

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	2025年2月5日まで（2015年2月25日設定）	
運用方針	<p>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、主とし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。）に投資を行います。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。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	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	<p>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。</p> <p>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。）</p>	

※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。

運用報告書（全体版）

J P X日経400インデックス ファンド（ラップ向け）

第6期（決算日：2021年2月5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「J P X日経400インデックスファンド（ラップ向け）」は、去る2月5日に第6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。

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 (分配落)	額			J P X日経インデックス400		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額	
		税 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	(配当込み)				期 騰 落
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円	
2期(2017年2月6日)	10,283		0		12.2	14,600	12.6	97.5	2.4	1,558
3期(2018年2月5日)	12,390		0		20.5	17,666	21.0	97.4	2.6	108
4期(2019年2月5日)	11,003		0		△11.2	15,742	△10.9	98.7	1.3	59
5期(2020年2月5日)	12,201		0		10.9	17,513	11.2	97.1	2.9	34
6期(2021年2月5日)	13,972		0		14.5	20,096	14.7	97.7	2.3	11

(注) J P X日経インデックス400（配当込み）とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出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）（J P X日経インデックス400といいます）」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日本経済新聞社」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グループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「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、すべてJ P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およ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グループと日本経済新聞社は、「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、遅延または中断に関して、責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「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およ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) 2020年2月5日	12,201	—	17,513	—	97.1	2.9
2月末	10,871	△10.9	15,608	△10.9	98.6	1.4
3月末	10,188	△16.5	14,619	△16.5	96.2	3.8
4月末	10,630	△12.9	15,263	△12.8	96.5	3.5
5月末	11,399	△ 6.6	16,371	△ 6.5	97.3	2.7
6月末	11,390	△ 6.6	16,361	△ 6.6	97.8	2.2
7月末	10,939	△10.3	15,718	△10.2	98.4	1.6
8月末	11,838	△ 3.0	17,015	△ 2.8	97.4	2.6
9月末	11,937	△ 2.2	17,167	△ 2.0	98.2	2.1
10月末	11,603	△ 4.9	16,690	△ 4.7	97.7	2.4
11月末	13,036	6.8	18,744	7.0	97.7	2.3
12月末	13,368	9.6	19,225	9.8	98.9	1.1
2021年1月末	13,424	10.0	19,307	10.2	98.1	1.9
(期 末) 2021年2月5日	13,972	14.5	20,096	14.7	97.7	2.3

(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6期：2020年2月6日～2021年2月5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6期首	12,201円
第6期末	13,972円
既払分配金	0円
騰落率	14.5%

※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

基準価額は期首に比べ14.5%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（14.7%）を0.2%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6期：2020年2月6日～2021年2月5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。

期首から2020年3月下旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的流行（パンデミック）を受けて下落する局面もありましたが、日銀によるETF（上場投資信託）の積極的な買入れや、主要国の経済対策への期待、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり、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

▶ J P X日経400インデックス ファンド（ラップ向け）

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。

▶ J P X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J P X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

▶ J P X 日経 4 0 0 インデックスファンド（ラップ向け）

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.2\%$ 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 $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

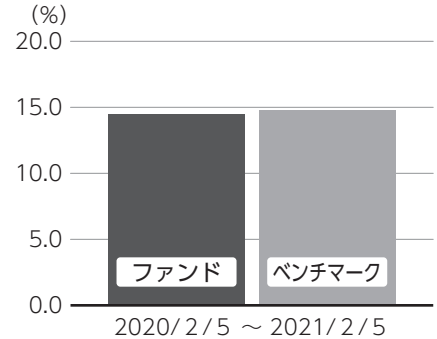
マザーファンド保有による影響は 0.2% 程度でした。

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：組入要因によるものです。

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6期 2020年2月6日～2021年2月5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	4,019

（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。）

▶ **J P X日経400インデックス
ファンド（ラップ向け）**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **J P X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。

2020年2月6日～2021年2月5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	36	0.302	(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）	(24)	(0.205)	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）	(6)	(0.054)	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）	(5)	(0.043)	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	0.013	(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)	(0.001)	
（先物・オプション）	(1)	(0.012)	
(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)	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	38	0.317	

期中の平均基準価額は、11,787円です。

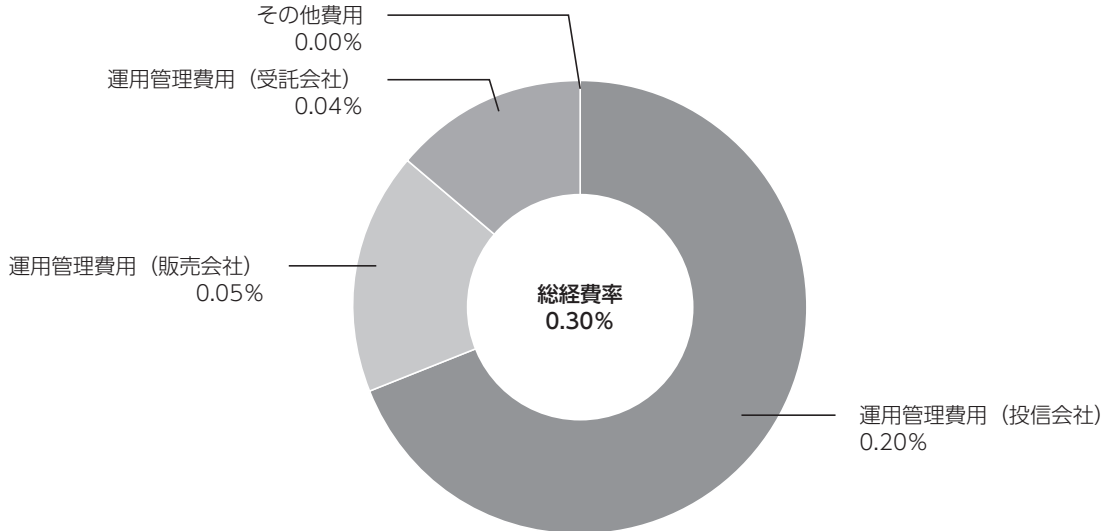
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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0.30%**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

(2020年2月6日～2021年2月5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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 3,261	千円 5,040	千口 18,955	千円 27,060

○株式売買比率

(2020年2月6日～2021年2月5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	
	J P X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	4,547,658千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,207,384千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.73	

(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

(2020年2月6日～2021年2月5日)

利害関係人との取引状況

<J P X日経400インデックスファンド（ラップ向け）>

該当事項はございません。

<J P X日経400インデックスマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 1,844	百万円 205	% 11.1	百万円 2,703	百万円 451	% 16.7

平均保有割合 0.3%

※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

<J P X日経400インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 46	百万円 30	百万円 107

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 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド >

種 類	買 付 額
株式	百万円 3

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)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.064千円
(B) / (A)	2.3%

(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UFJリース、アコム、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2021年2月5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 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 22,179	千口 6,484	千円 11,729

○投資信託財産の構成

(2021年2月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J P X 日 経 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 11,729	% 99.8
コール・ローン等、その他	28	0.2
投資信託財産総額	11,757	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年2月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,757,375
コール・ローン等	27,727
J P X日経400インデックスマザーファンド(評価額)	11,729,043
未収入金	605
(B) 負債	27,352
未払信託報酬	27,189
その他未払費用	163
(C) 純資産総額(A－B)	11,730,023
元本	8,395,338
次期繰越損益金	3,334,685
(D) 受益権総口数	8,395,338口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,972円

<注記事項>

- ①期首元本額 28,627,244円
 期中追加設定元本額 4,353,105円
 期中一部解約元本額 24,585,011円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,972円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年2月6日～ 2021年2月5日
費用控除後の配当等収益額	230,851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	1,152,905円
収益調整金額	1,240,679円
分配準備積立金額	750,031円
当ファンドの分配対象収益額	3,374,466円
1万口当たり収益分配対象額	4,019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（2020年2月6日～2021年2月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,493,650
売買益	3,484,523
売買損	△1,990,873
(B) 信託報酬等	△ 63,573
(C) 当期損益金(A+B)	1,430,077
(D) 前期繰越損益金	703,710
(E) 追加信託差損益金	1,200,898
(配当等相当額)	(1,225,767)
(売買損益相当額)	(△ 24,869)
(F) 計(C+D+E)	3,334,685
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	3,334,685
追加信託差損益金	1,200,898
(配当等相当額)	(1,240,679)
(売買損益相当額)	(△ 39,781)
分配準備積立金	2,133,787

- (注) (A)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) (B)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) (E)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7期》決算日2021年1月26日

〔計算期間：2020年1月28日～2021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7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7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
3期(2017年1月26日)	13,375	15.4	14,857.46	15.4	97.2	2.8	12,083
4期(2018年1月26日)	16,392	22.6	18,221.38	22.6	97.3	2.7	8,332
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

(注) J P X日経インデックス400（配当込み）とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、J ASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出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）（J P X日経インデックス400といえます）」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日本経済新聞社」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グループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「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、すべてJ P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およ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グループと日本経済新聞社は、「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、遅延または中断に関して、責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「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および公表を停止する権利を有しています。

(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 組 入 比 率 %	株 先 物 比 率 %
	騰 落 率 %	騰 落 率 %				
(期 首) 2020年1月27日	円 15,747	—	17,515.49	—	97.2	2.8
1月末	15,583	△ 1.0	17,334.61	△ 1.0	97.3	2.7
2月末	14,033	△10.9	15,608.03	△10.9	98.6	1.4
3月末	13,155	△16.5	14,619.02	△16.5	96.2	3.8
4月末	13,729	△12.8	15,263.44	△12.9	96.5	3.5
5月末	14,726	△ 6.5	16,371.21	△ 6.5	97.3	2.7
6月末	14,719	△ 6.5	16,361.03	△ 6.6	97.8	2.2
7月末	14,140	△10.2	15,717.99	△10.3	98.4	1.6
8月末	15,306	△ 2.8	17,015.46	△ 2.9	97.4	2.6
9月末	15,438	△ 2.0	17,167.47	△ 2.0	98.2	2.1
10月末	15,010	△ 4.7	16,690.07	△ 4.7	97.7	2.4
11月末	16,867	7.1	18,743.72	7.0	97.7	2.3
12月末	17,301	9.9	19,225.39	9.8	98.9	1.1
(期 末) 2021年1月26日	17,774	12.9	19,751.22	12.8	97.6	2.4

(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

基準価額は期首に比べ12.9%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(12.8%)を0.1%上回りました。

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。

期首から2020年3月下旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的流行（パンデミック）を受けて下落する局面もありましたが、日銀によるETF（上場投資信託）の積極的な買入れや、主要国の経済対策への期待、新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり、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

ベンチマークは12.8%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)

- ・組入要因によるものです。

(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

(2020年1月28日～2021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)	(0.001)	
(先物・オプション)	(2)	(0.014)	
合 計	2	0.014	
期中の平均基準価額は、15,166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

(2020年1月28日～2021年1月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 849 (△409)	千円 1,758,802 ()	千株 1,014	千円 2,591,949

(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 内	株式先物取引	百万円 5,583	百万円 5,653	百万円 119	百万円 120

○株式売買比率

(2020年1月28日～2021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	4,350,752千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,226,598千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69

(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

(2020年1月28日～2021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 1,758	百万円 204	% 11.6	百万円 2,591	百万円 451	% 17.4

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
株式	百万円 45	百万円 30	百万円 98

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 3

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)	918千円
うち利害関係人への支払額 (B)	22千円
(B) / (A)	2.4%

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UFJリース、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021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
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	4.5	4.1	1,808	
マルハニチロ	0.7	0.6	1,413	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	18.2	15.2	9,211	
建設業 (2.2%)				
安藤・間	2.7	2.5	1,802	
東急建設	1.3	1.2	622	
コムシスホールディングス	1.6	1.5	4,612	
東建コーポレーション	—	0.1	800	
大成建設	3.5	3.2	11,088	
大林組	10.5	9.6	8,726	
清水建設	10.6	9.7	7,478	
長谷工コーポレーション	4.1	3.7	4,613	
鹿島建設	8.2	7.5	10,650	
西松建設	0.8	0.7	1,698	
三井住友建設	2.5	2.3	1,018	
前田建設工業	2.6	2.4	2,150	
戸田建設	4.3	4	2,980	
熊谷組	0.5	0.4	1,058	
大東建託	1.3	1	9,650	
N I P P O	0.9	0.8	2,153	
五洋建設	4.1	3.8	3,412	
住友林業	2.7	2.4	4,915	
大和ハウス工業	10.4	9.5	28,519	
積水ハウス	11.4	10.4	21,902	
協和エクシオ	1.6	1.4	3,837	
九電工	0.7	0.7	2,247	
食料品 (3.6%)				
森永製菓	0.8	0.7	2,793	
江崎グリコ	1	—	—	
寿スビリッソ	—	0.3	1,665	
カルビー	1.5	1.4	4,466	
森永乳業	—	0.6	3,120	

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
ヤクルト本社	2.3	2.1	11,487	
明治ホールディングス	2.2	2	14,160	
日本ハム	1.3	1.2	5,454	
アサヒグループホールディングス	7	6.7	28,401	
キリンホールディングス	14.2	13	29,698	
サントリー食品インターナショナル	2.2	2	7,270	
伊藤園	—	0.9	5,895	
キッコーマン	2.4	2.2	16,478	
味の素	7.4	6.8	16,721	
キュービー	1.9	1.7	3,904	
カゴメ	—	1.2	4,122	
アリアケジャパン	0.3	0.3	2,046	
ニチレイ	1.6	1.5	4,471	
東洋水産	1.7	1.6	8,480	
日清食品ホールディングス	1.4	1.3	11,830	
日本たばこ産業	19.3	16.4	34,112	
繊維製品 (0.4%)				
帝人	2.7	2.4	4,684	
東レ	23.7	21.6	15,424	
ゴールドウイン	0.6	0.5	3,200	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	13.7	12.5	7,912	
化学 (7.8%)				
クラレ	5.1	4.7	5,311	
旭化成	21.7	19.8	23,354	
昭和電工	2.3	2.3	5,591	
住友化学	24	21.9	10,840	
日産化学	1.8	1.6	9,520	
東ソー	5.1	4.6	8,298	
トクヤマ	0.9	0.9	2,355	
デンカ	1.2	1.1	4,493	
信越化学工業	5.6	5.1	98,430	
エア・ウォーター	3	2.8	4,925	
日本酸素ホールディングス	3.1	2.9	6,026	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱瓦斯化学	3.1	2.8	6,946
三井化学	3	2.8	8,526
J S R	3	2.8	9,646
三菱ケミカルホールディングス	21.8	19.9	14,646
KHネオケム	—	0.5	1,257
ダイセル	4.5	3.7	2,923
積水化学工業	7	6.3	12,209
アイカ工業	1	0.9	3,190
宇部興産	1.7	1.5	3,052
日立化成	1.5	—	—
ダイキョーニシカワ	0.7	—	—
日油	1.2	1.1	5,500
花王	8	7.3	55,063
日本ペイントホールディングス	2.7	2.5	23,850
関西ペイント	3.7	3.4	10,053
D I C	1.4	1.3	3,364
資生堂	6.6	6.1	42,462
ライオン	4.3	4	9,352
ファンケル	—	1.2	4,650
コーセー	0.6	0.6	9,816
ポーラ・オルビスホールディングス	1.4	1.3	2,774
小林製薬	0.9	0.9	10,530
日東電工	2.3	2.1	19,656
ニフコ	1.2	1.1	4,031
ユニ・チャーム	6.4	6.5	30,985
医薬品 (6.8%)			
協和キリン	3.4	3.1	9,169
武田薬品工業	21.3	21.4	80,934
アステラス製薬	29.3	26.4	45,764
大日本住友製薬	2.5	2.3	3,530
塩野義製薬	4.3	3.8	21,648
日本新薬	0.9	0.8	5,792
中外製薬	3.5	9.5	52,563
科研製薬	0.6	0.5	2,050
エーザイ	4	3.6	28,083
ロート製薬	—	1.6	5,000
小野薬品工業	7.7	7	22,407
久光製薬	0.9	0.8	4,848
参天製薬	6.2	5.7	9,690

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
沢井製薬	0.7	0.6	2,880
第一三共	9.5	24.8	88,139
大塚ホールディングス	6.4	6.3	28,337
ペプチドリーム	1.7	—	—
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	3.8	3.4	8,612
ENEOSホールディングス	50.2	45.8	19,588
コスモエネルギーホールディングス	1	0.9	2,040
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	1.9	1.8	2,982
TOYO TIRE	—	1.6	2,561
ブリヂストン	10.3	8.1	32,003
住友ゴム工業	3	2.7	2,659
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	3.3	2.8	10,556
太平洋セメント	2.1	1.9	5,055
東海カーボン	3.5	3	4,587
OTO	2.4	2.2	12,738
日本碍子	4.1	3.7	6,615
日本特殊陶業	2.6	2.3	4,135
ニチアス	0.9	0.8	1,954
鉄鋼 (0.4%)			
日本製鉄	14.8	13.5	16,908
ジェイ エフ イー ホールディングス	8.9	8.1	7,678
日立金属	3.6	—	—
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	8.3	—	—
住友金属鉱山	4.2	3.9	18,837
DOWAホールディングス	0.8	—	—
古河電気工業	1	0.9	2,570
住友電気工業	12.3	11.3	16,147
アサヒホールディングス	—	0.5	2,100
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	3.9	3.9	9,367
三和ホールディングス	3.2	2.8	3,362
リンナイ	0.6	0.6	6,612
東プレ	0.6	—	—
機械 (6.2%)			
日本製鋼所	—	0.9	2,718

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三浦工業	—	1.3	7,787
アマダ	4.2	3.7	4,447
F U J I	—	1.3	3,695
オーエスジー	1.5	1.5	2,962
DMG森精機	2.1	1.9	3,083
ディスコ	0.4	0.4	15,060
ナブテスコ	1.9	1.8	8,838
三井海洋開発	0.4	—	—
SMC	1	1	66,460
小松製作所	15.1	13.8	39,516
住友重機械工業	1.9	1.7	5,045
日立建機	1.3	1.2	3,804
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.7	—	—
クボタ	17.7	16	38,176
ダイキン工業	4.3	3.9	88,276
ダイフク	1.7	1.6	20,144
竹内製作所	0.6	0.5	1,192
T P R	0.4	—	—
ホシザキ	—	1	8,940
日本精工	6.3	5.7	5,517
ジェイテクト	3.2	—	—
THK	1.9	1.9	6,792
マキタ	4.4	4	20,720
三菱重工業	5.6	5.1	15,866
I H I	2.4	2.2	4,232
電気機器 (18.9%)			
コニカミノルタ	7.3	—	—
ブラザー工業	4.1	3.7	8,561
ミネベアミツミ	6.2	5.7	13,258
日立製作所	16	14.6	63,860
三菱電機	33.4	30.5	49,882
富士電機	2	1.8	7,326
安川電機	3.6	3.3	18,546
東芝テック	0.4	0.4	1,550
日本電産	4	7.3	105,120
日新電機	0.8	—	—
オムロン	3	2.7	25,326
MC J	—	0.9	908
日本電気	4	3.7	21,793

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士通	3.2	2.9	46,733
ルネサスエレクトロニクス	15.9	13.1	17,658
セイコーエプソン	4.1	3.8	6,574
アルパック	0.7	0.6	3,030
エレコム	0.4	0.3	1,506
パナソニック	38.1	34.8	49,642
シャープ	—	3.5	7,395
アンリツ	—	2	5,204
富士通ゼネラル	0.9	—	—
ソニー	14.3	10	102,850
TDK	1.6	1.5	26,475
アルプスアルパイン	3	2.7	4,252
ヒロセ電機	0.5	—	—
横河電機	3.1	2.8	6,392
アズビル	2.1	1.9	10,146
日本光電工業	1.4	1.3	4,108
堀場製作所	0.7	0.6	4,140
アドバンテスト	2.5	2.3	20,930
キーエンス	2.4	1.6	90,064
シスメックス	2.4	2.2	28,512
OBARA GROUP	0.2	0.2	831
レーザーテック	1.4	1.3	19,565
スタンレー電気	2.3	2.1	6,720
カシオ計算機	3	2.7	4,841
ファナック	3.2	2.9	78,735
浜松ホトニクス	2.4	2.2	14,058
京セラ	4.7	4.3	29,854
太陽誘電	1.5	1.4	8,582
村田製作所	9.8	8.9	94,785
小糸製作所	2	1.8	12,366
S C R E E Nホールディングス	0.6	0.5	4,210
キャノン	18	15.1	35,062
東京エレクトロン	2.2	1.9	84,379
輸送用機器 (5.5%)			
トヨタ紡織	1	0.9	1,493
豊田自動織機	2.7	2.5	21,425
デンソー	7.3	6.7	40,025
川崎重工業	2.6	—	—
いすゞ自動車	9.7	8.8	8,659

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	12.8	11.6	87,000
日野自動車	4.2	3.8	3,408
アイシン精機	2.7	2.5	7,975
マツダ	9.8	9	6,786
本田技研工業	26.3	24	67,356
スズキ	6.6	6	29,994
SUBARU	10.4	9.5	19,280
ヤマハ発動機	4.4	4.3	9,460
豊田合成	1.1	1	2,835
シマノ	1.2	1.1	28,325
ティ・エス テック	0.8	0.7	2,124
精密機器 (3.1%)			
テルモ	9.4	8.6	35,466
島津製作所	4	3.6	14,850
ブイ・テクノロジー	0.2	0.1	657
東京精密	0.6	0.6	3,054
ニコン	5.4	4.7	4,023
オリンパス	18.5	16.9	33,791
HOYA	6.7	6	81,900
朝日インテック	3.8	3.5	11,882
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	3.4	3.1	28,213
パイロットコーポレーション	0.5	0.5	1,502
タカラトミー	1.5	—	—
ヤマハ	2	1.8	10,728
ビジョン	2	2	9,240
任天堂	2	1.3	80,860
電気・ガス業 (1.3%)			
中部電力	10.2	9.3	12,596
関西電力	12.6	11.5	12,753
中国電力	—	4.4	5,790
東北電力	8.3	7.6	7,083
九州電力	6.9	6.3	6,640
北海道電力	—	2.9	1,273
電源開発	2.7	2.4	4,236
東京瓦斯	6.4	5.9	13,968
大阪瓦斯	6.5	5.9	11,788
陸運業 (3.7%)			
東武鉄道	3.5	3.2	9,369

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
相鉄ホールディングス	1.4	1.3	3,212
東急	8.4	7.7	9,524
小田急電鉄	5	4.5	14,130
京王電鉄	1.7	1.6	12,704
京成電鉄	2.3	2.1	7,255
東日本旅客鉄道	5.9	5.4	36,358
西日本旅客鉄道	3	2.7	14,393
東海旅客鉄道	2.8	2.5	36,275
西武ホールディングス	4.5	4	3,920
近鉄グループホールディングス	3.2	2.9	12,760
阪急阪神ホールディングス	4.2	3.8	12,730
南海電気鉄道	—	1.8	4,573
京阪ホールディングス	1.9	1.7	8,236
名古屋鉄道	3.5	3.2	8,489
日本通運	1.1	1	7,230
ヤマトホールディングス	5.5	4.8	12,768
山九	0.9	0.8	3,152
日立物流	0.6	0.5	1,562
九州旅客鉄道	—	2.5	5,395
空運業 (0.5%)			
日本航空	5.7	6.5	12,096
ANAホールディングス	5.8	7.2	15,894
情報・通信業 (8.1%)			
システナ	—	1.1	2,206
日鉄ソリューションズ	0.5	0.4	1,298
T I S	1.1	3	6,543
コーエーテクモホールディングス	—	0.6	3,702
ネクソン	9.3	7.5	24,525
コプロ	1.1	—	—
ティーガイア	0.3	0.3	564
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.8	0.7	1,794
GMOペイメントゲートウェイ	0.5	0.6	9,558
アカツキ	0.1	0.1	475
野村総合研究所	5.5	4.2	15,708
インフォコム	—	0.3	1,021
オービック	1.1	1	20,980
ジャストシステム	—	0.5	3,875
Zホールディングス	45	41	28,093
トレンドマイクロ	1.5	1.6	8,992

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
日本オラクル	0.7	0.6	7,830	
伊藤忠テクノソリューションズ	1.5	1.4	5,152	
大塚商会	1.8	1.6	8,640	
東映アニメーション	—	0.1	1,018	
デジタルガレージ	0.6	0.5	1,830	
日本ユニシス	1	0.9	3,604	
日本テレビホールディングス	2.7	—	—	
日本電信電話	33.3	37.3	100,728	
KDD I	24.4	21.8	71,940	
光通信	0.3	0.3	6,465	
NTTドコモ	24.2	—	—	
東宝	2	1.8	7,218	
エヌ・ティ・ティ・データ	8.7	8	12,064	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.4	1.3	7,605	
カブコン	1.5	1.4	9,828	
S C S K	0.8	0.7	3,962	
コナミホールディングス	1.2	1.1	7,194	
ソフトバンクグループ	15.7	12.4	107,446	
卸売業 (4.8%)				
双日	18.1	16.6	4,133	
アルフレッサ ホールディングス	3.7	3.3	6,708	
神戸物産	1.1	2.1	6,310	
ダイワボウホールディングス	0.3	0.3	2,643	
TOKAIホールディングス	1.7	1.6	1,564	
シップヘルスケアホールディングス	0.5	0.5	3,035	
コマダホールディングス	0.7	0.7	1,340	
第一興商	0.7	0.6	2,106	
メディカルホールディングス	3.5	3.2	6,508	
日本ライフライン	1	0.9	1,373	
伊藤忠商事	23	21	64,722	
丸紅	34.2	31.2	22,011	
豊田通商	3.7	3.3	13,860	
兼松	1.2	1.1	1,458	
三井物産	28.9	26	52,052	
日立ハイテク	1.1	—	—	
住友商事	20.7	18.9	26,989	
三菱商事	23.1	19.7	53,682	
岩谷産業	0.7	0.8	5,568	
PAL T A C	0.5	0.5	2,670	

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
日鉄物産	0.2	0.2	734	
ミスミグループ本社	4.1	3.8	12,274	
小売業 (4.7%)				
ローソン	0.8	0.8	3,896	
エービーシー・マート	0.5	0.5	3,000	
日本マクドナルドホールディングス	1.4	1.3	6,643	
セリア	0.8	0.7	2,618	
ビックカメラ	1.9	1.8	2,043	
MonotaRO	2.3	2.1	10,857	
J. フロント リテイリング	3.9	3.6	3,132	
マツモトキヨシホールディングス	1.4	1.2	5,022	
ZOZO	2.3	2.1	6,180	
ウエルシアホールディングス	1	1.8	6,471	
クリエイトSDホールディングス	0.5	0.5	1,715	
すかいらーくホールディングス	3.7	3.4	5,718	
コスモス薬品	0.1	0.3	4,890	
セブン&アイ・ホールディングス	12.9	11.7	47,256	
ツルハホールディングス	0.7	0.7	9,765	
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.3	2,544	
スシローグローバルホールディングス	—	1.6	6,016	
ノジマ	0.6	0.5	1,410	
良品計画	4.4	4	9,436	
パン・パシフィック・インターナショナル	7.9	6.6	15,061	
ゼンショーホールディングス	1.6	1.4	4,102	
ワークマン	0.3	0.3	2,526	
ユナイテッドアローズ	0.3	—	—	
スギホールディングス	0.7	0.6	4,362	
ファミリーマート	2.6	—	—	
しまむら	0.4	—	—	
丸井グループ	3	2.7	4,814	
イオン	12.6	11.5	37,915	
イズミ	0.7	0.6	2,223	
ヤオコー	0.4	0.3	2,016	
ケーズホールディングス	3.2	2.9	4,135	
アインホールディングス	0.4	0.4	2,640	
ニトリホールディングス	1.4	1.3	28,093	
ファーストリテイリング	0.4	0.4	36,656	
サンドラッグ	1.2	1.1	4,504	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銀行業 (4.5%)			
めぶきフィナンシャルグループ	17.1	15.6	3,229
コンコルディア・フィナンシャルグループ	19.4	17.2	6,742
新生銀行	2.4	2.2	2,855
あおぞら銀行	2	1.8	3,497
三菱UFJフィナンシャル・グループ	167	192.5	91,861
りそなホールディングス	36.1	32.7	11,948
三井住友トラスト・ホールディングス	6.2	5.7	17,738
三井住友フィナンシャルグループ	22.1	20.8	68,432
千葉銀行	11.3	10	5,790
ふくおかフィナンシャルグループ	—	2.5	4,750
セブン銀行	11	10	2,310
みずほフィナンシャルグループ	447.2	40.8	56,548
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	1	0.9	446
S B Iホールディングス	3.7	3.5	9,359
大和証券グループ本社	26.4	24.1	11,924
野村ホールディングス	57.9	52.9	29,375
松井証券	1.9	—	—
保険業 (2.4%)			
S O M P Oホールディングス	6.2	5.6	23,732
MS&ADインシュアランスグループホール	8.6	7.9	24,545
ソニーフィナンシャルホールディングス	2.7	—	—
第一生命ホールディングス	18.6	17	27,727
東京海上ホールディングス	11.8	10.6	56,996
T & Dホールディングス	9.8	9	11,142
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	0.9	0.8	3,652
芙蓉総合リース	0.3	0.3	2,157
東京センチュリー	0.7	0.6	5,484
イオンフィナンシャルサービス	2	1.8	2,255
アコム	—	6.2	2,901
オリエントコーポレーション	8.9	8.1	988
オリックス	20.6	18.6	31,527
三菱UFJリース	8.4	7.6	4,012
日本取引所グループ	9.4	8.6	22,802
不動産業 (2.1%)			
いちご	4.2	3.8	1,090
ヒューリック	6.9	6.4	7,232

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村不動産ホールディングス	2	1.8	3,979
プレサンスコーポレーション	0.5	—	—
オープンハウス	1	0.9	3,694
東急不動産ホールディングス	8.9	8.2	4,649
飯田グループホールディングス	2.7	2.5	5,822
パーク24	1.8	1.6	3,142
三井不動産	16.2	14.6	30,046
三菱地所	23.1	21.1	34,793
東京建物	3.6	3	4,302
住友不動産	7.4	6.8	20,930
スターツコーポレーション	0.4	0.4	1,091
イオンモール	1.6	1.5	2,550
日本空港ビルデング	1.1	1	5,530
サービス業 (5.5%)			
ミクシィ	0.8	0.7	1,763
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	—	—
日本M&Aセンター	2.4	2.2	12,958
UTグループ	0.5	0.5	1,650
エス・エム・エス	1	0.9	3,676
パーソルホールディングス	3.2	2.9	5,666
総合警備保障	1.3	1.2	6,252
カカコム	2.4	2.2	6,622
ディップ	0.4	0.4	1,036
ベネフィット・ワン	1.2	1.1	3,459
エムスリー	7	6.4	64,608
アウトソーシング	1.8	1.7	2,211
ディー・エヌ・エー	1.6	—	—
博報堂DYホールディングス	4.4	4	5,788
電通グループ	3.3	3.3	10,329
オリエンタルランド	3.4	3.1	49,445
リゾートトラスト	1.5	—	—
ユー・エス・エス	3.6	3.3	6,840
サイバーエージェント	1.8	—	—
楽天	14.9	13.6	13,436
エン・ジャパン	0.6	0.5	1,530
テクノプロ・ホールディングス	0.6	0.6	4,896
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.1	1,859
リクルートホールディングス	22.8	19.3	89,030
ペイカレント・コンサルティング	—	0.2	3,484

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リログループ	1.7	1.6	4,038
エイチ・アイ・エス	—	0.4	691
カナモト	0.5	0.5	1,148
セコム	3.4	3.1	29,242

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
メイテック	0.4	0.4	2,096	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,783	2,208	6,060,421
	銘柄数<比率>	399	399	<97.6%>

(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 145	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 6,060,421	% 97.1
コール・ローン等、その他	180,965	2.9
投資信託財産総額	6,241,386	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,239,531,598
コール・ローン等	163,018,103
株式(評価額)	6,060,421,800
未収入金	802,420
未収配当金	8,440,775
差入委託証拠金	6,848,500
(B) 負債	32,928,767
未払金	201,070
未払解約金	32,727,662
未払利息	35
(C) 純資産総額(A-B)	6,206,602,831
元本	3,491,972,827
次期繰越損益金	2,714,630,004
(D) 受益権総口数	3,491,972,827口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,774円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,045,623,253円
 期中追加設定元本額 2,097,715,922円
 期中一部解約元本額 2,651,366,348円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7774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	2,905,723,390円
国内株式セレクション(ラップ向け)	525,543,278円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	44,671,695円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	8,720,772円
J P X 日 経 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド(ラップ向け)	6,484,842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)	828,850円
合計	3,491,972,827円

○損益の状況 (2020年1月28日~2021年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	151,110,020
受取配当金	151,118,146
受取利息	986
その他収益金	41,841
支払利息	△ 50,953
(B) 有価証券売買損益	701,139,091
売買益	1,193,177,459
売買損	△ 492,038,368
(C) 先物取引等取引損益	36,703,240
取引益	107,437,840
取引損	△ 70,734,600
(D) 当期損益金(A+B+C)	888,952,351
(E) 前期繰越損益金	2,325,131,364
(F) 追加信託差損益金	999,119,109
(G) 解約差損益金	△1,498,572,820
(H) 計(D+E+F+G)	2,714,630,004
次期繰越損益金(H)	2,714,630,004

(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。