

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7期（決算日：2022年2月7日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。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7日に第7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)			
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円
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
7期(2022年2月7日)	14,412		0	3.1	20,830	3.7	98.2	1.8	5

(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。

○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 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(配当込み)	騰 落 率		
(期 首) 2021年2月5日	13,972	% —	20,096	% —	% 97.7	% 2.3
2月末	13,804	△1.2	19,857	△1.2	98.8	1.2
3月末	14,528	4.0	20,913	4.1	96.6	3.8
4月末	14,099	0.9	20,298	1.0	98.1	1.9
5月末	14,336	2.6	20,649	2.8	97.8	2.2
6月末	14,443	3.4	20,822	3.6	96.7	3.3
7月末	14,065	0.7	20,288	1.0	97.1	2.9
8月末	14,558	4.2	21,006	4.5	96.7	3.3
9月末	15,200	8.8	21,943	9.2	92.2	7.8
10月末	14,977	7.2	21,629	7.6	96.9	3.1
11月末	14,455	3.5	20,881	3.9	97.9	2.1
12月末	14,966	7.1	21,618	7.6	98.8	1.2
2022年1月末	14,209	1.7	20,534	2.2	97.6	2.4
(期 末) 2022年2月7日	14,412	3.1	20,830	3.7	98.2	1.8

(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7期：2021年2月6日～2022年2月7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7期首	13,972円
第7期末	14,412円
既払分配金	0円
騰落率	3.1%

※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

基準価額は期首に比べ3.1%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（3.7%）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7期：2021年2月6日～2022年2月7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2021年9月中旬にかけては、衆議院早期解散報道で追加経済対策への期待が高まったことや新型コロナウイルスのワクチン接種普及による経済正常化への期待等により国内株式市況は上昇しました。

9月下旬から期末にかけては、中国恒大集団を巡る債務問題への懸念や米国長期金利上昇等を背景に国内株式市況は下落しました。

## 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400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△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△0.4%程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

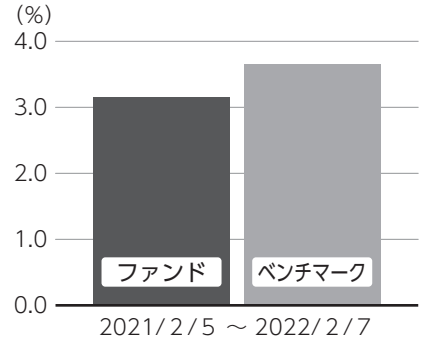
マザーファンド保有による影響は△0.2%程度でした。

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：**銘柄選択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7期
	2021年2月6日～2022年2月7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	4,412

（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。



2021年2月6日～2022年2月7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	45	0.308	(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 )	(30)	(0.208)	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 )	(8)	(0.056)	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 )	(7)	(0.044)	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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.013)	
(c) その他費用	0	0.001	(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)	(0.001)	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	47	0.322	

期中の平均基準価額は、14,624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。

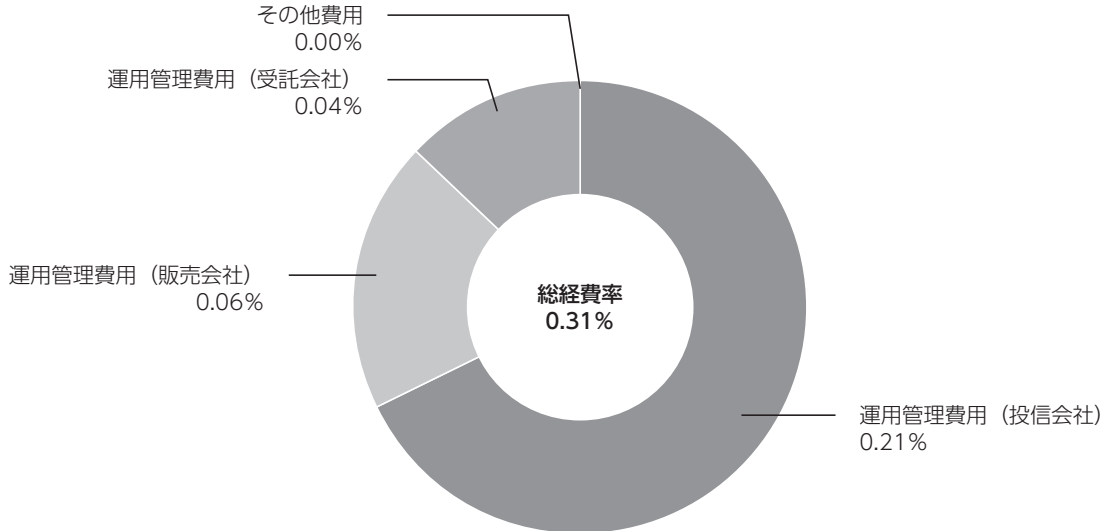
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.31%**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

(2021年2月6日～2022年2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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 528	千円 1,000	千口 4,086	千円 7,596

○株式売買比率

(2021年2月6日～2022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	
	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	6,444,890千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,435,785千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00	

(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

(2021年2月6日～2022年2月7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 3,551	百万円 721	% 20.3	百万円 2,893	百万円 289	% 10.0

平均保有割合 0.1%

※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 55	百万円 72	百万円 131

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 7

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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年2月6日～2022年2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 -	百万円 0.685026	百万円 -	百万円 0.685026	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

(2022年2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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 6,484	千口 2,926	千円 5,477

○投資信託財産の構成

(2022年2月7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 5,477	% 99.8
コール・ローン等、その他	9	0.2
投資信託財産総額	5,486	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年2月7日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,486,603
コール・ローン等	8,937
J P X日経400インデックスマザーファンド(評価額)	5,477,292
未収入金	374
(B) 負債	8,845
未払信託報酬	8,817
その他未払費用	28
(C) 純資産総額(A－B)	5,477,758
元本	3,800,789
次期繰越損益金	1,676,969
(D) 受益権総口数	3,800,789口
1万円当たり基準価額(C/D)	14,412円

<注記事項>

①期首元本額	8,395,338円
期中追加設定元本額	685,026円
期中一部解約元本額	5,279,575円
また、1口当たり純資産額は、期末14,412円です。	

②分配金の計算過程

項 目	2021年2月6日～ 2022年2月7日
費用控除後の配当等収益額	111,727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	26,522円
収益調整金額	690,401円
分配準備積立金額	848,319円
当ファンドの分配対象収益額	1,676,969円
1万円当たり収益分配対象額	4,412円
1万円当たり分配金額	－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（2021年2月6日～2022年2月7日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	160,213
売買益	311,883
売買損	△ 151,670
(B) 信託報酬等	△ 21,964
(C) 当期損益金(A+B)	138,249
(D) 前期繰越損益金	848,319
(E) 追加信託差損益金	690,401
(配当等相当額)	( 679,422)
(売買損益相当額)	( 10,979)
(F) 計(C+D+E)	1,676,969
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,676,969
追加信託差損益金	690,401
(配当等相当額)	( 680,619)
(売買損益相当額)	( 9,782)
分配準備積立金	986,568

(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8期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022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8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8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
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
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
8期(2022年1月26日)	18,427	3.7	20,502.60	3.8	93.9	6.1	6,968

(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	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年1月26日	円 17,774	% —	19,751.22	% —	% 97.6	% 2.4
1月末	17,378	△ 2.2	19,307.10	△ 2.2	98.1	1.9
2月末	17,874	0.6	19,856.75	0.5	98.8	1.2
3月末	18,817	5.9	20,913.30	5.9	96.6	3.8
4月末	18,266	2.8	20,297.99	2.8	98.1	1.9
5月末	18,579	4.5	20,648.99	4.5	97.8	2.2
6月末	18,721	5.3	20,821.61	5.4	96.7	3.3
7月末	18,236	2.6	20,287.57	2.7	97.1	2.9
8月末	18,881	6.2	21,005.77	6.4	96.7	3.3
9月末	19,718	10.9	21,942.86	11.1	92.2	7.8
10月末	19,434	9.3	21,629.06	9.5	96.9	3.1
11月末	18,761	5.6	20,881.36	5.7	97.9	2.1
12月末	19,430	9.3	21,618.03	9.5	98.8	1.2
(期 末) 2022年1月26日	18,427	3.7	20,502.60	3.8	93.9	6.1

(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

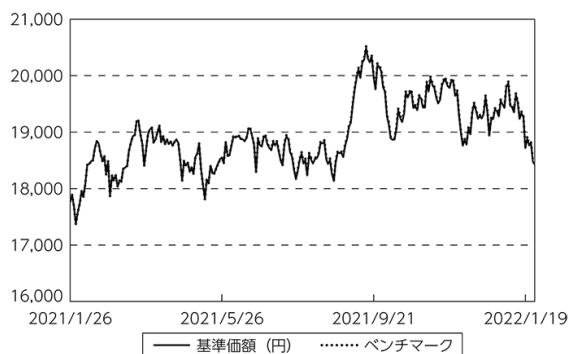
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.7%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(3.8%)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。

期首から2021年9月中旬にかけては、衆議院早期解散報道で追加経済対策への期待が高まったことや新型コロナウイルスのワクチン接種普及による経済正常化への期待等により国内株式市況は上昇しました。

9月下旬から期末にかけては、中国恒大集団を巡る債務問題への懸念や米国長期金利上昇等を背景に国内株式市況は下落しました。

● 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3.8%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)

- ・ 銘柄選択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

(2021年1月27日～2022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)	3	0.014	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(3)	(0.013)	
期中の平均基準価額は、18,939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

(2021年1月27日～2022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	千円	千株	千円
		1,188	3,384,446	1,110	3,004,947
		( 52)	( -)		

(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	百万円	百万円	百万円
		7,190	6,927	42	42

## ○株式売買比率

(2021年1月27日～2022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	6,389,393千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,359,795千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00

(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

(2021年1月27日～2022年1月26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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 3,384	百万円 722	% 21.3	百万円 3,004	百万円 289	% 9.6

## 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 51	百万円 72	百万円 114

## 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 7

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

(2022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>				
日本水産	4.1	4.7	2,547	
マルハニチロ	0.6	—	—	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
I N P E X	15.2	19	20,729	
<b>建設業 (2.5%)</b>				
ミライト・ホールディングス	—	1.5	2,794	
安藤・間	2.5	2.4	2,078	
東急建設	1.2	1.4	968	
コムシスホールディングス	1.5	1.5	4,068	
東建コーポレーション	0.1	0.1	905	
大成建設	3.2	3.2	11,984	
大林組	9.6	11	10,186	
清水建設	9.7	10.3	7,838	
長谷工コーポレーション	3.7	3.3	4,778	
鹿島建設	7.5	8	11,000	
西松建設	0.7	0.7	2,646	
三井住友建設	2.3	2.5	1,070	
前田建設工業	2.4	—	—	
戸田建設	4	4.5	3,280	
熊谷組	0.4	0.6	1,730	
大東建託	1	1.1	14,399	
N I P P O	0.8	0.9	3,591	
五洋建設	3.8	4.3	2,739	
住友林業	2.4	2.8	5,678	
大和ハウス工業	9.5	10.1	33,966	
積水ハウス	10.4	11.9	27,834	
関電工	—	1.8	1,539	
エクシオグループ	1.4	1.6	3,740	
九電工	0.7	0.8	2,640	
インフロニア・ホールディングス	—	4.6	4,922	
<b>食料品 (3.8%)</b>				
森永製菓	0.7	0.8	2,924	
寿スビリッツ	0.3	—	—	

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
カルビー	1.4	1.6	4,267	
森永乳業	0.6	0.6	3,396	
ヤクルト本社	2.1	2.6	15,288	
明治ホールディングス	2	2.3	16,399	
プリマハム	—	0.4	1,002	
日本ハム	1.2	1.3	5,759	
アサヒグループホールディングス	6.7	8.2	39,081	
キリンホールディングス	13	12.9	23,845	
サントリー食品インターナショナル	2	2.3	9,993	
伊藤園	0.9	1.1	6,930	
キッコーマン	2.2	2.5	21,225	
味の素	6.8	7.7	24,478	
キュービー	1.7	1.8	4,219	
カゴメ	1.2	1.3	3,932	
アリアケジャパン	0.3	0.3	1,860	
ニチレイ	1.5	1.6	4,214	
東洋水産	1.6	1.7	8,015	
日清食品ホールディングス	1.3	1.4	11,298	
日本たばこ産業	16.4	18.8	43,334	
<b>繊維製品 (0.4%)</b>				
帝人	2.4	3.2	4,550	
東レ	21.6	24.8	17,893	
ゴールドウイン	0.5	0.6	3,588	
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				
王子ホールディングス	12.5	14.3	8,408	
大王製紙	—	1.6	2,899	
レンゴー	—	3.2	2,697	
<b>化学 (7.6%)</b>				
クラレ	4.7	5	5,165	
旭化成	19.8	22.7	25,299	
昭和電工	2.3	3	7,002	
住友化学	21.9	25.1	14,206	
日産化学	1.6	1.9	11,628	
東ソー	4.6	4.9	8,653	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
トクヤマ	0.9	1.1	1,995	
デンカ	1.1	1.2	4,788	
信越化学工業	5.1	5.1	92,208	
エア・ウォーター	2.8	3.2	5,625	
日本酸素ホールディングス	2.9	3.3	7,695	
三菱瓦斯化学	2.8	3.2	6,848	
三井化学	2.8	3.1	9,548	
J S R	2.8	—	—	
三菱ケミカルホールディングス	19.9	22.9	20,037	
KHネオケム	0.5	—	—	
ダイセル	3.7	4.9	4,008	
積水化学工業	6.3	7.2	13,845	
日本ゼオン	—	3.1	4,095	
アイカ工業	0.9	1	3,240	
宇部興産	1.5	1.6	3,270	
日油	1.1	1.2	6,180	
花王	7.3	7.7	44,960	
日本ペイントホールディングス	2.5	12.9	11,674	
関西ペイント	3.4	3.5	8,477	
D I C	1.3	1.4	4,074	
富士フィルムホールディングス	—	6.1	46,768	
資生堂	6.1	6.5	37,810	
ライオン	4	4.2	6,396	
ファンケル	1.2	1.4	4,062	
コーセー	0.6	0.7	7,455	
ポーラ・オルビスホールディングス	1.3	1.5	2,697	
小林製薬	0.9	1	8,750	
日東電工	2.1	2.1	18,501	
エフピコ	—	0.6	2,190	
ニフコ	1.1	1.2	4,182	
ユニ・チャーム	6.5	6.7	31,201	
<b>医薬品 (6.2%)</b>				
協和キリン	3.1	4.1	11,926	
武田薬品工業	21.4	25.7	85,015	
アステラス製薬	26.4	30.3	57,085	
大日本住友製薬	2.3	2.2	2,890	
塩野義製薬	3.8	4.4	28,146	
日本新薬	0.8	0.9	6,903	
中外製薬	9.5	10.9	40,297	

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
科研製薬	0.5	0.5	2,085	
エーザイ	3.6	4.2	24,788	
ロート製薬	1.6	1.8	5,778	
小野薬品工業	7	8	21,824	
久光製薬	0.8	—	—	
参天製薬	5.7	6.5	8,606	
J C Rファーマ	—	1	2,062	
東和薬品	—	0.5	1,366	
沢井製薬	0.6	—	—	
第一三共	24.8	27.5	71,500	
大塚ホールディングス	6.3	7.3	30,178	
ペプチドリーム	—	1.8	3,733	
サワイグループホールディングス	—	0.8	3,492	
<b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>				
出光興産	3.4	3.9	11,489	
E N E O Sホールディングス	45.8	52.6	23,527	
コスモエネルギーホールディングス	0.9	1	2,266	
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>				
横浜ゴム	1.8	2	3,376	
TOYO TIRE	1.6	1.8	2,905	
ブリヂストン	8.1	10.1	50,580	
住友ゴム工業	2.7	3.1	3,654	
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				
A G C	2.8	3.2	16,416	
太平洋セメント	1.9	2	4,564	
東海カーボン	3	2.9	3,491	
T O T O	2.2	2.5	12,287	
日本碍子	3.7	3.8	7,102	
日本特殊陶業	2.3	2.7	5,175	
ニチアス	0.8	0.8	2,040	
<b>鉄鋼 (—%)</b>				
日本製鉄	13.5	—	—	
ジェイ エフ イー ホールディングス	8.1	—	—	
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>				
三井金属鉱業	—	0.9	2,898	
住友金属鉱山	3.9	4.4	22,664	
古河電気工業	0.9	—	—	
住友電気工業	11.3	12.9	19,608	
アサヒホールディングス	0.5	1.4	2,885	

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>金属製品 (0.4%)</b>				
SUMCO	3.9	5.3	11,495	
三和ホールディングス	2.8	3.3	4,019	
リンナイ	0.6	0.7	7,175	
<b>機械 (6.1%)</b>				
日本製鋼所	0.9	1	3,595	
三浦工業	1.3	1.5	5,085	
アマダ	3.7	5.5	6,182	
F U J I	1.3	1.6	4,070	
オーエスジー	1.5	1.6	3,196	
DMG森精機	1.9	2	3,574	
ディスコ	0.4	0.5	16,150	
オプトラン	—	0.4	926	
ナブテスコ	1.8	2	6,890	
SMC	1	1	63,370	
小松製作所	13.8	15.8	44,390	
住友重機械工業	1.7	2	5,886	
日立建機	1.2	1.4	4,125	
クボタ	16	17	41,454	
荏原製作所	—	1.5	8,445	
ダイキン工業	3.9	4.5	108,450	
ダイフク	1.6	1.9	15,105	
竹内製作所	0.5	0.5	1,410	
ホシザキ	1	1	8,340	
日本精工	5.7	6.6	5,108	
THK	1.9	—	—	
マキタ	4	4.3	19,169	
三菱重工業	5.1	5.5	16,571	
I H I	2.2	2.2	4,928	
<b>電気機器 (18.4%)</b>				
ブラザー工業	3.7	4.3	9,288	
ミネベアミツミ	5.7	6	16,404	
日立製作所	14.6	15.9	97,228	
三菱電機	30.5	34.9	50,552	
富士電機	1.8	2.1	11,676	
安川電機	3.3	3.8	17,936	
東芝テック	0.4	—	—	
日本電産	7.3	8.5	86,785	
オムロン	2.7	2.9	26,372	

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
MC J	0.9	1.2	1,186	
日本電気	3.7	4.4	21,648	
富士通	2.9	3.1	55,335	
ルネサスエレクトロニクス	13.1	18.9	24,116	
セイコーエプソン	3.8	4.3	8,243	
ワコム	—	2.7	2,203	
アルバック	0.6	0.6	3,510	
エレコム	0.3	0.8	1,103	
パナソニック	34.8	37.3	47,203	
シャープ	3.5	—	—	
アンリツ	2	2.2	3,460	
ソニーグループ	10	9.4	118,628	
TDK	1.5	5.1	20,017	
アルプスアルパイン	2.7	—	—	
横河電機	2.8	3.5	6,636	
アズビル	1.9	2	8,970	
日本光電工業	1.3	1.4	4,263	
堀場製作所	0.6	0.6	3,666	
アドバンテスト	2.3	2.6	24,622	
キーエンス	1.6	1.7	98,124	
シスメックス	2.2	3	32,355	
OBARA GROUP	0.2	—	—	
レーザーテック	1.3	1.5	39,750	
スタンレー電気	2.1	2.4	6,364	
カシオ計算機	2.7	2.5	3,567	
ファナック	2.9	3.1	68,711	
浜松トニクス	2.2	2.5	14,550	
京セラ	4.3	4.9	33,261	
太陽誘電	1.4	1.7	9,282	
村田製作所	8.9	10.3	86,303	
小糸製作所	1.8	1.9	11,115	
SCREENホールディングス	0.5	0.6	6,828	
キヤノン	15.1	—	—	
東京エレクトロン	1.9	2.2	124,102	
<b>輸送用機器 (6.8%)</b>				
トヨタ紡織	0.9	1.4	2,878	
豊田自動織機	2.5	2.8	24,472	
デンソー	6.7	7.7	65,503	
いすゞ自動車	8.8	11	15,279	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
トヨタ自動車	11.6	52.1	115,740	
日野自動車	3.8	4.4	4,272	
アイシン	2.5	2.6	10,829	
マツダ	9	—	—	
本田技研工業	24	27.5	91,850	
スズキ	6	8	39,000	
SUBARU	9.5	10	20,650	
ヤマハ発動機	4.3	4.6	12,443	
豊田合成	1	1.1	2,591	
シマノ	1.1	1.4	36,743	
テイ・エス テック	0.7	1.5	2,121	
<b>精密機器 (3.3%)</b>				
テルモ	8.6	9.9	41,253	
島津製作所	3.6	4.5	18,382	
ブイ・テクノロジー	0.1	0.2	678	
東京精密	0.6	0.6	2,880	
ニコン	4.7	—	—	
オリンパス	16.9	18.3	44,807	
HOYA	6	6.8	100,198	
朝日インテック	3.5	3.8	7,626	
<b>その他製品 (1.9%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	3.1	3.1	24,530	
パイロットコーポレーション	0.5	0.6	2,403	
ヤマハ	1.8	2.1	10,731	
ビジョン	2	2.1	4,901	
任天堂	1.3	1.5	84,450	
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>				
中部電力	9.3	10.7	13,364	
関西電力	11.5	13.2	14,401	
中国電力	4.4	5.5	5,131	
東北電力	7.6	8.2	6,756	
九州電力	6.3	7.2	6,192	
北海道電力	2.9	3	1,497	
電源開発	2.4	3	4,485	
イーレックス	—	0.5	765	
レノバ	—	0.7	1,145	
東京瓦斯	5.9	6.7	14,840	
大阪瓦斯	5.9	6.3	12,209	

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>陸運業 (1.6%)</b>				
東武鉄道	3.2	—	—	
相鉄ホールディングス	1.3	—	—	
東急	7.7	—	—	
小田急電鉄	4.5	—	—	
京王電鉄	1.6	—	—	
京成電鉄	2.1	—	—	
東日本旅客鉄道	5.4	—	—	
西日本旅客鉄道	2.7	—	—	
東海旅客鉄道	2.5	2.9	43,311	
西武ホールディングス	4	—	—	
近鉄グループホールディングス	2.9	—	—	
阪急阪神ホールディングス	3.8	4.1	13,468	
南海電気鉄道	1.8	—	—	
京阪ホールディングス	1.7	—	—	
名古屋鉄道	3.2	—	—	
日本通運	1	—	—	
ヤマトホールディングス	4.8	4.6	11,228	
山九	0.8	0.9	4,140	
センコーグループホールディングス	—	1.7	1,553	
日立物流	0.5	0.6	3,126	
丸和運輸機関	—	0.7	923	
九州旅客鉄道	2.5	2.6	6,159	
SGホールディングス	—	6.3	15,075	
NIPPON EXPRESSホールディン	—	1.1	7,425	
<b>海運業 (0.6%)</b>				
日本郵船	—	2.8	23,100	
商船三井	—	1.8	14,526	
<b>空運業 (—%)</b>				
日本航空	6.5	—	—	
ANAホールディングス	7.2	—	—	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b>				
近鉄エクスプレス	—	0.6	1,655	
<b>情報・通信業 (7.3%)</b>				
NECネットエスアイ	—	1.1	1,938	
システナ	1.1	4.9	1,734	
日鉄ソリューションズ	0.4	0.5	1,647	
T I S	3	3.3	10,081	
コーエーテクモホールディングス	0.6	1.1	4,543	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ネクソン	7.5	7.7	16,193
ティーガイア	0.3	0.3	492
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.7	0.9	2,178
GMOペイメントゲートウェイ	0.6	0.7	7,259
ラクス	—	1.6	4,009
アカツキ	0.1	0.2	543
野村総合研究所	4.2	6.6	27,852
インフォコム	0.3	0.4	731
オービック	1	1.1	20,504
ジャストシステム	0.5	0.5	2,505
Zホールディングス	41	49.8	27,937
トレンドマイクロ	1.6	1.8	10,854
日本オラクル	0.6	0.7	6,160
伊藤忠テクノソリューションズ	1.4	1.6	5,224
大塚商会	1.6	1.9	9,044
電通国際情報サービス	—	0.5	1,737
東映アニメーション	0.1	0.1	847
デジタルガレージ	0.5	0.6	2,535
日本ユニシス	0.9	1.1	3,344
USEN-NEXT HOLDINGS	—	0.3	716
日本電信電話	37.3	31.3	100,786
KDDI	21.8	25	88,975
光通信	0.3	0.4	5,568
東宝	1.8	2	8,930
エヌ・ティ・ティ・データ	8	9.1	20,083
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.3	1.6	9,072
カブコン	1.4	3.2	8,560
SCSK	0.7	2.4	4,718
コナミホールディングス	1.1	1.2	7,308
ソフトバンクグループ	12.4	9.8	50,528
<b>卸売業 (6.4%)</b>			
双日	16.6	3.8	6,691
アルフレッサ ホールディングス	3.3	3.8	6,068
神戸物産	2.1	2.7	9,963
ダイワボウホールディングス	0.3	1.7	2,769
TOKAIホールディングス	1.6	1.7	1,463
シッパヘルスケアホールディングス	0.5	1.1	2,825
コマダホールディングス	0.7	0.8	1,653
第一興商	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
メディカルホールディングス	3.2	3.7	7,566
日本ライフライン	0.9	1	1,050
伊藤忠商事	21	24.1	87,507
丸紅	31.2	33.9	38,069
豊田通商	3.3	3.5	16,170
兼松	1.1	1.3	1,609
三井物産	26	26.7	75,093
住友商事	18.9	21.7	37,519
三菱商事	19.7	25.8	97,988
岩谷産業	0.8	0.8	4,504
PALTAC	0.5	0.5	2,115
日鉄物産	0.2	0.2	1,010
ミスミグループ本社	3.8	4.3	15,845
<b>小売業 (3.8%)</b>			
ローソン	0.8	0.8	3,928
エービーシー・マート	0.5	0.5	2,640
日本マクドナルドホールディングス	1.3	1.6	8,016
セリア	0.7	0.8	2,293
ビックカメラ	1.8	2	1,982
MonotaRO	2.1	4.3	8,019
J. フロント リテイリング	3.6	—	—
マツキヨココカラ&カンパニー	1.2	1.5	5,820
ZOZO	2.1	2.4	6,686
ウエルシアホールディングス	1.8	1.8	5,661
クリエイトSDホールディングス	0.5	0.5	1,530
すかいらくホールディングス	3.4	—	—
コスモス薬品	0.3	0.3	4,284
セブン&アイ・ホールディングス	11.7	13.5	71,995
ツルハホールディングス	0.7	0.8	7,528
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.3	2,043
FOOD & LIFE COMPANIE	1.6	2	7,100
ノジマ	0.5	0.6	1,386
良品計画	4	4	6,464
コーナン商事	—	0.5	1,690
パン・バシフィック・インターナショナルホ	6.6	6.9	10,605
ゼンショーホールディングス	1.4	1.7	4,675
ワークマン	0.3	0.4	2,048
スギホールディングス	0.6	0.7	4,795
ライフコーポレーション	—	0.3	918

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
丸井グループ	2.7	2.7		5,807
イオン	11.5	—		—
イズミ	0.6	0.6		1,878
ヤオコー	0.3	0.4		2,648
ケーズホールディングス	2.9	3.2		3,564
アインホールディングス	0.4	0.5		2,935
ニトリホールディングス	1.3	1.4		23,296
ファーストリテイリング	0.4	0.5		33,810
サンドラッグ	1.1	1.3		3,745
<b>銀行業 (5.5%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	15.6	17.9		4,564
コンコルディア・フィナンシャルグループ	17.2	19.7		9,199
新生銀行	2.2	2.2		4,571
あおぞら銀行	1.8	1.9		4,845
三菱UFJフィナンシャル・グループ	192.5	154.6	105,452	
りそなホールディングス	32.7	39.4	18,841	
三井住友トラスト・ホールディングス	5.7	6.5	25,928	
三井住友フィナンシャルグループ	20.8	23.8	98,579	
千葉銀行	10	11.5	8,429	
ふくおかフィナンシャルグループ	2.5	2.9	6,368	
セブン銀行	10	10.2	2,478	
みずほフィナンシャルグループ	40.8	44.1	68,663	
<b>証券、商品先物取引業 (0.9%)</b>				
F P G	0.9	1.2	778	
GMOフィナンシャルホールディングス	—	0.6	502	
S B Iホールディングス	3.5	4.3	12,616	
ジャフコ グループ	—	0.4	2,200	
大和証券グループ本社	24.1	25.8	17,827	
野村ホールディングス	52.9	52.6	26,531	
<b>保険業 (3.0%)</b>				
S O M P Oホールディングス	5.6	5.7	30,164	
MS&ADインシュアランスグループホール	7.9	7.7	30,353	
第一生命ホールディングス	17	17	42,950	
東京海上ホールディングス	10.6	11.3	76,625	
T & Dホールディングス	9	8.9	14,818	
<b>その他金融業 (1.5%)</b>				
全国保証	0.8	0.8	4,168	
芙蓉総合リース	0.3	0.4	3,052	
みずほリース	—	0.5	1,575	

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
東京センチュリー	0.6	0.7		3,864
イオンフィナンシャルサービス	1.8	1.9		2,278
アコム	6.2	6.1		1,958
オリエントコーポレーション	8.1	9.3		1,162
オリックス	18.6	20.9		49,062
三菱HCキャピタル	7.6	12.7		7,505
日本取引所グループ	8.6	8.7		19,822
<b>不動産業 (2.3%)</b>				
いちご	3.8	3.8		1,086
ヒューリック	6.4	8.2		8,618
野村不動産ホールディングス	1.8	1.8		4,669
サムティ	—	0.6		1,249
プレサンスコーポレーション	—	0.4		830
オープンハウスグループ	0.9	1.1		6,479
東急不動産ホールディングス	8.2	10.1		6,494
飯田グループホールディングス	2.5	2.9		6,957
パーク24	1.6	—		—
三井不動産	14.6	15.7		37,256
三菱地所	21.1	22.6		37,030
東京建物	3	3.4		5,718
住友不動産	6.8	7.2		25,394
スターツコーポレーション	0.4	0.5		1,221
日本エスコン	—	0.6		457
イオンモール	1.5	1.7		2,764
カチタス	—	0.9		3,195
日本空港ビルデング	1	—		—
<b>サービス業 (5.0%)</b>				
ミクシィ	0.7	0.8		1,674
日本M&Aセンターホールディングス	2.2	5.5		10,180
U Tグループ	0.5	0.5		1,612
エス・エム・エス	0.9	1.1		3,553
パーソルホールディングス	2.9	3.3		9,632
総合警備保障	1.2	1.3		5,544
カカコム	2.2	2.4		5,810
ディップ	0.4	0.6		2,103
ベネフィット・ワン	1.1	1.2		4,362
エムスリー	6.4	5.9		26,473
アウトソーシング	1.7	1.9		2,553
博報堂DYホールディングス	4	4.6		8,165



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電通グループ	3.3	—	—
オリエンタルランド	3.1	3.9	72,150
ユー・エス・エス	3.3	3.7	6,837
楽天グループ	13.6	—	—
フルキャストホールディングス	—	0.3	638
エン・ジャパン	0.5	0.5	1,400
テクノプロ・ホールディングス	0.6	2	5,982
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	0.2	1,054
ジャパンマテリアル	—	1	1,626
リクルートホールディングス	19.3	19.9	109,211
ベルシステム24ホールディングス	—	0.5	708

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ベイカレント・コンサルティング	0.2	0.2	8,270	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	—	1.1	1,842	
リログループ	1.6	1.8	3,661	
エイチ・アイ・エス	0.4	—	—	
カナモト	0.5	0.6	1,348	
セコム	3.1	3.3	26,499	
メイテック	0.4	0.4	2,548	
イオンディライト	—	0.4	1,242	
合 計	株 数・金 額	2,208	2,338	6,544,754
	銘柄数<比率>	399	400	<93.9%>

(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 423	百万円 —

### ○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	6,544,754	92.8
コール・ローン等、その他	510,783	7.2
投資信託財産総額	7,055,537	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,055,536,499
コール・ローン等	465,778,989
株式(評価額)	6,544,754,010
未収配当金	9,698,500
差入委託証拠金	35,305,000
(B) 負債	87,458,797
未払金	87,458,488
未払解約金	103
未払利息	206
(C) 純資産総額(A-B)	6,968,077,702
元本	3,781,507,945
次期繰越損益金	3,186,569,757
(D) 受益権総口数	3,781,507,945口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,427円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 3,491,972,827円  
 期中追加設定元本額 3,048,489,407円  
 期中一部解約元本額 2,758,954,289円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.8427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	3,259,821,151円
国内株式セレクション(ラップ向け)	489,542,764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)	4,995,584円
J P X 日 経 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド (ラップ向け)	2,926,777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)	826,570円
合計	3,781,507,945円

## ○損益の状況 (2021年1月27日～2022年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	137,054,815
受取配当金	137,087,961
受取利息	569
その他収益金	19,337
支払利息	△ 53,052
(B) 有価証券売買損益	104,833,929
売買益	699,958,260
売買損	△ 595,124,331
(C) 先物取引等取引損益	14,287,510
取引益	84,906,550
取引損	△ 70,619,040
(D) 当期損益金(A+B+C)	256,176,254
(E) 前期繰越損益金	2,714,630,004
(F) 追加信託差損益金	2,659,517,036
(G) 解約差損益金	△2,443,753,537
(H) 計(D+E+F+G)	3,186,569,757
次期繰越損益金(H)	3,186,569,757

(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。