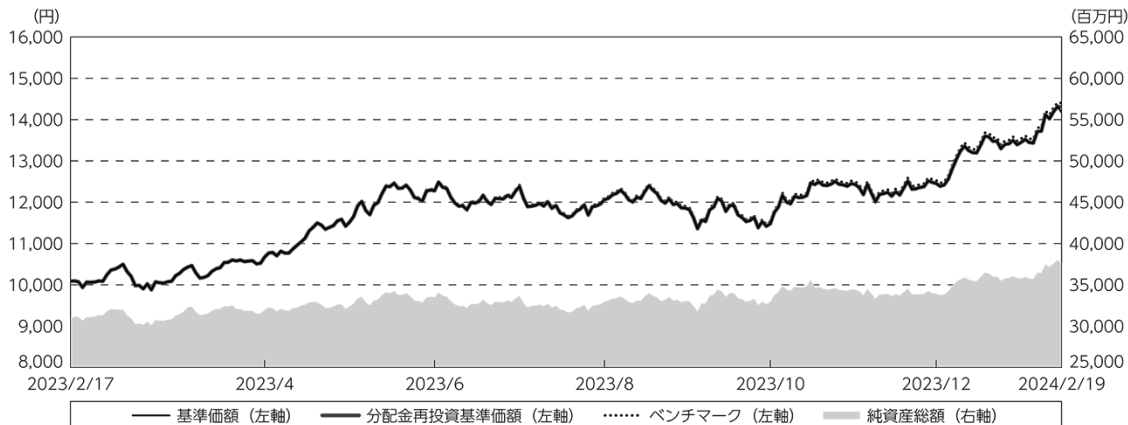
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

- ①「日経平均」及び「日経平均トータルリターン・インデックス」(以下、「日経平均」という。)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」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③本件投資信託は、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、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、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



期首：10,087円

期末：14,173円 (既払分配金(税込み)：135円)

騰落率：41.8% (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(2023年2月17日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、日経平均トータルリターン・インデックスです。ベンチマークは、作成期首(2023年2月17日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

国内株式の株価の変動

○投資環境

今期の国内株式市場は上昇しました。期初よりFRB(米連邦準備制度理事会)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、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や、2023年4月末の日銀の植田新総裁の下での金融政策決定会合において現行の金融緩和策維持が決定されたことなどから上昇しました。8月には大手格付け機関による米国債の格下げなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、中旬以降は好調な企業業績などを背景に上昇に転じました。その後は中東情勢の緊迫化を受けたり

スク回避の動きなどが株価の押し下げ材料になる局面もありましたが、米金融引き締めや日銀金融政策決定会合の行方などを巡り一進一退の展開となりました。2024年1月以降は為替の円安米ドル高傾向から企業業績への期待が高まっ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

株式の実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

日経平均トータルリターン・インデックス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トータルリターン・インデックス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

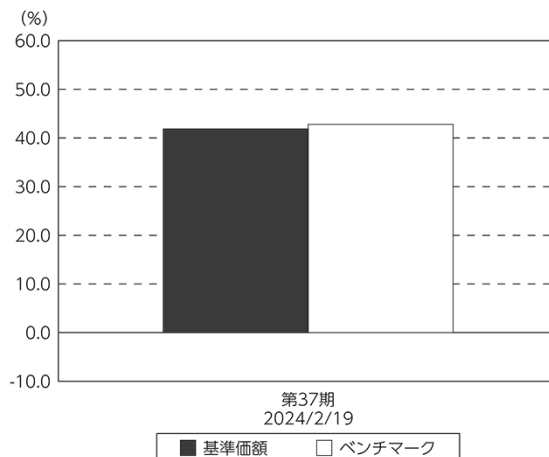
今期の基準価額の騰落率は+41.8%となり、ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックスの+42.8%を1.0ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

ファンドでは信託報酬などのコスト負担が日々生じること

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、日経平均トータルリターン・インデックスです。

◎分配金

収益分配金は、今期の経費控除後の配当等収益から決定させていただきました。
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第37期
	2023年2月18日～ 2024年2月19日
当期分配金 (対基準価額比率)	135 0.944%
当期の収益	135
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	15,614

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

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

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても、株式組入比率を高位に保ち、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目指して参ります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月18日～2024年2月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	81	0.686	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(35)	(0.299)	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 ）	(39)	(0.332)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	81	0.690	
期中の平均基準価額は、11,740円です。			

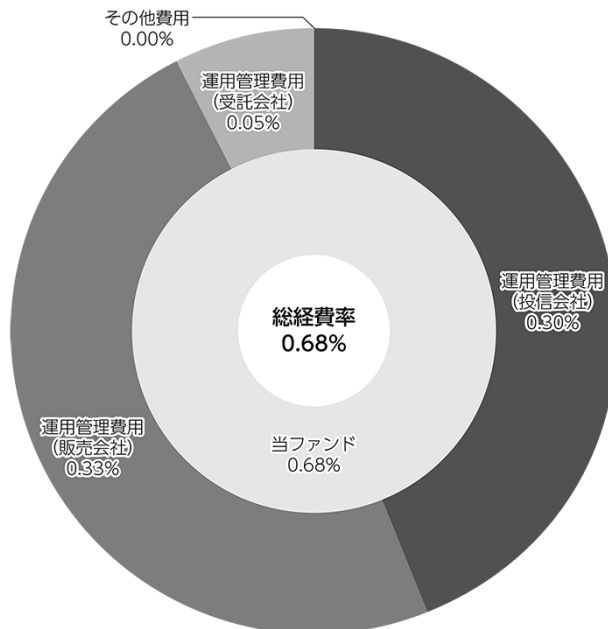
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)**○総経費率**

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.68%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

(2023年2月18日～2024年2月19日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		618	2,793,743	1,789	7,528,510
		(1,747)	()		

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		15,786	15,891	—	—

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2023年2月18日～2024年2月19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	10,322,253千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	31,949,616千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.32

* (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

(2023年2月18日～2024年2月19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		$\frac{D}{C}$		
株式先物取引	百万円 15,786	百万円 2,606	$\frac{B}{A}$ 16.5	百万円 15,891	百万円 2,125	$\frac{D}{C}$ 13.4	%

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	1	4	26

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	496千円
うち利害関係人への支払額 (B)	67千円
(B) / (A)	13.5%

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

(2024年2月19日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
水産・農林業 (0.1%)						
ニッセイ	38	32	30,211			
鉱業 (0.1%)						
INPEX	15.2	12.8	26,028			
建設業 (1.5%)						
コムシスホールディングス	38	32	106,848			
大成建設	7.6	6.4	31,097			
大林組	38	32	46,096			
清水建設	38	32	29,273			
長谷工コーポレーション	7.6	6.4	12,070			
鹿島建設	19	16	45,496			
大和ハウス工業	38	32	138,784			
積水ハウス	38	32	105,344			
日揮ホールディングス	38	32	45,184			
食料品 (3.2%)						
日清製粉グループ本社	38	32	68,384			
明治ホールディングス	7.6	12.8	44,300			
日本ハム	19	16	84,544			
サッポロホールディングス	7.6	6.4	45,126			
アサヒグループホールディングス	38	32	170,464			
キリンホールディングス	38	32	68,752			
宝ホールディングス						
宝ホールディングス	38	32	37,984			
キッコーマン						
キッコーマン	38	32	298,752			
味の素						
味の素	38	32	181,440			
ニチレイ						
ニチレイ	19	16	59,952			
日本たばこ産業						
日本たばこ産業	38	32	125,184			
繊維製品 (0.1%)						
東洋紡	3.8	—	—			
帝人	7.6	6.4	8,060			
東レ	38	32	22,243			
パルプ・紙 (0.1%)						
王子ホールディングス	38	32	18,240			
日本製紙	3.8	3.2	3,728			
化学 (6.7%)						
クラレ	38	32	48,624			
旭化成	38	32	33,584			
レゾナック・ホールディングス	3.8	3.2	10,432			
住友化学	38	32	10,035			
日産化学	38	32	199,584			
東ソー	19	16	31,984			
トクヤマ	7.6	6.4	14,972			
デンカ	7.6	6.4	16,179			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
信越化学工業	38	160	988,480
三井化学	7.6	6.4	26,028
三菱ケミカルグループ	19	16	13,792
UBE	3.8	3.2	8,262
花王	38	32	180,832
DIC	3.8	3.2	9,664
富士フイルムホールディングス	38	32	302,112
資生堂	38	32	133,600
日東電工	38	32	449,440
医薬品 (5.8%)			
協和キリン	38	32	91,456
武田薬品工業	38	32	141,920
アステラス製薬	190	160	269,200
住友ファーマ	38	32	11,776
塩野義製薬	38	32	228,320
中外製薬	114	96	554,784
エーザイ	38	32	201,504
第一三共	114	96	467,808
大塚ホールディングス	38	32	176,384
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	15.2	64	59,360
ENEOSホールディングス	38	32	20,924
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	19	16	64,832
ブリヂストン	38	32	201,216
ガラス・土石製品 (0.7%)			
AGC	7.6	6.4	34,688
日本板硝子	3.8	—	—
日本電気硝子	11.4	9.6	34,454
住友大阪セメント	3.8	3.2	11,728
太平洋セメント	3.8	3.2	10,412
東海カーボン	38	32	32,976
TOTO	19	16	59,952
日本碍子	38	32	61,552
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3.8	3.2	11,472
神戸製鋼所	3.8	3.2	6,513
JFEホールディングス	3.8	3.2	7,464
大太平洋金属	3.8	3.2	4,492
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	3.8	—	—
三井金属鉱業	3.8	3.2	14,032
東邦亜鉛	3.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱マテリアル	3.8	3.2	8,390
住友金属鉱山	19	16	65,680
DOWAホールディングス	7.6	6.4	35,942
古河電気工業	3.8	3.2	9,278
住友電気工業	38	32	68,848
フジクラ	38	32	56,304
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	3.8	3.2	7,072
機械 (4.4%)			
日本製鋼所	7.6	6.4	15,980
オークマ	7.6	6.4	45,184
アマダ	38	32	51,360
SMC	3.8	3.2	265,152
小松製作所	38	32	138,208
住友重機械工業	7.6	6.4	28,729
日立建機	38	32	135,008
クボタ	38	32	69,840
荏原製作所	7.6	6.4	70,400
ダイキン工業	38	32	685,440
日本精工	38	32	25,308
NTN	38	32	9,248
ジェイテクト	38	32	43,200
三井E&S	3.8	—	—
日立造船	7.6	6.4	6,649
三菱重工業	3.8	3.2	36,064
IHI	3.8	3.2	10,041
電気機器 (28.3%)			
コニカミノルタ	38	32	15,155
ミネベアミツミ	38	32	97,248
日立製作所	7.6	6.4	77,984
三菱電機	38	32	72,832
富士電機	7.6	6.4	58,009
安川電機	38	32	174,048
ニデック	30.4	25.6	146,534
オムロン	38	32	177,120
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.6	6.4	17,424
日本電気	3.8	3.2	31,865
富士通	3.8	3.2	75,056
ルネサスエレクトロニクス	—	32	76,864
セイコーエプソン	76	64	154,880
パナソニック ホールディングス	38	32	45,424
シャープ	38	32	26,240
ソニーグループ	38	32	431,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TDK	114	96	746,784
アルプスアルパイン	38	32	33,024
横河電機	38	32	98,240
アドバンテスト	76	256	1,739,776
キーエンス	3.8	3.2	220,096
レーザーテック	—	12.8	517,632
カシオ計算機	38	32	38,384
ファナック	38	160	653,600
京セラ	76	256	564,608
太陽誘電	38	32	107,680
村田製作所	30.4	76.8	228,940
S C R E E Nホールディングス	7.6	12.8	234,880
キャノン	57	48	201,408
リコー	38	32	40,912
東京エレクトロン	38	96	3,340,800
輸送用機器 (4.8%)			
デンソー	38	128	343,488
川崎重工業	3.8	3.2	12,140
日産自動車	38	32	18,057
いすゞ自動車	19	16	34,360
トヨタ自動車	190	160	548,800
日野自動車	38	32	15,126
三菱自動車工業	3.8	3.2	1,454
マツダ	7.6	6.4	11,145
本田技研工業	76	192	334,848
スズキ	38	32	214,784
S U B A R U	38	32	107,456
ヤマハ発動機	38	96	130,800
精密機器 (3.7%)			
テルモ	152	128	721,024
ニコン	38	32	49,696
オリンパス	152	128	280,960
H O Y A	19	16	295,120
シチズン時計	38	32	34,112
その他製品 (2.1%)			
パンダイナムコホールディングス	38	96	279,360
T O P P A Nホールディングス	19	16	56,288
大日本印刷	19	16	72,896
ヤマハ	38	32	106,400
任天堂	38	32	267,392
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	3.8	3.2	2,524
中部電力	3.8	3.2	6,136

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
関西電力	3.8	3.2	6,217
東京瓦斯	7.6	6.4	20,582
大阪瓦斯	7.6	6.4	19,609
陸運業 (1.2%)			
東武鉄道	7.6	6.4	24,838
東急	19	16	28,376
小田急電鉄	19	16	34,064
京王電鉄	7.6	6.4	27,052
京成電鉄	19	16	121,280
東日本旅客鉄道	3.8	3.2	28,963
西日本旅客鉄道	3.8	3.2	20,105
東海旅客鉄道	3.8	16	60,576
ヤマトホールディングス	38	32	77,424
N I P P O N E X P R E S Sホールディング	3.8	3.2	25,817
海運業 (0.4%)			
日本郵船	11.4	9.6	45,811
商船三井	11.4	9.6	50,515
川崎汽船	11.4	9.6	67,536
空運業 (0.3%)			
日本航空	—	32	89,184
A N Aホールディングス	3.8	3.2	10,342
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	19	16	73,296
情報・通信業 (10.3%)			
ネクソン	76	64	163,200
メルカリ	—	32	70,144
L I N Eヤフー	15.2	12.8	5,416
トレンドマイクロ	38	32	229,856
日本電信電話	15.2	320	58,016
K D D I	228	192	883,392
ソフトバンク	38	32	62,656
東宝	3.8	3.2	15,344
N T Tデータグループ	190	160	378,240
コナミグループ	38	32	313,440
ソフトバンクグループ	228	192	1,641,216
卸売業 (3.3%)			
双日	3.8	3.2	12,198
伊藤忠商事	38	32	211,840
丸紅	38	32	78,672
豊田通商	38	32	298,944
三井物産	38	32	208,384
住友商事	38	32	115,360
三菱商事	38	96	306,816

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小売業 (12.9%)			
J. フロント リテイリング	19	16	25,232
三越伊勢丹ホールディングス	38	32	68,144
セブン&アイ・ホールディングス	38	32	200,416
高島屋	19	16	36,696
丸井グループ	38	32	79,296
イオン	38	32	115,264
ニトリホールディングス	—	9.6	212,688
ファーストリテイリング	38	96	4,037,760
銀行業 (0.7%)			
しずおかフィナンシャルグループ	38	32	46,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	38	32	23,424
あおぞら銀行	3.8	3.2	6,835
三菱UFJフィナンシャル・グループ	38	32	47,920
りそなホールディングス	3.8	3.2	2,676
三井住友トラスト・ホールディングス	3.8	6.4	19,123
三井住友フィナンシャルグループ	3.8	3.2	26,192
千葉銀行	38	32	37,168
ふくおかフィナンシャルグループ	7.6	6.4	23,904
みずほフィナンシャルグループ	3.8	3.2	8,852
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	38	32	34,992
野村ホールディングス	38	32	26,937
松井証券	38	—	—
保険業 (1.0%)			
SOMPOホールディングス	7.6	6.4	57,702
MS&ADインシュアランスグループホール	11.4	9.6	72,556
第一生命ホールディングス	3.8	3.2	11,024

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東京海上ホールディングス	57	48	216,816	
T&Dホールディングス	7.6	6.4	16,451	
その他金融業 (0.8%)				
クレディセゾン	38	32	89,312	
オリックス	38	32	99,360	
日本取引所グループ	38	32	123,840	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	38	32	31,430	
三井不動産	38	32	130,368	
三菱地所	38	32	67,632	
東京建物	19	16	34,656	
住友不動産	38	32	149,952	
サービス業 (4.1%)				
エムスリー	91.2	76.8	160,972	
ディー・エヌ・エー	11.4	9.6	12,153	
電通グループ	38	32	137,760	
オリエンタルランド	—	32	177,696	
サイバーエージェント	30.4	25.6	27,379	
楽天グループ	38	32	25,360	
リクルートホールディングス	114	96	576,768	
日本郵政	38	32	45,216	
セコム	38	32	351,840	
合 計	株 数・金 額	7,273	7,849	36,967,662
	銘柄数<比率>	225	225	<98.3%>

*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	616	—

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年2月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	36,967,662	96.8
コール・ローン等、その他	1,211,236	3.2
投資信託財産総額	38,178,898	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 (2024年2月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	38,178,898,011
コール・ローン等	1,077,548,841
株式(評価額)	36,967,662,080
未収入金	69,198,090
未収配当金	64,489,000
(B) 負債	583,880,811
未払収益分配金	358,090,078
未払解約金	87,578,552
未払信託報酬	118,619,693
未払利息	113
その他未払費用	573,909
前受金	19,018,466
(C) 純資産総額(A-B)	37,595,017,200
元本	26,525,191,015
次期繰越損益金	11,069,826,185
(D) 受益権総口数	26,525,191,015口
1万円当たり基準価額(C/D)	14,173円

(注) 期首元本額は30,649,269,063円、期中追加設定元本額は7,365,290,288円、期中一部解約元本額は11,489,368,336円、1口当たり純資産額は14,173円です。

○損益の状況 (2023年2月18日～2024年2月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	541,303,784
受取配当金	541,541,860
受取利息	416
その他収益金	69,748
支払利息	△ 308,240
(B) 有価証券売買損益	9,578,857,967
売買益	11,859,567,542
売買損	△ 2,280,709,575
(C) 先物取引等取引損益	311,610,145
取引益	408,442,582
取引損	△ 96,832,437
(D) 信託報酬等	△ 228,778,495
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	10,202,993,401
(F) 前期繰越損益金	2,951,217,740
(G) 追加信託差損益金	△ 1,726,294,878
(配当等相当額)	(28,621,755,826)
(売買損益相当額)	(△30,348,050,704)
(H) 計(E+F+G)	11,427,916,263
(I) 収益分配金	△ 358,090,078
次期繰越損益金(H+I)	11,069,826,185
追加信託差損益金	△ 1,726,294,878
(配当等相当額)	(28,621,755,826)
(売買損益相当額)	(△30,348,050,704)
分準備積立金	12,796,121,063

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程 (2023年2月18日～2024年2月19日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2023年2月18日～ 2024年2月19日
a. 配当等収益(経費控除後)	529,430,180円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	8,450,319,585円
c. 信託約款に定める収益調整金	28,621,755,826円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	4,174,461,376円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	41,775,966,967円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	15,749円
g. 分配金	358,090,078円
h. 分配金(1万口当たり)	135円

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	135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

ベンチマークについて、「配当無し」で計算されている指数を「配当込み」指数とする必要の約款変更を行ないました。
 <変更適用日：2023年11月16日>