

## 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（2014年4月1日設定）	
運用方針	J P X日経400インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に実質的な投資を行い、J P X日経インデックス400（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。	
主要運用対象	ベビードファンド	J P X日経400インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の金融商品取引所上場株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビードファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。

ファンドは「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）



イーマックス

## eMAXIS J P X日経400インデックス

第9期（決算日：2023年1月26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。

さて、お手持ちの「eMAXIS J P X日経400インデックス」は、去る1月26日に第9期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **0120-151034**  
（受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## 本資料の表記にあたって

- ・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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配)	標準価額			JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額	
		税金	み	期	中	期				中
	円	分	金	騰	率	騰	率		百万円	
5期(2019年1月28日)	13,621		0	△15.5		15,467.52	△15.1	97.5	2.5	6,566
6期(2020年1月27日)	15,352		0	12.7		17,515.49	13.2	97.2	2.8	5,585
7期(2021年1月26日)	17,252		0	12.4		19,751.22	12.8	97.6	2.4	5,165
8期(2022年1月26日)	17,807		0	3.2		20,502.60	3.8	93.9	6.1	6,007
9期(2023年1月26日)	19,069		0	7.1		22,073.83	7.7	99.1	0.9	6,603

(注) JPX日経インデックス400(配当込み)とは、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。「JPX日経インデックス400(配当込み)」(以下「JPX日経インデックス400」といいます。)は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。)及び株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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ます。「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ます。ファンドは、委託会社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、その運用及びファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。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、責任を負いません。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ます。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせますので、「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。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400 (配当込み)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(配当込み)	騰 落 率 %		
(期 首) 2022年1月26日	17,807	—	20,502.60	—	93.9	6.1
1月末	17,830	0.1	20,533.68	0.2	97.6	2.4
2月末	17,711	△0.5	20,404.36	△0.5	97.2	2.8
3月末	18,516	4.0	21,340.09	4.1	96.2	3.8
4月末	18,051	1.4	20,812.33	1.5	97.1	2.9
5月末	18,190	2.2	20,980.72	2.3	97.6	2.4
6月末	17,749	△0.3	20,480.70	△0.1	96.7	3.5
7月末	18,430	3.5	21,275.60	3.8	97.6	2.3
8月末	18,654	4.8	21,545.34	5.1	98.6	1.4
9月末	17,568	△1.3	20,301.49	△1.0	94.6	5.4
10月末	18,470	3.7	21,355.66	4.2	98.0	2.0
11月末	19,082	7.2	22,075.59	7.7	97.8	2.2
12月末	18,190	2.2	21,052.19	2.7	97.9	2.1
(期 末) 2023年1月26日	19,069	7.1	22,073.83	7.7	99.1	0.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託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。

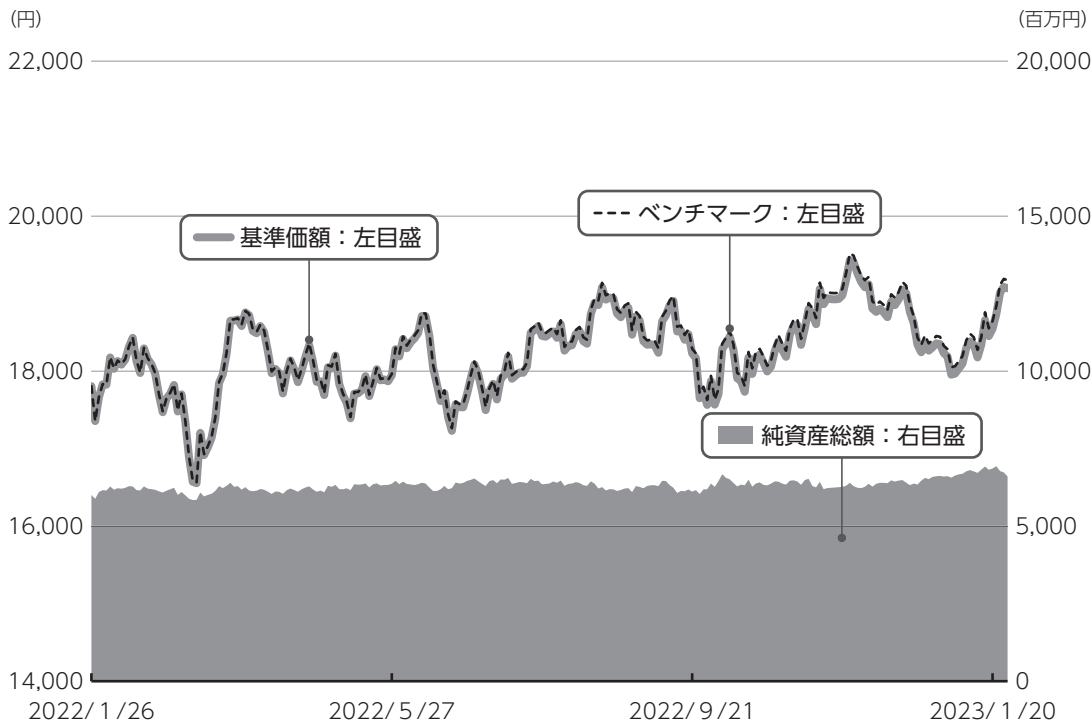
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第9期：2022年1月27日～2023年1月26日

## ▶ 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第9期首	17,807円
第9期末	19,069円
既払分配金	0円
騰落率	7.1%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

**基準価額の動き**

基準価額は期間の初めに比べ7.1%の上昇となりました。

**ベンチマークとの差異**

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（7.7%）を0.6%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第9期：2022年1月27日～2023年1月26日

## 投資環境について

### 国内株式市況

**国内株式市況は上昇しました。**

円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善や、新型コロナウイルス対策の国内規制緩和によるインバウンド需要期待等を背景に、国内株式市況は上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### eMAXIS JPY日経400インデックス

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

### JPY日経400インデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

株式ポートフォリオはベンチマークであるJPY日経インデックス400（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS JPX日経400インデックス  
ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.5\%$ 程度でした。

### マザーファンド保有による要因

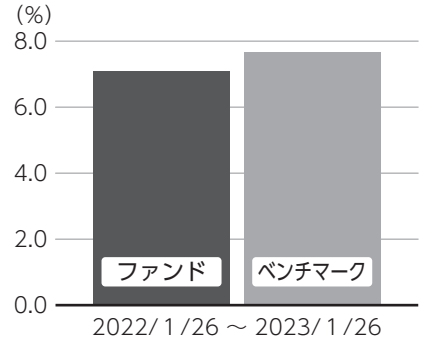
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ありません。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）と  
ベンチマークの対比（騰落率）



## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

### 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1月27日～2023年1月26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	9,068

(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 (作成対象期間末での見解です。)

### ▶ eMAXIS JPX日経400インデックス

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

### ▶ JPX日経400インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。



2022年1月27日～2023年1月26日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	80	0.440	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
( 投 信 会 社 )	(35)	(0.192)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(35)	(0.192)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(10)	(0.055)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.011	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
( 株 式 )	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.011)	
(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)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	83	0.454	

期中の平均基準価額は、18,234円です。

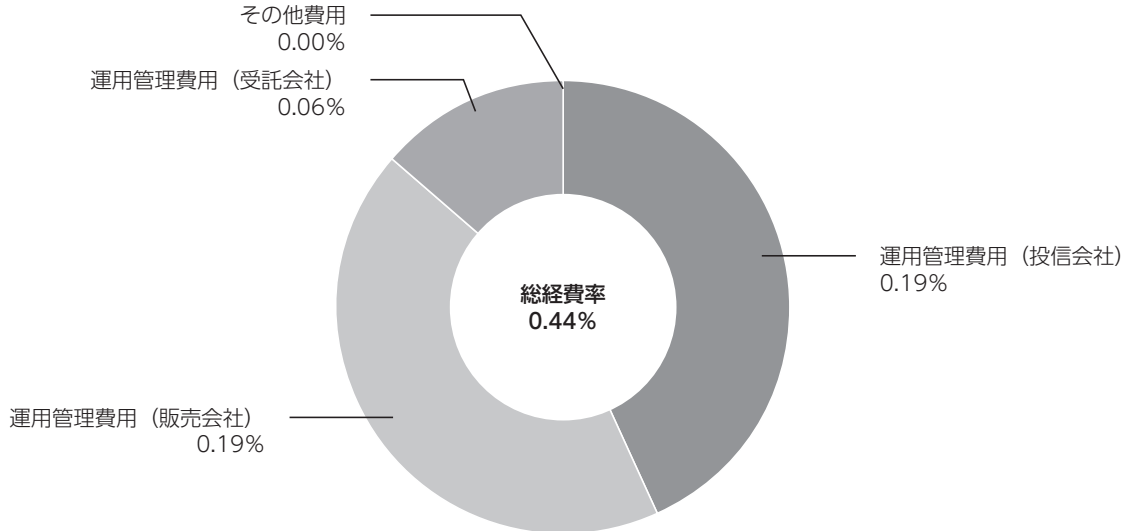
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 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親投資信託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。
- (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)

### ■ 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0.44%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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1月27日～2023年1月26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インデックスマザーファンド	千口 2,486,606	千円 4,661,214	千口 2,414,962	千円 4,635,581

## ○株式売買比率

(2022年1月27日～2023年1月26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インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	7,303,202千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,363,200千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.99	

(注) (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1月27日～2023年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;eMAXIS JPX日経400インデックス&gt;

該当事項はございません。

## &lt;JPX日経400インデックスマザーファンド&gt;

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等		
				C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 4,230	百万円 1,215	% 28.7	百万円 3,072	百万円 845	% 27.5

平均保有割合 83.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;JPX日経400インデックスマザーファンド&gt;

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 61	百万円 61	百万円 156

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

### < J P X日経400インデックスマザーファンド >

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.402

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)	676千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.264千円
(B) / (A)	0.0%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

### ○組入資産の明細

(2023年1月26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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 3,259,821	千口 3,331,465	千円 6,603,297

### ○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J P X日経400インデックスマザーファンド	千円 6,603,297	% 96.7
コール・ローン等、その他	226,676	3.3
投資信託財産総額	6,829,973	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,829,973,335
コール・ローン等	32,930,989
JPX日経400インデックスマザーファンド(評価額)	6,603,297,910
未収入金	193,744,436
(B) 負債	226,023,223
未払解約金	211,740,068
未払信託報酬	14,190,961
未払利息	14
その他未払費用	92,180
(C) 純資産総額(A-B)	6,603,950,112
元本	3,463,187,241
次期繰越損益金	3,140,762,871
(D) 受益権総口数	3,463,187,241口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,069円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 3,373,726,900円  
 期中追加設定元本額 3,739,373,567円  
 期中一部解約元本額 3,649,913,226円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9069円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2022年1月27日～ 2023年1月26日
費用控除後の配当等収益額	155,248,745円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	118,181,644円
収益調整金額	2,761,666,132円
分配準備積立金額	105,666,350円
当ファンドの分配対象収益額	3,140,762,871円
1万口当たり収益分配対象額	9,068円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

## ○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 6,476
受取利息	60
支払利息	△ 6,536
(B) 有価証券売買損益	364,981,123
売買益	540,286,353
売買損	△ 175,305,230
(C) 信託報酬等	△ 28,012,512
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	336,962,135
(E) 前期繰越損益金	42,134,604
(F) 追加信託差損益金	2,761,666,132
(配当等相当額)	( 2,188,430,902)
(売買損益相当額)	( 573,235,230)
(G) 計(D+E+F)	3,140,762,871
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,140,762,871
追加信託差損益金	2,761,666,132
(配当等相当額)	( 2,206,091,566)
(売買損益相当額)	( 555,574,566)
分配準備積立金	379,096,739

- (注) (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) (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) (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。

# J P X日経400インデックスマザーファンド

## 《第9期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023年1月26日]

「J P X日経400インデックスマザーファンド」は、1月26日に第9期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第9期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）を主要投資対象とし、J P X日経インデックス400（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400 (配当込み)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
5期(2019年1月28日)	13,910	△15.1	15,467.52	△15.1	97.5	2.5	7,392
6期(2020年1月27日)	15,747	13.2	17,515.49	13.2	97.2	2.8	6,370
7期(2021年1月26日)	17,774	12.9	19,751.22	12.8	97.6	2.4	6,206
8期(2022年1月26日)	18,427	3.7	20,502.60	3.8	93.9	6.1	6,968
9期(2023年1月26日)	19,821	7.6	22,073.83	7.7	99.2	0.9	8,201

(注) J P X日経インデックス400（配当込み）とは、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社J P X総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。「J P X日経インデックス400（配当込み）」（以下「J P X日経インデックス400」といいます。）は、株式会社J P X総研（以下「J P X総研」といいます。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）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、J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」自体及び「J P X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ます。「J P X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J P X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ます。ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、J P X総研及び日経は、その運用及びファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P X総研及び日経は、「J P X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、責任を負いません。J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X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ます。

(注) 「株先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400 (配当込み)		株 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年1月26日	円 18,427	% —	20,502.60	% —	93.9	6.1
1月末	18,452	0.1	20,533.68	0.2	97.6	2.4
2月末	18,335	△0.5	20,404.36	△0.5	97.2	2.8
3月末	19,176	4.1	21,340.09	4.1	96.2	3.8
4月末	18,701	1.5	20,812.33	1.5	97.1	2.9
5月末	18,852	2.3	20,980.72	2.3	97.6	2.4
6月末	18,402	△0.1	20,480.70	△0.1	96.7	3.5
7月末	19,115	3.7	21,275.60	3.8	97.7	2.3
8月末	19,355	5.0	21,545.34	5.1	98.6	1.4
9月末	18,235	△1.0	20,301.49	△1.0	94.6	5.4
10月末	19,178	4.1	21,355.66	4.2	98.0	2.0
11月末	19,821	7.6	22,075.59	7.7	97.8	2.2
12月末	18,901	2.6	21,052.19	2.7	97.9	2.1
(期 末) 2023年1月26日	19,821	7.6	22,073.83	7.7	99.2	0.9

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ7.6%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(7.7%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

**● 基準価額の主な変動要因**

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

**● 投資環境について****◎ 国内株式市況**

国内株式市況は上昇しました。

円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善や、新型コロナウイルス対策の入国規制緩和によるインバウンド需要期待等を背景に、国内株式市況は上昇しました。

**● 当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである J P X 日経インデックス 4 0 0（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

**● 当該投資信託のベンチマークとの差異について**

ベンチマークは7.7%の上昇になったため、乖離は△0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

**○ 今後の運用方針**

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。



## ○1万口当たりの費用明細

(2022年1月27日～2023年1月26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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.011)	
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、18,912円です。			

(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1月27日～2023年1月26日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		1,522	4,230,349	1,073	3,072,853
		( 56)	( -)		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株式分割・増資割当および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		6,102	6,496	30	30

## ○株式売買比率

(2022年1月27日～2023年1月26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	7,303,202千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,363,200千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.99

(注) (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1月27日～2023年1月26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 1,215	% 28.7	百万円 4,230	百万円 845	% 27.5	百万円 3,072

## 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 61	百万円 61	百万円 156

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.402

## 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)	816千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.306千円
(B) / (A)	0.0%

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2023年1月26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 (0.0%)</b>				
ニッスイ	4.7	5.5	2,931	
<b>鉱業 (0.4%)</b>				
I N P E X	19	20.4	30,110	
<b>建設業 (2.1%)</b>				
ウエストホールディングス	—	0.5	1,950	
ショーボンドホールディングス	—	0.8	4,360	
ミライト・ワン	1.5	1.9	2,992	
安藤・間	2.4	3.2	2,752	
東急建設	1.4	—	—	
コムシスホールディングス	1.5	1.9	4,594	
東建コーポレーション	0.1	—	—	
大成建設	3.2	3.8	16,967	
大林組	11	13.8	13,731	
清水建設	10.3	11.6	8,328	
長谷工コーポレーション	3.3	4	5,968	
鹿島建設	8	8.6	13,519	
西松建設	0.7	0.7	2,814	
三井住友建設	2.5	—	—	
戸田建設	4.5	4.7	3,280	
熊谷組	0.6	0.7	1,852	
大東建託	1.1	—	—	
N I P P O	0.9	—	—	
五洋建設	4.3	5.5	3,536	
住友林業	2.8	3	7,215	
大和ハウス工業	10.1	10.8	33,652	
積水ハウス	11.9	12.1	30,334	
関電工	1.8	2.1	1,793	
エクシオグループ	1.6	1.8	4,186	
九電工	0.8	0.9	2,997	
インフロニア・ホールディングス	4.6	4	4,116	
<b>食料品 (3.9%)</b>				
森永製菓	0.8	0.7	2,614	
カルビー	1.6	1.8	5,265	

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
森永乳業	0.6	0.7	3,314	
ヤクルト本社	2.6	2.8	26,320	
明治ホールディングス	2.3	2.4	15,936	
プリマハム	0.4	0.5	1,067	
日本ハム	1.3	1.5	5,662	
アサヒグループホールディングス	8.2	8.9	38,136	
キリンホールディングス	12.9	17.5	34,947	
宝ホールディングス	—	2.6	2,732	
サントリー食品インターナショナル	2.3	2.7	11,731	
伊藤園	1.1	—	—	
キッコーマン	2.5	2.6	17,810	
味の素	7.7	9.5	40,603	
キュービー	1.8	2.1	4,699	
カゴメ	1.3	1.8	5,526	
アリアケジャパン	0.3	—	—	
ニチレイ	1.6	1.8	4,843	
東洋水産	1.7	2	10,360	
日清食品ホールディングス	1.4	1.4	14,140	
日本たばこ産業	18.8	25.5	68,250	
<b>繊維製品 (0.4%)</b>				
帝人	3.2	3.8	4,955	
東レ	24.8	26.4	20,800	
ゴールドウイン	0.6	0.7	6,790	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
王子ホールディングス	14.3	16.4	8,724	
大王製紙	1.6	1.7	1,698	
レンゴー	3.2	3.6	3,247	
<b>化学 (7.0%)</b>				
クラレ	5	6.3	6,696	
旭化成	22.7	24.6	23,616	
レゾナック・ホールディングス	3	—	—	
住友化学	25.1	29.2	14,424	
日産化学	1.9	1.9	11,457	
東ソー	4.9	5.3	8,766	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トクヤマ	1.1	1.3	2,431
デンカ	1.2	1.4	3,728
信越化学工業	5.1	6.6	116,061
エア・ウォーター	3.2	3.7	5,772
日本酸素ホールディングス	3.3	3.8	7,995
三菱瓦斯化学	3.2	2.9	5,405
三井化学	3.1	3.3	10,065
三菱ケミカルグループ	22.9	26.6	19,543
KHネオケム	—	0.7	1,931
ダイセル	4.9	5.8	5,504
積水化学工業	7.2	8.1	15,633
日本ゼオン	3.1	2.4	3,218
アイカ工業	1	1	3,095
UBE	1.6	2	4,008
日油	1.2	1.2	6,504
花王	7.7	9.6	50,073
日本ペイントホールディングス	12.9	17.4	20,636
関西ペイント	3.5	3.6	6,372
D I C	1.4	—	—
富士フィルムホールディングス	6.1	7.6	52,592
資生堂	6.5	8.2	54,005
ライオン	4.2	4.7	6,641
ファンケル	1.4	1.7	4,513
コーセー	0.7	0.8	11,320
ポーラ・オルビスホールディングス	1.5	—	—
小林製薬	1	1.1	10,032
タカラバイオ	—	1.1	1,909
デクセリアルズ	—	1.1	3,045
日東電工	2.1	2.9	23,664
エフピコ	0.6	0.7	2,415
ニフコ	1.2	1.4	4,669
ユニ・チャーム	6.7	8.2	40,532
<b>医薬品 (7.1%)</b>			
協和キリン	4.1	4.8	14,121
武田薬品工業	25.7	30.3	126,532
アステラス製薬	30.3	37.8	74,655
住友ファーマ	2.2	2.9	2,615
塩野義製薬	4.4	5	31,570
日本新薬	0.9	0.9	6,057

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中外製薬	10.9	12.3	42,877
科研製薬	0.5	0.7	2,649
エーザイ	4.2	4.8	39,748
ロート製薬	1.8	3.8	8,899
小野薬品工業	8	7.6	22,271
参天製薬	6.5	7.4	7,459
J C Rファーマ	1	1.3	2,177
東和薬品	0.5	0.6	1,224
第一三共	27.5	34.4	150,568
大塚ホールディングス	7.3	9	37,854
ペプチドリーム	1.8	1.9	3,942
サワイグループホールディングス	0.8	—	—
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
出光興産	3.9	4.4	14,608
ENEOSホールディングス	52.6	71.3	33,867
コスモエネルギーホールディングス	1	1.6	5,992
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
横浜ゴム	2	2.2	4,690
TOYO TIRE	1.8	2.3	3,516
ブリヂストン	10.1	12.6	61,311
住友ゴム工業	3.1	3.9	4,492
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
AGC	3.2	4	18,940
太平洋セメント	2	2.5	5,462
東海カーボン	2.9	3.3	3,646
TOTO	2.5	2.6	13,104
日本碍子	3.8	4.7	8,304
日本特殊陶業	2.7	3	7,692
MARUWA	—	0.1	1,698
ニチアス	0.8	1	2,447
<b>鉄鋼 (0.9%)</b>			
日本製鉄	—	18.2	49,531
J F Eホールディングス	—	10.8	18,630
東京製鐵	—	1.1	1,547
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>			
三井金属鉱業	0.9	1.2	4,104
住友金属鉱山	4.4	4.7	24,980
DOWAホールディングス	—	0.9	4,014
住友電気工業	12.9	14	21,623

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アサヒホールディングス	1.4	1.6	3,264
<b>金属製品 (0.3%)</b>			
SUMCO	5.3	7.7	15,115
三和ホールディングス	3.3	3.7	4,650
リンナイ	0.7	0.7	6,993
<b>機械 (5.6%)</b>			
日本製鋼所	1	—	—
三浦工業	1.5	1.7	5,482
アマダ	5.5	6.3	7,175
FUJ I	1.6	1.7	3,595
オーエスジー	1.6	—	—
DMG森精機	2	2.4	4,629
ディスコ	0.5	0.6	23,430
オプトラン	0.4	0.6	1,528
ナブテスコ	2	2.5	9,137
SMC	1	1.3	84,214
小松製作所	15.8	18.6	58,180
住友重機械工業	2	2.4	6,736
日立建機	1.4	1.6	4,944
ロツェ	—	0.2	2,030
クボタ	17	21	40,467
荏原製作所	1.5	1.6	8,736
ダイキン工業	4.5	4.7	105,914
ダイフク	1.9	2	14,340
竹内製作所	0.5	0.7	1,956
ホシザキ	1	2.6	12,038
日本精工	6.6	—	—
マキタ	4.3	4.9	16,758
三菱重工業	5.5	6.9	35,307
I H I	2.2	2.5	9,887
<b>電気機器 (17.1%)</b>			
イビデン	—	2.3	11,707
ブラザー工業	4.3	5.3	10,605
ミネベアミツミ	6	6.9	15,331
日立製作所	15.9	16.8	116,239
三菱電機	34.9	41.1	57,766
富士電機	2.1	2.4	12,744
安川電機	3.8	4.7	22,889
日本電産	8.5	9.6	68,841

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オムロン	2.9	3.6	25,891
MC J	1.2	1.6	1,576
日本電気	4.4	5.6	25,984
富士通	3.1	4	74,820
ルネサスエレクトロニクス	18.9	25.9	34,317
セイコーエプソン	4.3	5.3	10,504
ワコム	2.7	3.1	1,977
アルバック	0.6	0.9	5,454
エレコム	0.8	0.9	1,204
パナソニック ホールディングス	37.3	46.9	56,162
シャープ	—	4.8	5,068
アンリツ	2.2	2.8	3,578
ソニーグループ	9.4	10.4	119,756
TDK	5.1	6.3	29,232
横河電機	3.5	4.3	9,692
アズビル	2	2.7	9,787
日本光電工業	1.4	1.8	6,165
堀場製作所	0.6	0.9	5,310
アドバンテスト	2.6	3.1	29,822
キーエンス	1.7	2.4	141,528
シスメックス	3	3.4	29,352
フェローテックホールディングス	—	1.2	3,648
レーザーテック	1.5	1.9	49,913
スタンレー電気	2.4	—	—
カシオ計算機	2.5	2.9	3,932
ファナック	3.1	3.9	86,853
浜松ホトニクス	2.5	3.2	22,336
新光電気工業	—	1.4	5,264
京セラ	4.9	6.1	40,943
太陽誘電	1.7	1.9	8,388
村田製作所	10.3	11.9	88,881
小糸製作所	1.9	4.7	9,832
S C R E E Nホールディングス	0.6	0.7	6,720
東京エレクトロン	2.2	2.6	118,404
<b>輸送用機器 (5.5%)</b>			
トヨタ紡織	1.4	1.7	3,214
豊田自動織機	2.8	2.9	23,113
デンソー	7.7	8.1	56,254
いすゞ自動車	11	11.4	18,137

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トヨタ自動車	52.1	58.8	111,308
日野自動車	4.4	—	—
アイシン	2.6	3	11,205
本田技研工業	27.5	32	100,416
スズキ	8	7.2	34,387
SUBARU	10	12.4	26,077
ヤマハ発動機	4.6	6.2	19,623
豊田合成	1.1	1.1	2,311
シマノ	1.4	1.6	37,024
ティ・エス テック	1.5	1.8	2,849
<b>精密機器 (3.3%)</b>			
テルモ	9.9	12.3	47,047
島津製作所	4.5	4.8	19,056
ブイ・テクノロジー	0.2	—	—
東京精密	0.6	0.9	4,072
オリンパス	18.3	24.6	60,442
HOYA	6.8	8.4	122,346
朝日インテック	3.8	5.2	11,949
<b>その他製品 (2.0%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	3.1	3.6	31,104
パイロットコーポレーション	0.6	0.6	2,757
ヤマハ	2.1	2.5	12,500
ビジョン	2.1	2.5	5,117
任天堂	1.5	19.6	110,446
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			
中部電力	10.7	14.5	18,531
関西電力	13.2	15.2	18,635
中国電力	5.5	—	—
東北電力	8.2	—	—
九州電力	7.2	9.1	6,506
北海道電力	3	3.8	1,729
電源開発	3	3	6,201
イーレックス	0.5	0.7	1,671
レノバ	0.7	1	2,254
東京瓦斯	6.7	8.3	20,974
大阪瓦斯	6.3	8	16,288
<b>陸運業 (1.2%)</b>			
SBSホールディングス	—	0.4	1,173
東海旅客鉄道	2.9	3	48,015

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
阪急阪神ホールディングス	4.1	—	—
ヤマトホールディングス	4.6	5	10,470
山九	0.9	1	4,805
センコーグループホールディングス	1.7	2.1	2,047
日立物流	0.6	0.2	1,780
AZ-COM丸和ホールディングス	0.7	0.9	1,449
九州旅客鉄道	2.6	—	—
SGホールディングス	6.3	7.5	14,010
NIPPON EXPRESSホールディン	1.1	1.5	11,070
<b>海運業 (0.8%)</b>			
日本郵船	2.8	10.5	33,232
商船三井	1.8	6.9	22,666
川崎汽船	—	3.3	9,088
<b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b>			
三井倉庫ホールディングス	—	0.4	1,472
近鉄エクスプレス	0.6	—	—
<b>情報・通信業 (9.4%)</b>			
NECネットエスアイ	1.1	1.3	2,291
システナ	4.9	6.6	2,686
日鉄ソリューションズ	0.5	0.7	2,345
T I S	3.3	4.4	16,434
コーエーテクモホールディングス	1.1	2.5	6,085
ネクソン	7.7	10.2	31,875
ティーガイア	0.3	0.4	658
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.9	1.2	2,626
GMOペイメントゲートウェイ	0.7	0.9	10,926
インターネットイニシアティブ	—	2.2	5,161
ラクス	1.6	1.9	3,408
アカツキ	0.2	—	—
チェンジ	—	1	2,428
野村総合研究所	6.6	8.1	26,568
インフォコム	0.4	0.5	1,096
オービック	1.1	1.3	27,443
ジャストシステム	0.5	0.6	1,941
Zホールディングス	49.8	56.1	21,177
トレンドマイクロ	1.8	2.3	14,490
日本オラクル	0.7	0.8	7,128
伊藤忠テクノソリューションズ	1.6	2.1	6,594
大塚商会	1.9	2.2	9,482

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電通国際情報サービス	0.5	0.5	2,110
東映アニメーション	0.1	0.2	2,658
デジタルガレージ	0.6	0.7	3,237
ネットワンシステムズ	—	1.5	5,310
B I P R O G Y	1.1	1.5	5,130
USEN-NEXT HOLDINGS	0.3	0.4	880
日本電信電話	31.3	30.8	120,335
KDD I	25	25.9	106,397
ソフトバンク	—	63.4	94,434
光通信	0.4	0.5	9,430
GMOインターネットグループ	—	1.5	3,877
東宝	2	2.5	12,000
エヌ・ティ・ティ・データ	9.1	12.4	24,973
D T S	—	0.8	2,496
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.6	2	12,460
カブコン	3.2	3.9	16,380
S C S K	2.4	3.2	6,745
NSD	—	1.4	3,260
コナミグループ	1.2	1.7	10,931
ソフトバンクグループ	9.8	19.3	119,621
<b>卸売業 (6.8%)</b>			
双日	3.8	4.4	11,343
アルフレッサ ホールディングス	3.8	4.2	6,833
神戸物産	2.7	3.2	12,240
ダイワボウホールディングス	1.7	1.7	3,313
TOKAIホールディングス	1.7	2.1	1,795
シップヘルスケアホールディングス	1.1	1.5	3,826
コマダホールディングス	0.8	—	—
メディカルホールディングス	3.7	4.3	7,430
日本ライフライン	1	—	—
伊藤忠商事	24.1	25.6	106,496
丸紅	33.9	32.9	52,557
豊田通商	3.5	3.6	19,404
兼松	1.3	1.6	2,438
三井物産	26.7	30.4	118,833
住友商事	21.7	25.8	60,139
三菱商事	25.8	26	115,362
阪和興業	—	0.7	2,807
岩谷産業	0.8	0.9	5,013

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
PAL TAC	0.5	0.7	3,244
日鉄物産	0.2	0.3	2,772
ミスミグループ本社	4.3	6.3	20,443
<b>小売業 (4.1%)</b>			
ローソン	0.8	1	5,100
エービーシー・マート	0.5	0.6	4,164
日本マクドナルドホールディングス	1.6	2.3	11,730
セリア	0.8	1.1	3,164
ビックカメラ	2	—	—
M o n o t a R O	4.3	5.9	11,811
マツキヨココカラ&カンパニー	1.5	2.5	16,300
Z O Z O	2.4	2.8	9,282
ウエルシアホールディングス	1.8	2.2	6,331
クリエイトSDホールディングス	0.5	0.7	2,411
ネクステージ	—	0.9	2,497
コスモス薬品	0.3	0.5	6,310
セブン&アイ・ホールディングス	13.5	14.3	87,358
ツルハホールディングス	0.8	1	9,390
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.4	2,920
FOOD & LIFE COMPANIE	2	2.4	7,192
ノジマ	0.6	1.4	1,895
良品計画	4	5.4	7,678
コーナン商事	0.5	0.6	1,974
パン・パシフィック・インターナショナルホ	6.9	9.3	22,580
ゼンショーホールディングス	1.7	2.3	7,567
ワークマン	0.4	0.5	2,630
スギホールディングス	0.7	0.8	4,520
日本瓦斯	—	2.2	4,483
ライフコーポレーション	0.3	0.4	1,095
丸井グループ	2.7	3.1	6,761
イズミ	0.6	0.6	1,726
ヤオコー	0.4	0.5	3,345
ケーズホールディングス	3.2	3.3	3,795
アインホールディングス	0.5	—	—
ニトリホールディングス	1.4	1.7	28,543
ファーストリテイリング	0.5	0.6	46,398
サンドラッグ	1.3	1.6	5,760
<b>銀行業 (6.6%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	17.9	19.2	6,259

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
コンコルディア・フィナンシャルグループ	19.7	21.3	12,183	
SBI新生銀行	2.2	1.1	2,603	
あおぞら銀行	1.9	2.4	6,240	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	154.6	152.3	144,989	
りそなホールディングス	39.4	49.4	36,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	6.5	7	33,299	
三井住友フィナンシャルグループ	23.8	28.3	159,781	
千葉銀行	11.5	10.8	10,465	
ふくおかフィナンシャルグループ	2.9	3.1	9,300	
セブン銀行	10.2	13.9	3,669	
みずほフィナンシャルグループ	44.1	56	113,036	
<b>証券、商品先物取引業 (0.7%)</b>				
FPG	1.2	—	—	
GMOフィナンシャルホールディングス	0.6	0.9	518	
SBIホールディングス	4.3	—	—	
ジャフコグループ	0.4	1.3	3,149	
大和証券グループ本社	25.8	27.7	16,758	
野村ホールディングス	52.6	71.3	36,790	
マネックスグループ	—	4.3	2,098	
<b>保険業 (3.2%)</b>				
SOMPOホールディングス	5.7	6.6	37,897	
MS&ADインシュアランスグループホール	7.7	7.9	33,614	
第一生命ホールディングス	17	19.7	60,301	
東京海上ホールディングス	11.3	39	107,991	
T&Dホールディングス	8.9	10.4	21,278	
<b>その他金融業 (1.3%)</b>				
全国保証	0.8	1	4,905	
芙蓉総合リース	0.4	0.4	3,524	
みずほリース	0.5	0.6	2,046	
東京センチュリー	0.7	0.7	3,136	
イオンフィナンシャルサービス	1.9	2.2	2,877	
アコム	6.1	6.1	1,933	
オリエントコーポレーション	9.3	1	1,169	
オリックス	20.9	25.9	58,676	
三菱HCキャピタル	12.7	15.1	10,041	
日本取引所グループ	8.7	10.9	20,720	
<b>不動産業 (2.2%)</b>				
大東建託	—	1.4	20,076	
いちご	3.8	—	—	

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
ヒューリック	8.2	9	9,459	
野村不動産ホールディングス	1.8	2.4	6,979	
サムティ	0.6	—	—	
プレサンスコーポレーション	0.4	0.5	814	
オープンハウスグループ	1.1	1.4	7,042	
東急不動産ホールディングス	10.1	11.6	7,598	
飯田グループホールディングス	2.9	3.4	7,303	
ケイアイスター不動産	—	0.2	967	
三井不動産	15.7	16.8	41,076	
三菱地所	22.6	23.4	39,429	
東京建物	3.4	3.7	5,997	
住友不動産	7.2	7	22,358	
スターツコーポレーション	0.5	0.6	1,534	
日本エスコン	0.6	0.9	708	
イオンモール	1.7	2	3,656	
カチタス	0.9	1	3,080	
<b>サービス業 (3.7%)</b>				
MIIXI	0.8	—	—	
日本M&Aセンターホールディングス	5.5	—	—	
UTグループ	0.5	0.6	1,558	
エス・エム・エス	1.1	1.5	5,122	
パーソルホールディングス	3.3	4.5	12,847	
総合警備保障	1.3	1.5	5,272	
カカコム	2.4	3	6,501	
ディップ	0.6	0.7	2,719	
ベネフィット・ワン	1.2	1.9	4,050	
エムスリー	5.9	8	28,792	
アウトソーシング	1.9	—	—	
博報堂DYホールディングス	4.6	5.2	7,311	
バリューコマース	—	0.3	599	
H. U. グループホールディングス	—	1.2	3,356	
オリエンタルランド	3.9	—	—	
ビー・エム・エル	—	0.5	1,685	
ユー・エス・エス	3.7	4.2	8,878	
サイバーエージェント	—	9.7	11,989	
フルキャストホールディングス	0.3	0.4	1,136	
エン・ジャパン	0.5	0.7	1,746	
テクノプロ・ホールディングス	2	2.7	10,908	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.2	—	—	



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャパンマテリアル	1	1.2	2,864
リクルートホールディングス	19.9	28.5	121,723
ベルシステム24ホールディングス	0.5	0.5	745
ペイカレント・コンサルティング	0.2	3.2	17,888
ジャパンエレベーターサービスホールディン	1.1	1.4	2,503
リログループ	1.8	2.3	5,124
カナモト	0.6	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
トランス・コスモス	—	0.5	1,695	
セコム	3.3	4.1	31,906	
メイテック	0.4	1.6	3,963	
イオンディライト	0.4	0.4	1,214	
合 計	株数・金額	2,338	2,843	8,131,799
	銘柄数<比率>	400	400	<99.2%>

(注) 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。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 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 69	百万円 —

### ○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 8,131,799	% 96.8
コール・ローン等、その他	265,727	3.2
投資信託財産総額	8,397,526	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,395,134,976
コール・ローン等	116,957,294
株式(評価額)	8,131,799,200
未収入金	132,506,682
未収配当金	13,743,300
差入委託証拠金	128,500
(B) 負債	193,744,508
未払解約金	193,744,456
未払利息	52
(C) 純資産総額(A-B)	8,201,390,468
元本	4,137,819,966
次期繰越損益金	4,063,570,502
(D) 受益権総口数	4,137,819,966口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,821円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 3,781,507,945円  
 期中追加設定元本額 2,789,309,924円  
 期中一部解約元本額 2,432,997,903円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9821円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

eMAXIS J P X 日 経 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス	3,331,465,572円
国内株式セレクション(ラップ向け)	778,214,866円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	23,395,099円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	3,920,141円
国際 J P X 日 経 イ ン デ ッ ク ス 4 0 0 オ ー プ ン (適格機関投資家専用)	824,288円
合計	4,137,819,966円

## ○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	200,977,707
受取配当金	201,071,540
受取利息	947
その他収益金	740
支払利息	△ 95,520
(B) 有価証券売買損益	429,549,076
売買益	794,741,265
売買損	△ 365,192,189
(C) 先物取引等取引損益	40,029,230
取引益	99,797,860
取引損	△ 59,768,630
(D) 当期損益金(A+B+C)	670,556,013
(E) 前期繰越損益金	3,186,569,757
(F) 追加信託差損益金	2,443,935,377
(G) 解約差損益金	△2,237,490,645
(H) 計(D+E+F+G)	4,063,570,502
次期繰越損益金(H)	4,063,570,502

- (注) (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。  
 (注) (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) (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。