

## 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	2022年12月28日 [当初、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 4 0 0 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	ベビード ファンド	J P X 日経 4 0 0 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	<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。

## 償還報告書（全体版）

[繰上償還]

J P X 日経 4 0 0 インデックス  
ファンド（ラップ向け）

信託終了日：2022年12月28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、「J P X 日経 4 0 0 インデックスファンド（ラップ向け）」は、約款の規定に基づき、先般ご案内申し上げました予定通り、12月28日に繰り上げて償還させていただきました。ここに謹んで運用経過と償還内容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)

お客様のお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 (分配額)	標準価額			J P X日経インデックス400		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税込み 分配	み 金	期 騰 落	中 率	(配当込み)			
	円 銭	円	%	%	%	%	%	百万円	
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	
(償還時)	(償還価額)								
8期(2022年12月28日)	14,963.53	—	3.8	21,236	1.9	—	—	1	

(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」を示す商標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) 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 式 先 物 比 率
	円 銭	騰 落 率 %	騰 落 率 %	騰 落 率 %		
(期 首) 2022年2月7日	14,412	—	20,830	—	98.2	1.8
2月末	14,116	△2.1	20,404	△2.0	97.2	2.8
3月末	14,759	2.4	21,340	2.4	96.2	3.8
4月末	14,390	△0.2	20,812	△0.1	97.1	2.9
5月末	14,502	0.6	20,981	0.7	97.6	2.4
6月末	14,152	△1.8	20,481	△1.7	96.7	3.5
7月末	14,697	2.0	21,276	2.1	97.6	2.3
8月末	14,877	3.2	21,545	3.4	98.6	1.4
9月末	14,013	△2.8	20,301	△2.5	94.6	5.4
10月末	14,733	2.2	21,356	2.5	98.0	2.0
11月末	15,224	5.6	22,076	6.0	97.8	2.2
(償還時) 2022年12月28日	(償還価額) 14,963.53	3.8	21,236	1.9	—	—

(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。

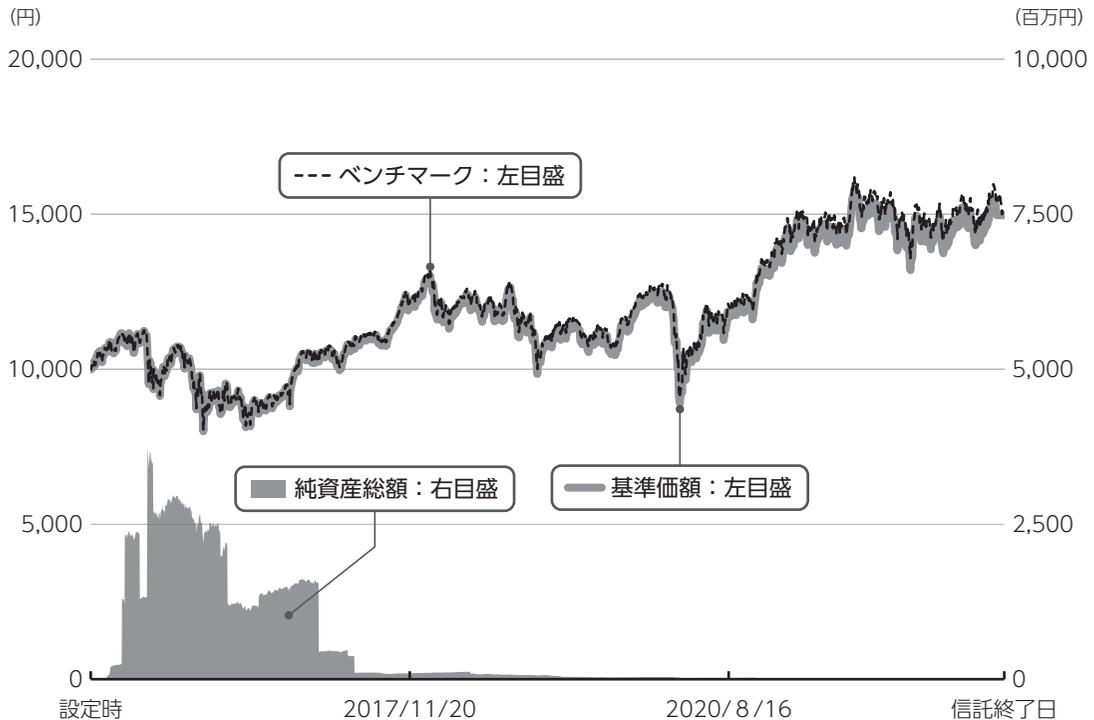
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第1期～第8期：2015年2月25日～2022年12月28日

## 設定来の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第8期末	14,963.53円
既払分配金	0円
騰落率	49.6%

※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

償還価額は設定時に比べ49.6%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（50.9%）を1.3%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、基準価額は信託報酬等の管理コストを除き、ベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第1期～第8期：2015年2月25日～2022年12月28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。

設定から2019年12月にかけては、米中貿易摩擦問題や英国の欧州連合（EU）離脱問題の進退等を受け、国内市況は上下する展開になりました。

2020年1月以降、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、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から、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）

信託期間を通じて、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。

第8期（2022年2月8日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、信託終了日にかけて、マザーファンドの売却を行いました。

### ▶ 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。

第8期：2022/2/8～2022/12/28

## 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）

設定来のベンチマークとの乖離は $\Delta 1.3\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

信託報酬等の管理コストおよび信託終了日にかけてマザーファンドを売却したことによるものです。

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.7\%$ 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。

第8期（2022年2月8日～信託終了日）

ベンチマークとの乖離は $1.9\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

信託報酬等の管理コストおよび信託終了日にかけてマザーファンドを売却したことによるものです。

ファンドの管理コスト等による影響は $2.0\%$ 程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

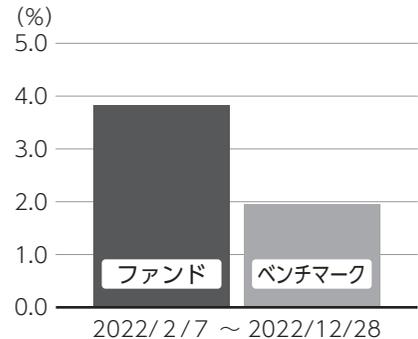
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

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：**ございません。

**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

信託期間中の収益の分配はありません。

## ▶ 償還価額

### ▶ J P X日経400インデックスファンド（ラップ向け）

償還価額は、14,963円53銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2022年2月8日～2022年12月28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	40	0.273	(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）	(27)	(0.186)	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）	(7)	(0.049)	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）	(6)	(0.039)	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	1	0.008	(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）	(1)	(0.008)	
(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	41	0.282	

期中の平均基準価額は、14,547円です。

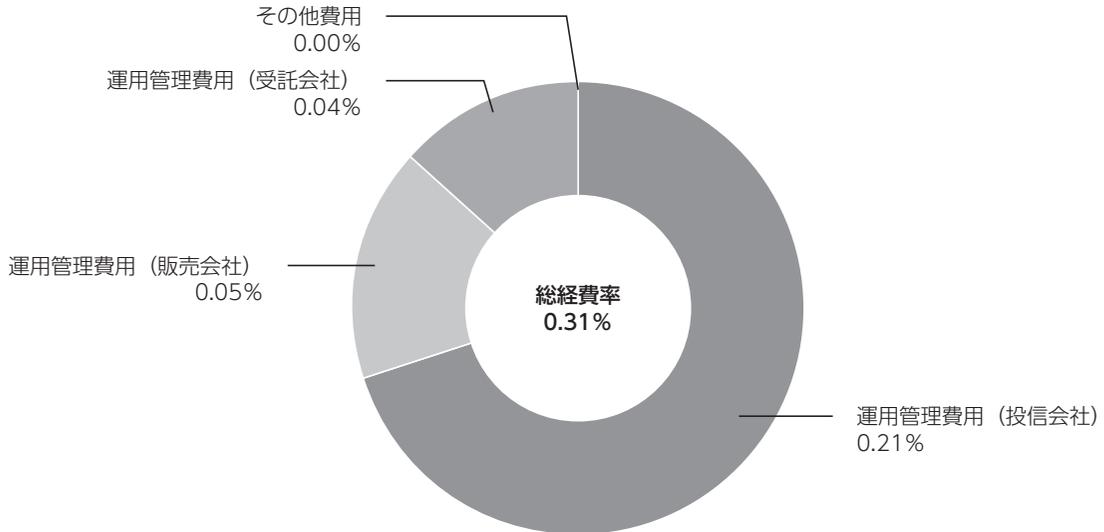
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

（2022年2月8日～2022年12月28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 0.154	千円 0.288	千口 2,926	千円 5,692

○株式売買比率

（2022年2月8日～2022年12月28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	6,256,577千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,343,171千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.85	

(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2月8日～2022年12月28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 3,482	百万円 919	% 26.4	百万円 2,774	百万円 844	% 30.4

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 47	百万円 52	百万円 151

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)	0.345千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.1%

(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。

### ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年2月8日～2022年12月28日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	償還時残高(元本)	取引の理由
百万円 0.685026	百万円 -	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12月28日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
J P X日経400インデックスマザーファンド			千口 2,926

○投資信託財産の構成

(2022年12月28日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,028	% 100.0
投資信託財産総額	1,028	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年12月28日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,028,453
コール・ローン等	1,028,453
(B) 負債	3,412
未払信託報酬	3,406
未払利息	1
その他未払費用	5
(C) 純資産総額(A-B)	1,025,041
元本	685,026
償還差益金	340,015
(D) 受益権総口数	685,026口
1万口当たり償還価額(C/D)	14,963円53銭

○損益の状況 (2022年2月8日～2022年12月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 32
支払利息	△ 32
(B) 有価証券売買損益	49,484
売買益	154,625
売買損	△105,141
(C) 信託報酬等	△ 11,697
(D) 当期損益金(A+B+C)	37,755
(E) 前期繰越損益金	177,821
(F) 追加信託差損益金	124,439
(配当等相当額)	( 122,676)
(売買損益相当額)	( 1,763)
償還差益金(D+E+F)	340,015

<注記事項>

期首元本額 3,800,789円  
 期中追加設定元本額 0円  
 期中一部解約元本額 3,115,763円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.496353円です。

(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。

## ○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年2月25日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年12月28日		資産総額	1,028,453円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	3,412円
				純資産総額	1,025,041円
受益権口数	1,000,000口	685,026口	△314,974口	受益権口数	685,026口
元本額	1,000,000円	685,026円	△314,974円	1万口当たり償還金	14,963円53銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	2,740,007,199円	2,512,016,974円	9,168円	0円	0%
第2期	1,515,126,794	1,558,007,735	10,283	0	0
第3期	87,934,489	108,953,296	12,390	0	0
第4期	54,207,822	59,643,262	11,003	0	0
第5期	28,627,244	34,928,235	12,201	0	0
第6期	8,395,338	11,730,023	13,972	0	0
第7期	3,800,789	5,477,758	14,412	0	0

## ○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	14,963円53銭
----------------	------------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 【お知らせ】

全残存口数に対して受益者からの解約請求があり、約款第46条第1項に規定する「やむを得ない事情が発生」した場合に該当するため、また、約款第46条第5項に規定する「真にやむを得ない事情が生じている場合」に該当するため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

(2022年12月28日)

# 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
	円	騰 落 率 %	(配当込み)	騰 落 率 %	%	%
(期 首) 2021年1月26日	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	評 価 額
	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	評 価 額
	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
スタートコーポレーション	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	
ベイクレント・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400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400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400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。