

運用報告書 (全体版)

第7期<決算日2021年1月15日>

J P X日経400ノーロードオープン

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	2014年1月6日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	J P X日経400ノーロードオープン	J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド受益証券、わが国の金融商品取引所上場株式および株価指数先物取引を主要投資対象とします。
	J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式および株価指数先物取引を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンドへの投資を通じて、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ます。ただし、わが国の株式に直接投資を行う場合があります。 マザーファンドにおける組入銘柄の投資比率の決定にあたっては、原則として組入銘柄の時価総額に応じて投資比率を決定します。 運用の効率性をはかるため、およびJ P X日経インデックス400 (配当込み) への連動をめざすため、株価指数先物取引を活用する場合があります。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日 (原則として1月15日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費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、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「J P X日経400ノーロードオープン」は、2021年1月15日に第7期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

J P X日経400ノーロードオープン

■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		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(配当込み) (ベンチマーク)	期中 騰落率			
3期 (2017年1月16日)	円 12,125	円 0	% 10.0	ポイント 14,704.28	% 11.1	% 97.7	% 2.3	百万円 2,567
4期 (2018年1月15日)	14,925	0	23.1	18,265.50	24.2	96.7	3.3	2,284
5期 (2019年1月15日)	12,423	0	△16.8	15,326.05	△16.1	94.2	5.7	2,021
6期 (2020年1月15日)	14,304	0	15.1	17,795.23	16.1	98.2	1.8	1,713
7期 (2021年1月15日)	15,822	0	10.6	19,831.76	11.4	97.8	2.2	1,549

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 「J P X日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及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」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）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」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ます。本商品は、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、「J P Xグループ」及び「日経」は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。「J P Xグループ」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（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400 (配当込み) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020年 1 月15日	円 14,304	% -	ポイント 17,795.23	% -	% 98.2	% 1.8
1 月末	13,928	△2.6	17,334.61	△2.6	97.7	2.2
2 月末	12,532	△12.4	15,608.03	△12.3	96.9	3.1
3 月末	11,741	△17.9	14,619.02	△17.8	95.7	4.3
4 月末	12,246	△14.4	15,263.44	△14.2	97.7	2.3
5 月末	13,125	△8.2	16,371.21	△8.0	98.2	1.8
6 月末	13,107	△8.4	16,361.03	△8.1	97.7	2.2
7 月末	12,585	△12.0	15,717.99	△11.7	97.5	2.5
8 月末	13,612	△4.8	17,015.46	△4.4	97.6	2.4
9 月末	13,718	△4.1	17,167.47	△3.5	96.7	3.3
10月末	13,327	△6.8	16,690.07	△6.2	97.4	2.5
11月末	14,966	4.6	18,743.72	5.3	97.6	2.4
12月末	15,345	7.3	19,225.39	8.0	97.6	2.3
(期 末) 2021年 1 月15日	15,822	10.6	19,831.76	11.4	97.8	2.2

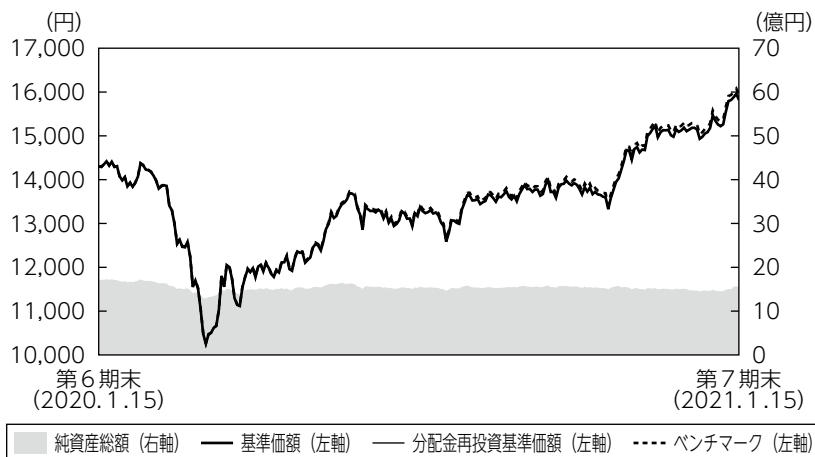
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過 (2020年1月16日から2021年1月15日まで)

基準価額等の推移



第7期首：14,304円
第7期末：15,822円
(既払分配金0円)
騰落率：10.6%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン開発などによって過度な悲観論が後退したことから国内株式市場が上昇し、当ファンドの基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は上昇しました。新型コロナウイルスの感染拡大が世界的な規模となり、経済の長期的な停滞懸念によって2020年2月下旬から3月中旬にかけて大幅な下落となりました。その後は新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を背景に緩やかに値を戻す展開となり、期末にかけては国内感染者数が再拡大したものの、欧米でのワクチン接種開始や米国の追加経済対策決定などが相場を支えました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

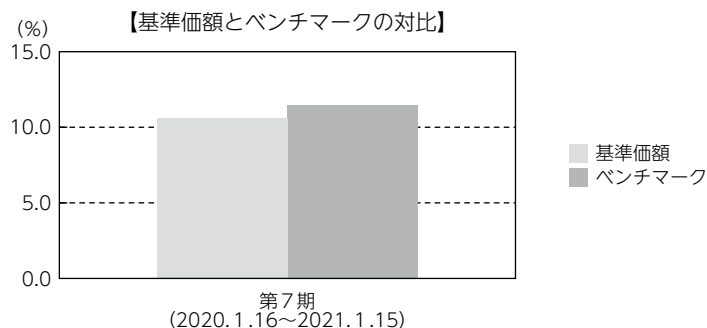
ベンチマークであるJ P X日経インデックス400（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※運用状況については15ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で11.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.8%下回りました。信託報酬の影響を除くと、ベンチマークにほぼ連動する投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年1月16日 ～2021年1月15日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	6,077円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、J P X日経400インデックスファンド・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2020年1月16日 ～2021年1月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	114円	0.847%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,456円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(55)	(0.407)	
(販売会社)	(52)	(0.385)	
(受託会社)	(7)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	1	0.009	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(1)	(0.004)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.001 (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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	115	0.857	

(注1) 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・解約によって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。なお、売買委託手数料は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みません。

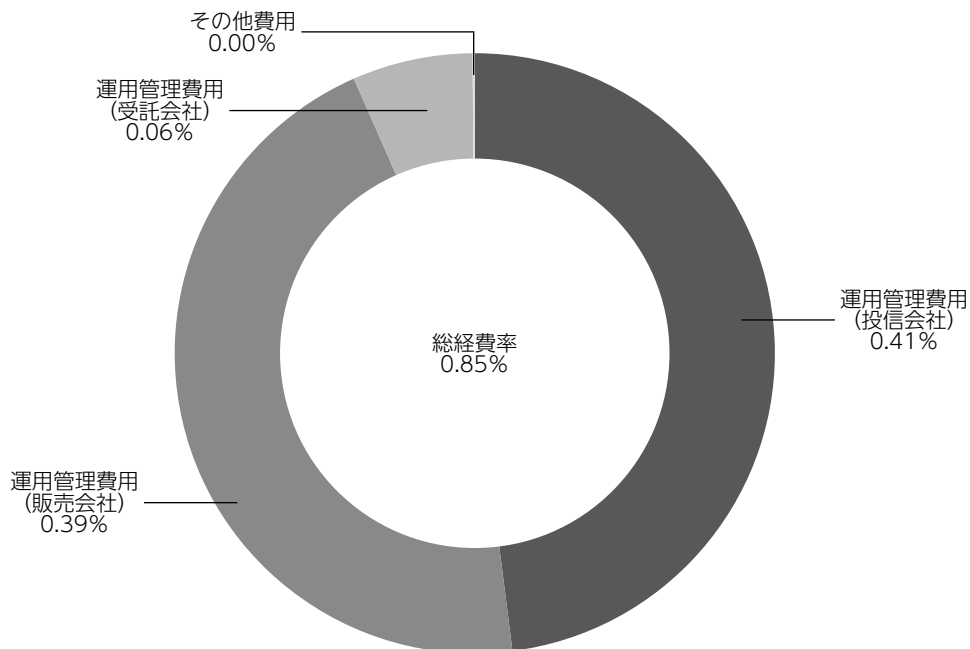
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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0.85%です。



(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
J P X日経400インデックス ファンド・マザーファンド	千□ 295,617	千円 405,897	千□ 511,167	千円 742,163

■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	J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,333,007千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,831,577千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.47

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

【J P X日経400ノーロードオープンにおける利害関係人との取引状況等】

- (1) 期中の利害関係人との取引状況
期中の利害関係人との取引はありません。

- (2) 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)	139千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	114千円
(B)／(A)	81.8%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

【J P X日経400インデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	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 245	百万円 150	% 61.5	百万円 1,087	百万円 537	% 49.4
株 式 先 物 取 引	906	906	100.0	919	919	100.0

平均保有割合 52.4%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1	百万円 9	百万円 27

(3) 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	当 期	
	買 付 額	期 末 保 有 額
株 式		百万円 1

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループ、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド	千□ 1,138,597	千□ 923,047	千円 1,549,242

■投資信託財産の構成

2021年1月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ＪＰＸ日経400インデックスファンド・マザーファンド	1,549,242	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,309	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,571,551	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,571,551,680円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	15,917,542
ＪＰＸ日経400インデックスファンド・マザーファンド(評価額)	1,549,242,138
未 収 入 金	6,392,000
(B) 負 債	22,127,630
未 払 解 約 金	15,621,803
未 払 信 託 報 酬	6,493,865
そ の 他 未 払 費 用	11,962
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,549,424,050
元 本	979,287,873
次 期 繰 越 損 益 金	570,136,177
(D) 受 益 権 総 口 数	979,287,873口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	15,822円

(注) 期首における元本額は1,197,697,647円、当期中における追加設定元本額は525,527,923円、同解約元本額は743,937,697円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月16日 至2021年1月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,772円
受 取 利 息	1,160
支 払 利 息	△3,932
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	195,307,188
売 買 益	242,341,765
売 買 損	△47,034,577
(C) 信 託 報 酬 等	△13,031,049
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	182,273,367
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	95,006,270
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	292,856,540
(配 当 等 相 当 額)	(315,480,147)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△22,623,607)
(G) 合 計(D+E+F)	570,136,177
次 期 繰 越 損 益 金(G)	570,136,177
追 加 信 託 差 損 益 金	292,856,540
(配 当 等 相 当 額)	(317,871,490)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△25,014,950)
分 配 準 備 積 立 金	277,279,637

(注1) (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2) (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3) (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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	28,374,180円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	153,836,900
(c) 収 益 調 整 金	317,871,490
(d) 分 配 準 備 積 立 金	95,068,557
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	595,151,127
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	6,077.39
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

J P X日経400インデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第7期 (決算日 2021年1月15日)

(計算期間 2020年1月16日～2021年1月15日)

J P X日経400インデックスファンド・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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2014年1月6日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および株価指数先物取引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は制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

■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		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
3期(2017年1月16日)	12,438	11.0	14,704.28	11.1	97.7	2.3	7,830
4期(2018年1月15日)	15,439	24.1	18,265.50	24.2	96.7	3.3	5,947
5期(2019年1月15日)	12,958	△16.1	15,326.05	△16.1	94.2	5.7	3,910
6期(2020年1月15日)	15,045	16.1	17,795.23	16.1	98.2	1.8	3,498
7期(2021年1月15日)	16,784	11.6	19,831.76	11.4	97.8	2.2	2,863

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「J P X日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及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」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）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」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ます。本商品は、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、「J P Xグループ」及び「日経」は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。「J P Xグループ」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（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

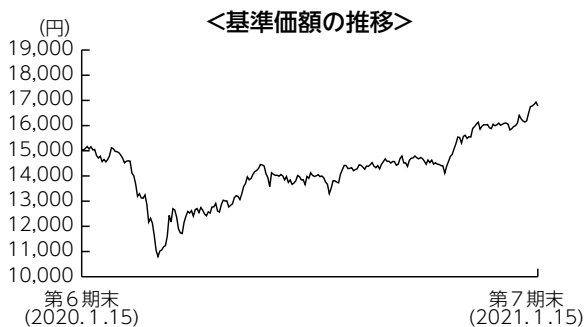
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400 (配当込み (ベンチマーク))		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020年 1 月 15 日	円 15,045	% -	ポイント 17,795.23	% -	% 98.2	% 1.8
1 月 末	14,655	△2.6	17,334.61	△2.6	97.7	2.2
2 月 末	13,195	△12.3	15,608.03	△12.3	96.9	3.1
3 月 末	12,371	△17.8	14,619.02	△17.8	95.7	4.3
4 月 末	12,912	△14.2	15,263.44	△14.2	97.7	2.3
5 月 末	13,848	△8.0	16,371.21	△8.0	98.2	1.8
6 月 末	13,840	△8.0	16,361.03	△8.1	97.7	2.2
7 月 末	13,298	△11.6	15,717.99	△11.7	97.5	2.5
8 月 末	14,394	△4.3	17,015.46	△4.4	97.6	2.4
9 月 末	14,516	△3.5	17,167.47	△3.5	96.7	3.3
10 月 末	14,112	△6.2	16,690.07	△6.2	97.4	2.5
11 月 末	15,859	5.4	18,743.72	5.3	97.6	2.4
12 月 末	16,272	8.2	19,225.39	8.0	97.7	2.3
(期 末) 2021年 1 月 15 日	16,784	11.6	19,831.76	11.4	97.8	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年1月16日から2021年1月15日まで）



基準価額の推移

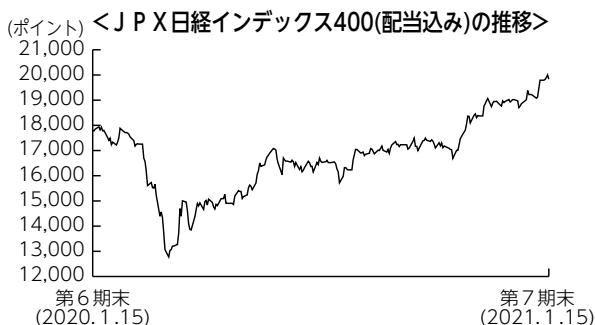
当期末の基準価額は16,784円となり、前期末比で11.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン開発などによって過度な悲観論が後退したことから国内株式市場が上昇し、当ファンドの基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は上昇しました。新型コロナウイルスの感染拡大が世界的な規模となり、経済の長期的な停滞懸念によって2020年2月下旬から3月中旬にかけて大幅な下落となりました。その後は新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を背景に緩やかに値を戻す展開となり、期末にかけては国内感染者数が再拡大したものの、欧米でのワクチン接種開始や米国の追加経済対策決定などが相場を支えました。



ポートフォリオについて

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）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】 ※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○組入上位10銘柄（現物）

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ソニー	日本・円	1.8%
2	トヨタ自動車	日本・円	1.5
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.5
4	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
5	キーエンス	日本・円	1.5
6	武田薬品工業	日本・円	1.5
7	日本電信電話	日本・円	1.5
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
9	任天堂	日本・円	1.4
10	本田技研工業	日本・円	1.2
組入銘柄数		400銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ソニー	日本・円	1.7%
2	ソフトバンクグループ	日本・円	1.7
3	日本電信電話	日本・円	1.6
4	日本電産	日本・円	1.6
5	キーエンス	日本・円	1.6
6	信越化学工業	日本・円	1.6
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.5
8	第一三共	日本・円	1.5
9	ダイキン工業	日本・円	1.5
10	村田製作所	日本・円	1.4
組入銘柄数		398銘柄	

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で11.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.1%上回りました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (1) (1)	0.009% (0.004) (0.005)
合 計	1	0.009

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(14,216円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については6ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年1月16日から2021年1月15日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株 128.9 (△173.11)	千円 245,411 (-)	千株 459.19	千円 1,087,595

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 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。

■ 派生商品取引状況等

先物取引の銘柄別取引・残高状況

銘 柄 別			買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
			新 買 付 規 額	決 済 額	新 売 付 規 額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内 株 式	J P X 日 経 4 0 0	百万円 906	百万円 919	百万円 -	百万円 -	百万円 62	百万円 -	百万円 2	

(注) 金額は受渡代金です。

■ 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	1,333,007千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,831,577千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.47

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年1月16日から2021年1月15日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	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 245	百万円 150	% 61.5	百万円 1,087	百万円 537	% 49.4
株 式 先 物 取 引	906	906	100.0	919	919	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 1	百万円 9	百万円 27

(3) 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	当 期	
	買 付 額	期
株 式		百万円 1

(4) 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)	265千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	217千円
(B) / (A)	81.8%

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループ、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	2.5	1.9	837	
マルハニチロ	0.4	0.3	687	
鉱業 (0.2%)				
国際石油開発帝石	9.9	7	4,606	
建設業 (2.3%)				
安藤・間	1.5	1.1	829	
東急建設	0.7	0.6	319	
コムシスホールディングス	0.9	0.7	2,303	
東建コーポレーション	—	0.1	802	
大成建設	1.9	1.5	5,347	
大林組	5.7	4.4	4,109	
清水建設	5.8	4.5	3,487	
長谷工コーポレーション	2.2	1.7	2,074	
鹿島建設	4.5	3.4	4,851	
西松建設	0.4	0.3	697	
三井住友建設	1.4	1.1	498	
前田建設工業	1.4	1.1	1,014	
戸田建設	2.4	1.8	1,328	
熊谷組	0.3	0.2	532	
大東建託	0.7	0.5	4,650	
N I P P O	0.5	0.4	1,087	
五洋建設	2.3	1.7	1,536	
住友林業	1.4	1.1	2,293	
大和ハウス工業	5.6	4.3	13,459	
積水ハウス	6.2	4.8	10,063	
協和エクシオ	0.9	0.7	2,020	
九電工	0.4	0.3	966	
食料品 (3.5%)				
森永製菓	0.4	0.3	1,155	
江崎グリコ	0.5	—	—	
寿スピリッツ	—	0.1	534	
カルビー	0.8	0.6	1,869	
森永乳業	—	0.3	1,461	
ヤクルト本社	1.3	1	5,400	
明治ホールディングス	1.2	0.9	6,579	
日本ハム	0.7	0.5	2,272	
アサヒグループホールディングス	3.8	3.1	13,122	
キリンホールディングス	7.7	6	14,034	
サントリー食品インターナショナル	1.2	0.9	3,267	
伊藤園	—	0.4	2,728	
キッコーマン	1.3	1	7,430	
味の素	4	3.1	7,621	
キューピー	1	0.8	1,912	
カゴメ	—	0.6	2,103	
アリアケジャパン	0.2	0.1	697	
ニチレイ	0.9	0.7	2,079	
東洋水産	0.9	0.7	3,738	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
日清食品ホールディングス	0.8	0.6	5,550	
日本たばこ産業	10.5	7.5	15,442	
繊維製品 (0.4%)				
帝人	1.5	1.1	2,163	
東レ	12.9	9.9	6,382	
ゴールドウイン	0.3	0.2	1,272	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	7.4	5.7	3,665	
化学 (7.7%)				
クラレ	2.8	2.2	2,431	
旭化成	11.8	9.1	10,264	
昭和電工	1.3	1	2,432	
住友化学	13.1	10.1	4,322	
日産化学	1	0.8	4,664	
東ソー	2.8	2.1	3,721	
トクヤマ	0.5	0.4	1,013	
デンカ	0.6	0.5	2,125	
信越化学工業	3.1	2.4	45,480	
エア・ウォーター	1.5	1.3	2,316	
日本酸素ホールディングス	1.7	1.3	2,568	
三菱瓦斯化学	1.7	1.3	3,166	
三井化学	1.6	1.3	3,803	
J S R	1.7	1.3	3,971	
三菱ケミカルホールディングス	11.9	9.2	6,113	
K H ネオケム	—	0.2	506	
ダイセル	2.4	1.7	1,319	
積水化学工業	3.8	2.9	5,881	
アイカ工業	0.5	0.4	1,424	
宇部興産	0.9	0.7	1,350	
日立化成	0.8	—	—	
ダイキョーニシカワ	0.4	—	—	
日油	0.7	0.5	2,485	
花王	4.4	3.4	26,594	
日本ペイントホールディングス	1.5	1.1	10,560	
関西ペイント	2	1.5	4,417	
D I C	0.8	0.6	1,556	
資生堂	3.6	2.8	18,611	
ライオン	2.4	1.8	4,359	
ファンケル	—	0.6	2,289	
コーセー	0.3	0.3	4,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	0.8	0.6	1,281	
小林製薬	0.5	0.4	4,812	
日東電工	1.3	1	9,290	
ニフコ	0.7	0.5	1,865	
ユニ・チャーム	3.5	3	14,997	
医薬品 (6.8%)				
協和キリン	1.8	1.4	3,945	
武田薬品工業	11.6	9.8	35,289	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アステラス製薬	16	12.1	20,110
大日本住友製薬	1.3	1	1,479
塩野義製薬	2.3	1.8	10,422
田辺三菱製薬	2.2	—	—
日本新薬	0.5	0.4	2,888
中外製薬	1.9	4.4	25,933
科研製薬	0.3	0.2	824
エーザイ	2.2	1.7	13,241
ロート製薬	—	0.7	2,205
小野薬品工業	4.2	3.2	9,840
久光製薬	0.5	0.4	2,428
参天製薬	3.4	2.6	4,438
沢井製薬	0.4	0.3	1,435
第一三共	5.2	11.4	41,883
大塚ホールディングス	3.5	2.9	12,800
ペプチドリーム	0.9	—	—
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	2	1.6	3,921
ENEOSホールディングス	27.3	21.1	9,009
コスモエネルギーホールディングス	0.5	0.4	882
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	1.1	0.8	1,289
TOYO TIRE	—	0.7	1,151
ブリヂストン	5.6	3.7	14,670
住友ゴム工業	1.6	1.3	1,242
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	1.8	1.3	4,992
太平洋セメント	1.1	0.9	2,423
東海カーボン	1.9	1.4	2,013
TOTO	1.3	1	6,000
日本碍子	2.2	1.7	2,997
日本特殊陶業	1.4	1.1	2,002
ニチアス	0.5	0.4	990
鉄鋼 (0.4%)			
日本製鉄	8	6.2	8,611
ジェイエフイーホールディングス	4.9	3.7	3,777
日立金属	1.9	—	—
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	4.5	—	—
住友金属鉱山	2.3	1.8	8,933
DOWAホールディングス	0.5	—	—
古河電気工業	0.6	0.4	1,170
住友電気工業	6.7	5.2	7,524
アサヒホールディングス	—	0.2	761
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	2.2	1.8	4,347
三和ホールディングス	1.7	1.3	1,645
リンナイ	0.3	0.3	3,480
東プレ	0.3	—	—
機械 (6.1%)			
日本製鋼所	—	0.4	1,228

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	—	0.6	3,744
アマダ	2.3	1.7	2,033
F U J I	—	0.6	1,653
オーエスジー	0.8	0.7	1,403
DMG森精機	1.1	0.9	1,505
ディスコ	0.2	0.2	7,590
ナブテスコ	1.1	0.8	3,884
三井海洋開発	0.2	—	—
S M C	0.6	0.4	27,184
小松製作所	8.2	6.3	18,994
住友重機械工業	1	0.8	2,345
日立建機	0.7	0.6	1,941
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.4	—	—
クボタ	9.6	7.4	17,375
ダイキン工業	2.3	1.8	41,805
ダイフク	0.9	0.7	9,002
竹内製作所	0.3	0.2	504
T P R	0.2	—	—
ホシザキ	—	0.4	3,772
日本精工	3.4	2.6	2,480
ジェイテクト	1.7	—	—
T H K	1.1	0.9	3,271
マキタ	2.4	1.8	9,108
三菱重工業	3	2.3	7,401
I H I	1.3	1	1,972
電気機器 (18.6%)			
コニカミノルタ	4	—	—
ブラザー工業	2.2	1.7	4,074
ミネベアミツミ	3.4	2.6	5,642
日立製作所	8.7	6.7	29,104
三菱電機	18.2	14	22,960
富士電機	1.1	0.8	3,260
安川電機	2	1.5	8,835
東芝テック	0.2	0.2	769
日本電産	2.2	3.4	46,070
日新電機	0.4	—	—
オムロン	1.6	1.3	12,610
MC J	—	0.4	426
日本電気	2.2	1.7	9,792
富士通	1.8	1.3	20,728
ルネサスエレクトロニクス	8.7	6	7,398
セイコーエプソン	2.3	1.7	2,939
アルパック	0.4	0.3	1,411
エレコム	0.2	0.2	1,008
パナソニック	20.8	16	20,568
シャープ	—	1.6	3,075
アンリツ	—	0.9	2,302
富士通ゼネラル	0.5	—	—
ソニー	7.8	4.6	48,576
T D K	0.9	0.7	11,865
アルプスアルパイン	1.6	1.2	1,743

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヒロセ電機	0.3	—	—
横河電機	1.7	1.3	2,987
アズビル	1.1	0.9	5,238
日本光電工業	0.8	0.6	1,875
堀場製作所	0.4	0.3	1,995
アドバンテスト	1.4	1	8,940
キーエンス	1.3	0.8	45,632
シスメックス	1.3	1	12,850
OBARA GROUP	0.1	0.1	407
レーザーテック	0.8	0.6	8,856
スタンレー電気	1.3	1	3,230
カシオ計算機	1.6	1.2	2,208
ファナック	1.7	1.3	35,782
浜松ホトニクス	1.3	1	6,320
京セラ	2.6	2	13,526
太陽誘電	0.8	0.6	3,276
村田製作所	5.3	4.1	41,164
小糸製作所	1.1	0.8	5,400
SCREENホールディングス	0.3	0.2	1,730
キャノン	9.8	7	15,739
東京エレクトロン	1.2	0.9	39,510
輸送用機器 (5.5%)			
トヨタ紡織	0.5	0.4	660
豊田自動織機	1.5	1.1	9,262
デンソー	4	3.1	17,790
川崎重工業	1.4	—	—
いすゞ自動車	5.3	4.1	4,022
トヨタ自動車	7	5.3	40,984
日野自動車	2.3	1.7	1,504
アイシン精機	1.5	1.2	3,678
マツダ	5.3	4.1	3,120
本田技研工業	14.3	11	31,185
スズキ	3.6	2.8	14,369
SUBARU	5.6	4.3	8,890
ヤマハ発動機	2.4	2	4,186
豊田合成	0.6	0.5	1,411
シマノ	0.7	0.5	12,525
ティ・エス テック	0.4	0.3	954
精密機器 (3.1%)			
テルモ	5.1	4	16,548
島津製作所	2.2	1.7	6,902
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	630
東京精密	0.3	0.3	1,554
ニコン	2.9	2.1	1,726
オリンパス	10.1	7.7	15,338
HOYA	3.6	2.8	39,060
朝日インテック	2.1	1.6	5,568
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	1.9	1.4	12,902
パイロットコーポレーション	0.3	0.2	592
タカラトミー	0.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマハ	1.1	0.8	4,952
ピジョン	1.1	0.9	3,924
任天堂	1.1	0.6	39,414
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	5.6	4.3	5,583
関西電力	6.9	5.3	5,429
中国電力	—	2	2,496
東北電力	4.5	3.5	3,108
九州電力	3.7	2.9	2,763
北海道電力	—	1.3	525
電源開発	1.4	1.1	1,793
東京瓦斯	3.5	2.7	6,288
大阪瓦斯	3.5	2.7	5,445
陸運業 (3.8%)			
東武鉄道	1.9	1.5	4,605
相鉄ホールディングス	0.8	0.6	1,493
東急	4.6	3.5	4,490
小田急電鉄	2.7	2.1	6,888
京王電鉄	0.9	0.7	5,817
京成電鉄	1.3	1	3,400
東日本旅客鉄道	3.2	2.5	16,840
西日本旅客鉄道	1.6	1.2	6,482
東海旅客鉄道	1.5	1.2	17,466
西武ホールディングス	2.4	1.8	1,809
近鉄グループホールディングス	1.7	1.3	5,798
阪急阪神ホールディングス	2.3	1.8	6,210
南海電気鉄道	—	0.8	2,082
京阪ホールディングス	1	0.8	4,024
名古屋鉄道	1.9	1.5	4,126
日本通運	0.6	0.5	3,645
ヤマトホールディングス	3	2.2	5,946
山九	0.5	0.4	1,626
日立物流	0.3	0.2	625
九州旅客鉄道	—	1.2	2,698
空運業 (0.5%)			
日本航空	3.1	3	5,676
ANAホールディングス	3.1	3.3	7,530
情報・通信業 (8.1%)			
システナ	—	0.5	1,058
日鉄ソリューションズ	0.3	0.2	660
TIS	0.6	1.4	3,003
コーエーテックモホールディングス	—	0.3	1,812
ネクソン	5.1	3.5	11,427
コロプラ	0.6	—	—
ティーガイア	0.2	0.1	191
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.4	0.3	750
GMOペイメントゲートウェイ	0.3	0.3	4,389
アカツキ	0.1	—	—
野村総合研究所	3	1.9	7,381
インフォコム	—	0.2	650
オービック	0.6	0.5	10,710

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
ジャストシステム	—	0.2	1,494	
Zホールディングス	24.5	18.9	13,558	
トレンドマイクロ	0.8	0.7	4,116	
日本オラクル	0.4	0.3	4,011	
伊藤忠テクノソリューションズ	0.8	0.6	2,274	
大塚商会	1	0.7	3,507	
東映アニメーション	—	0.1	913	
デジタルガレージ	0.3	0.2	834	
日本ユニシス	0.6	0.4	1,622	
日本テレビホールディングス	1.5	—	—	
日本電信電話	18.2	17.1	47,025	
KDDI	13.3	10	32,780	
光通信	0.2	0.1	2,120	
NTTドコモ	13.2	—	—	
東宝	1.1	0.8	3,264	
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	3.7	5,468	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.8	0.6	3,792	
カプコン	0.8	0.6	4,182	
S C S K	0.4	0.3	1,701	
コナミホールディングス	0.6	0.5	3,250	
ソフトバンクグループ	8.6	5.7	48,552	
卸売業 (4.8%)				
双日	9.9	7.6	1,877	
アルフレッサ ホールディングス	2	1.5	3,183	
神戸物産	0.6	1	2,969	
ダイワハウホールディングス	0.2	0.1	934	
TOKAIホールディングス	0.9	0.7	700	
シップヘルスケアホールディングス	0.3	0.2	1,158	
コメダホールディングス	0.4	0.3	576	
第一興商	0.4	0.3	1,072	
メディカルホールディングス	1.9	1.5	3,204	
日本ライフライン	0.5	0.4	616	
伊藤忠商事	12.5	9.6	30,124	
丸紅	18.6	14.4	10,684	
豊田通商	2	1.5	6,525	
兼松	0.7	0.5	658	
三井物産	15.7	11.9	23,603	
日立ハイテク	0.6	—	—	
住友商事	11.3	8.7	12,475	
三菱商事	12.6	9	24,210	
岩谷産業	0.4	0.4	2,764	
PALTAC	0.3	0.2	1,136	
日鉄物産	0.1	0.1	384	
ミスミグループ本社	2.2	1.7	5,372	
小売業 (4.7%)				
ローソン	0.5	0.3	1,500	
エービーシー・マート	0.3	0.2	1,164	
日本マクドナルドホールディングス	0.8	0.6	3,042	
セリア	0.4	0.3	1,104	
ビックカメラ	1.1	0.8	912	
MonotaRO	1.3	1	5,290	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
J. フロント リテイリング	2.1	1.6	1,424	
マツモトキヨシホールディングス	0.7	0.6	2,613	
ZOZO	1.2	0.9	2,520	
ウエルシアホールディングス	0.5	0.8	2,808	
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.2	714	
すかいらーくホールディングス	2	1.5	2,383	
コスモス薬品	0.1	0.1	1,588	
セブン&アイ・ホールディングス	7	5.4	21,524	
ツルハホールディングス	0.4	0.3	4,347	
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.1	887	
スシローグローバルホールディングス	—	0.8	2,928	
ノジマ	0.3	0.2	568	
良品計画	2.4	1.8	4,165	
パナソニック・インターナショナルホールディングス	4.3	3	6,885	
ゼンショーホールディングス	0.9	0.7	1,945	
ワークマン	0.2	0.1	828	
ユナイテッドアローズ	0.2	—	—	
スギホールディングス	0.4	0.3	2,100	
ファミリーマート	1.4	—	—	
しまむら	0.2	—	—	
丸井グループ	1.6	1.3	2,410	
イオン	6.9	5.3	17,707	
イズミ	0.4	0.3	1,143	
ヤオコー	0.2	0.2	1,372	
ケーズホールディングス	1.7	1.3	1,831	
アインホールディングス	0.2	0.2	1,284	
ニトリホールディングス	0.8	0.6	13,458	
ファーストリテイリング	0.2	0.2	18,198	
サンドラッグ	0.7	0.5	2,045	
銀行業 (4.7%)				
めびきフィナンシャルグループ	9.3	7.2	1,548	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	10.5	7.9	3,088	
新生銀行	1.3	1	1,375	
あおぞら銀行	1.1	0.8	1,576	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	91	88.5	44,064	
りそなホールディングス	19.7	15	5,845	
三井住友トラスト・ホールディングス	3.4	2.6	8,652	
三井住友フィナンシャルグループ	12	9.6	33,830	
千葉銀行	6.2	4.6	2,773	
ふくおかフィナンシャルグループ	—	1.2	2,380	
セブン銀行	6	4.6	1,030	
みずほフィナンシャルグループ	243.6	18.8	26,846	
証券・商品先物取引業 (0.9%)				
FPG	0.6	0.4	197	
SBIホールディングス	2	1.6	4,353	
大和証券グループ本社	14.4	11.1	5,699	
野村ホールディングス	31.5	24.3	14,346	
松井証券	1	—	—	
保険業 (2.5%)				
SOMPOホールディングス	3.4	2.6	11,042	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4.7	3.6	11,815	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.5	—	—	—
第一生命ホールディングス	10.1	7.8	13,704	—
東京海上ホールディングス	6.4	4.9	27,371	—
T&Dホールディングス	5.5	4.1	5,608	—
その他金融業 (1.3%)				
全国保証	0.5	0.4	1,798	—
芙蓉総合リース	0.2	0.1	727	—
東京センチュリー	0.4	0.3	2,559	—
イオンフィナンシャルサービス	1.1	0.8	1,071	—
アコム	—	2.8	1,285	—
オリエントコーポレーション	4.8	3.7	458	—
オリックス	11.2	8.6	15,535	—
三菱UFJリース	4.5	3.5	1,827	—
日本取引所グループ	5.1	4	10,708	—
不動産業 (2.1%)				
いちご	2.3	1.8	523	—
ヒューリック	3.7	2.9	3,300	—
野村不動産ホールディングス	1.1	0.8	1,785	—
プレサンスコーポレーション	0.3	—	—	—
オープンハウス	0.5	0.4	1,696	—
東急不動産ホールディングス	4.9	3.8	2,120	—
飯田グループホールディングス	1.5	1.2	2,649	—
パーク24	1	0.7	1,354	—
三井不動産	8.8	6.7	13,822	—
三菱地所	12.6	9.7	16,169	—
東京建物	2	1.4	2,037	—
住友不動産	4	3.1	9,606	—
スターツコーポレーション	0.2	0.2	556	—
イオンモール	0.9	0.7	1,197	—
日本空港ビルデング	0.6	0.4	2,516	—
サービス業 (5.5%)				
ミクシィ	0.4	0.3	757	—
ジェイエイシーリクルートメント	0.1	—	—	—
日本M&Aセンター	1.3	1	5,740	—
UTグループ	0.3	0.2	568	—
エス・エム・エス	0.5	0.4	1,610	—
パーソルホールディングス	1.7	1.3	2,429	—
総合警備保障	0.7	0.5	2,680	—
カカココム	1.3	1	2,822	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
ディップ	0.2	0.2	466	—
ベネフィット・ワン	0.6	0.5	1,562	—
エムスリー	3.8	3	30,090	—
アウトソーシング	1	0.8	1,023	—
ディー・エヌ・エー	0.9	—	—	—
博報堂DYホールディングス	2.4	1.9	2,819	—
電通グループ	1.8	1.5	4,620	—
オリエンタルランド	1.8	1.4	22,372	—
リゾートトラスト	0.8	—	—	—
ユー・エス・エス	1.9	1.5	3,211	—
サイバーエージェント	1	—	—	—
楽天	8.1	6.2	6,206	—
エン・ジャパン	0.3	0.2	605	—
テクノプロ・ホールディングス	0.3	0.3	2,541	—
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.1	1,777	—
リクルートホールディングス	12.4	8.9	40,343	—
ペイカレント・コンサルティング	—	0.1	1,767	—
リログループ	0.9	0.7	1,751	—
エイチ・アイ・エス	—	0.2	336	—
カナモト	0.3	0.2	464	—
セコム	1.8	1.4	13,771	—
メイテック	0.2	0.2	1,028	—
合 計	株 数	株 数	金 額	金 額
	1,518	1,014.6	2,800,313	2,800,313
	銘柄数<比率>	400銘柄	398銘柄	<97.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 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	百万円	百万円
J P X 日経400	62	—

■投資信託財産の構成

2021年1月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	2,800,313	97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	81,485	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,881,799	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,881,766,769円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	75,409,549
株 式(評価額)	2,800,313,760
未 収 入 金	2,281,210
未 収 配 当 金	3,740,750
差 入 委 託 証 拠 金	21,500
(B) 負 債	17,782,000
未 払 解 約 金	17,782,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,863,984,769
元 本	1,706,365,250
次 期 繰 越 損 益 金	1,157,619,519
(D) 受 益 権 総 口 数	1,706,365,250口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,784円

(注1) 期首元本額 2,325,607,335円
 追加設定元本額 335,810,184円
 一部解約元本額 955,052,269円

(注2) 期末における元本の内訳
 J P X日経400ノーロードオープン 923,047,032円
 J P X日経400インデックスファンド 403,425,578円
 J P X日経400インデックスファンド (適格機関投資家限定) 379,892,640円
 期末元本合計 1,706,365,250円

■損益の状況

当期 自2020年1月16日 至2021年1月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	67,267,709円
受 取 配 当 金	67,257,288
受 取 利 息	43
そ の 他 収 益 金	37,346
支 払 利 息	△26,968
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	206,700,384
売 買 益	489,371,570
売 買 損	△282,671,186
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	13,257,950
取 引 益	31,020,300
取 引 損	△17,762,350
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	287,226,043
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,173,380,391
(F) 解 約 差 損 益 金	△427,229,731
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	124,242,816
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,157,619,519
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,157,619,519

(注1) (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2) (F)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。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。