

運用報告書 (全体版)

第6期<決算日2020年1月15日>

J P X日経400インデックスファンド

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4月14日から2024年1月15日までです。	
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 4 0 0 インデックスファンド	J P X 日 経 4 0 0 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 4 0 0 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 4 0 0 インデックス
ファンド」は、2020年1月15日に第6
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インデックスファンド

■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 分金	期騰落 中率	(配当込み) (ベンチマーク)	期騰落 中率			
2期 (2016年1月15日)	円 12,442	円 0	% 2.4	ポイント 13,240.76	% 3.1	% 95.4	% 4.6	百万円 3,902
3期 (2017年1月16日)	13,725	0	10.3	14,704.28	11.1	97.7	2.3	2,931
4期 (2018年1月15日)	16,937	0	23.4	18,265.50	24.2	96.7	3.3	1,283
5期 (2019年1月15日)	14,133	0	△16.6	15,326.05	△16.1	94.2	5.7	1,178
6期 (2020年1月15日)	16,314	0	15.4	17,795.23	16.1	98.2	1.8	979

(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 4 0 0 (配 当 込 み) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポ イ ン ト	騰 落 率 %		
(期 首) 2019年 1 月15日	14,133	—	15,326.05	—	94.2	5.7
1 月 末	14,389	1.8	15,607.44	1.8	95.4	4.5
2 月 末	14,734	4.3	15,991.10	4.3	97.7	2.2
3 月 末	14,788	4.6	16,058.20	4.8	96.8	3.2
4 月 末	15,007	6.2	16,300.71	6.4	97.4	2.6
5 月 末	14,034	△0.7	15,248.80	△0.5	95.8	4.2
6 月 末	14,433	2.1	15,691.62	2.4	95.6	4.4
7 月 末	14,526	2.8	15,803.96	3.1	97.3	2.7
8 月 末	14,079	△0.4	15,323.16	△0.0	97.2	2.7
9 月 末	14,951	5.8	16,279.95	6.2	96.7	3.3
10月 末	15,698	11.1	17,096.69	11.6	98.0	1.9
11月 末	15,974	13.0	17,406.85	13.6	98.7	1.3
12月 末	16,196	14.6	17,660.14	15.2	97.1	2.9
(期 末) 2020年 1 月15日	16,314	15.4	17,795.23	16.1	98.2	1.8

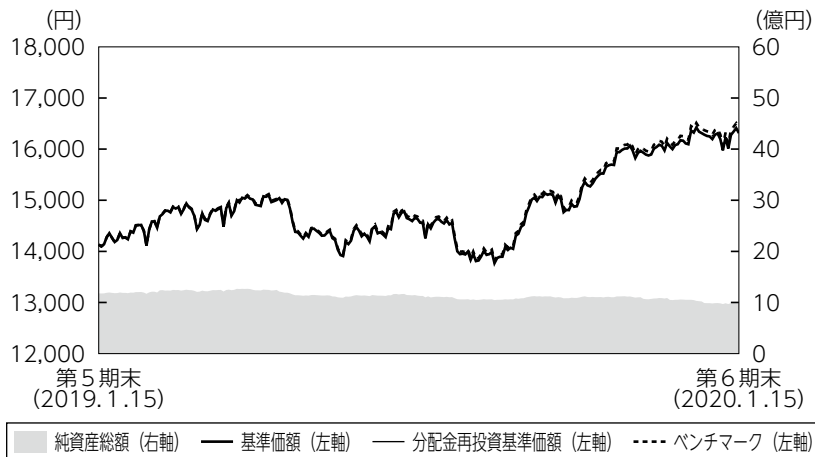
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2019年1月16日から2020年1月15日まで)

基準価額等の推移



- (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

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては協議が再開し第一弾の合意がなされたことを好感して国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2019年4月までは、米国が利上げに慎重な姿勢であったことや米中貿易問題の進展期待などを要因として国内株式市場は上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。9月から期末にかけては、米欧の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、上昇しました。

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

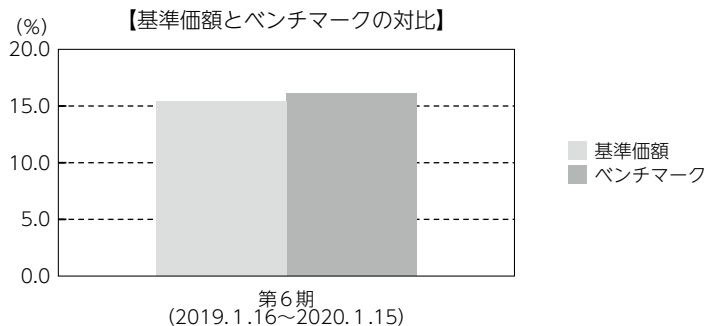
ベンチマークであるJ P X 日経インデックス400（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

※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16.1%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.7%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
	2019年1月16日 ～2020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	6,314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6期		項目の概要
	(2019年1月16日 ～2020年1月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	87円	0.581%	(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14,895円です。
(投信会社)	(42)	(0.282)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(39)	(0.261)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(6)	(0.038)	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
(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)	(0.003)	
(先物・オプション)	(1)	(0.006)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.002 (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	88	0.592	

(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す。

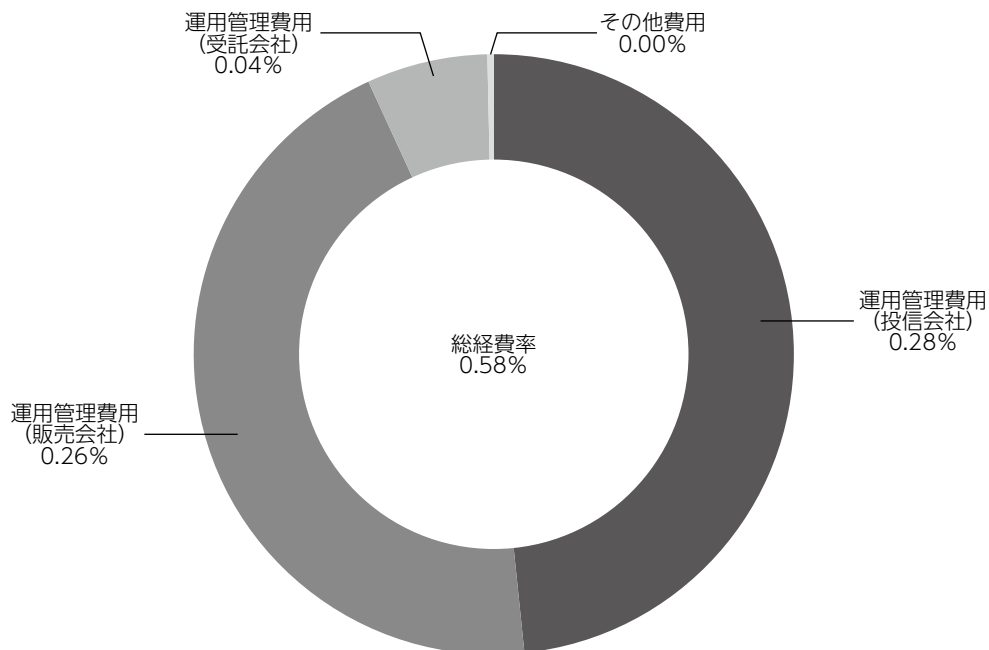
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.58%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（2019年1月16日から2020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	千口 62,232	千円 84,271	千口 320,936	千円 452,553

■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	1,313,949千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,686,034千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.35

(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（2019年1月16日から2020年1月15日まで）

【J P X日経400インデックス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

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)	105千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	86千円
(B)／(A)	81.5%

(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 298	百万円 0	% 0.2	百万円 1,015	百万円 408	% 40.2
株 式 先 物 取 引	1,427	1,427	100.0	1,605	1,605	100.0

平均保有割合 29.7%

(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 41

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□ 909,419	千□ 650,715	千円 979,001

■投資信託財産の構成

2020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	千円 979,001	% 98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,813	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	991,815	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

(2020年1月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	991,815,535円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,210,944
ＪＰＸ日経400インデックスファンド・マザーファンド(評価額)	979,001,591
未 収 入 金	9,603,000
(B) 負 債	12,767,118
未 払 解 約 金	9,618,346
未 払 信 託 報 酬	3,139,972
そ の 他 未 払 費 用	8,800
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	979,048,417
元 本	600,123,361
次 期 繰 越 損 益 金	378,925,056
(D) 受 益 権 総 口 数	600,123,361口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	16,314円

(注) 期首における元本額は833,830,871円、当期中における追加設定元本額は70,520,063円、同解約元本額は304,227,573円です。

■損益の状況

当期 自2019年1月16日 至2020年1月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△887円
受 取 利 息	217
支 払 利 息	△1,104
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	133,526,595
売 買 益	165,878,232
売 買 損	△32,351,637
(C) 信 託 報 酬 等	△6,579,041
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	126,946,667
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	8,155,856
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	243,822,533
(配 当 等 相 当 額)	(127,200,024)
(売 買 損 益 相 当 額)	(116,622,509)
(G) 合 計(D+E+F)	378,925,056
次 期 繰 越 損 益 金(G)	378,925,056
追 加 信 託 差 損 益 金	243,822,533
(配 当 等 相 当 額)	(127,409,235)
(売 買 損 益 相 当 額)	(116,413,298)
分 配 準 備 積 立 金	165,770,912
繰 越 損 益 金	△30,668,389

(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	21,635,770円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	213,154,144
(d) 分 配 準 備 積 立 金	144,135,142
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	378,925,056
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,314.12
(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6期 (決算日 2020年1月15日)

(計算期間 2019年1月16日～2020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6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
	円	騰落率	(配当込み) ベンチマーク	騰落率			
2期(2016年1月15日)	11,210	3.0%	ポイント 13,240.76	% 3.1	% 95.4	% 4.6	百万円 9,990
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

(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

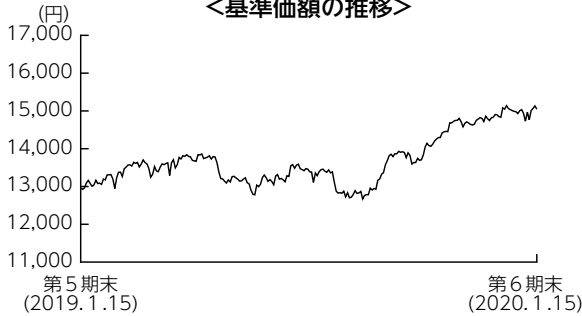
年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年 1 月 15 日	12,958	% -	15,326.05	% -	% 94.2	% 5.7
1 月 末	13,196	1.8	15,607.44	1.8	95.4	4.5
2 月 末	13,518	4.3	15,991.10	4.3	97.8	2.2
3 月 末	13,574	4.8	16,058.20	4.8	96.8	3.2
4 月 末	13,781	6.4	16,300.71	6.4	97.4	2.6
5 月 末	12,895	△0.5	15,248.80	△0.5	95.8	4.2
6 月 末	13,267	2.4	15,691.62	2.4	95.6	4.4
7 月 末	13,360	3.1	15,803.96	3.1	97.3	2.7
8 月 末	12,955	△0.0	15,323.16	△0.0	97.2	2.7
9 月 末	13,764	6.2	16,279.95	6.2	96.7	3.3
10 月 末	14,459	11.6	17,096.69	11.6	98.0	1.9
11 月 末	14,720	13.6	17,406.85	13.6	98.7	1.3
12 月 末	14,932	15.2	17,660.14	15.2	97.1	2.9
(期 末) 2020年 1 月 15 日	15,045	16.1	17,795.23	16.1	98.2	1.8

(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（2019年1月16日から2020年1月15日まで）

<基準価額の推移>



基準価額の推移

当期末の基準価額は15,045円となり、前期末比で16.1%上昇しました。

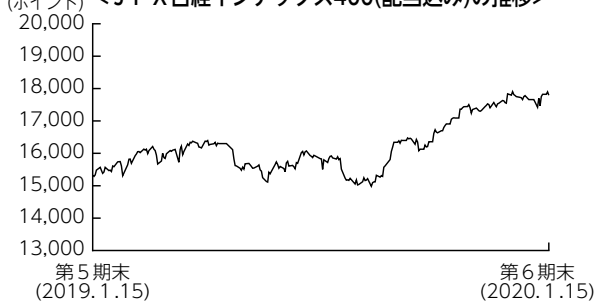
基準価額の主な変動要因

米中貿易協議の状況次第の相場展開となりましたが、期末にかけては協議が再開し第一弾の合意がなされたことを好感して国内株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2019年4月までは、米国が利上げに慎重な姿勢であったことや米中貿易問題の進展期待などを要因として国内株式市場は上昇しました。しかし、5月に入ると世界景気の後退懸念が広がり反落しました。その後はほぼ横ばいとなりましたが、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。9月から期末にかけては、米欧の中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、上昇しました。

<JPX日経インデックス400(配当込み)の推移>



ポートフォリオについて

ベンチマークであるJPX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	1.5%
2	本田技研工業	日本・円	1.5
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.4
4	ソフトバンクグループ	日本・円	1.4
5	トヨタ自動車	日本・円	1.4
6	キーエンス	日本・円	1.4
7	日本電信電話	日本・円	1.4
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.3
9	みずほフィナンシャルグループ	日本・円	1.3
10	KDDI	日本・円	1.3
組入銘柄数		398銘柄	



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	

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16.1%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。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 (0) (1)	0.009% (0.003) (0.006)
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(13,696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 (2019年1月16日から2020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 148.8 (42.7)	千円 298,841 (-)	千株 475.3	千円 1,015,108

(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 400	百万円 1,427	百万円 1,605	百万円 -	百万円 -	百万円 61	百万円 -	百万円 0	

(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	1,313,949千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,686,034千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.35

(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（2019年1月16日から2020年1月15日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 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 298	百万円 0	% 0.2	百万円 1,015	百万円 408	% 40.2
株 式 先 物 取 引	1,427	1,427	100.0	1,605	1,605	100.0

(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 41

(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)	361千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	294千円
(B) / (A)	81.4%

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
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	2.9	2.5	1,550	
マルハニチロ	0.4	0.4	1,101	
鉱業 (0.3%)				
国際石油開発帝石	11.8	9.9	11,266	
建設業 (2.7%)				
安藤・間	1.9	1.5	1,441	
東急建設	0.9	0.7	528	
コムシスホールディングス	1	0.9	2,884	
大成建設	2.4	1.9	8,569	
大林組	7.3	5.7	6,925	
清水建設	7.4	5.8	6,525	
長谷工コーポレーション	3	2.2	3,249	
鹿島建設	5.7	4.5	6,376	
西松建設	0.5	0.4	976	
三井住友建設	1.8	1.4	873	
前田建設工業	1.7	1.4	1,426	
戸田建設	2.8	2.4	1,706	
熊谷組	0.3	0.3	979	
大東建託	0.9	0.7	9,061	
NIPPPO	0.6	0.5	1,209	
前田道路	0.8	—	—	
五洋建設	2.9	2.3	1,534	
住友林業	1.7	1.4	2,221	
大和ハウス工業	6.7	5.6	19,224	
積水ハウス	7.4	6.2	14,821	
協和エクシオ	0.9	0.9	2,511	
九電工	0.5	0.4	1,302	
食料品 (3.7%)				
森永製菓	0.5	0.4	2,120	
江崎グリコ	0.7	0.5	2,435	
カルビー	1	0.8	2,896	
ヤクルト本社	1.6	1.3	7,904	
明治ホールディングス	1.5	1.2	9,012	
日本ハム	0.9	0.7	3,360	
アサヒグループホールディングス	4.6	3.8	18,772	
キリンホールディングス	9.8	7.7	18,918	
サントリー食品インターナショナル	1.5	1.2	5,580	
キッコーマン	1.4	1.3	7,046	
味の素	4.8	4	7,302	
キューピー	1.2	1	2,443	
アリアケジャパン	—	0.2	1,576	
ニチレイ	1.1	0.9	2,408	
東洋水産	1.1	0.9	4,099	
日清食品ホールディングス	0.9	0.8	6,568	
日本たばこ産業	12.6	10.5	25,431	
繊維製品 (0.4%)				
帯人	1.7	1.5	3,052	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
東レ	16.5	12.9	9,605	
ゴールドウイン	—	0.3	2,373	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	9.6	7.4	4,358	
化学 (7.3%)				
クラレ	3.6	2.8	3,679	
旭化成	15.1	11.8	14,042	
昭和電工	1.4	1.3	3,582	
住友化学	16.7	13.1	6,301	
日産化学	1.3	1	4,645	
東ソー	3.3	2.8	4,729	
トクヤマ	—	0.5	1,420	
デンカ	0.8	0.6	1,908	
信越化学工業	3.7	3.1	38,378	
エア・ウォーター	1.7	1.5	2,394	
大陽日酸	1.7	1.7	4,188	
日本パーカラライジング	1.2	—	—	
三菱瓦斯化学	2.2	1.7	2,837	
三井化学	1.9	1.6	4,217	
J S R	2.1	1.7	3,493	
三菱ケミカルホールディングス	14.2	11.9	9,709	
ダイセル	3.3	2.4	2,464	
積水化学工業	4.6	3.8	7,121	
日本ゼオン	1.9	—	—	
アイカ工業	0.6	0.5	1,780	
宇部興産	1.1	0.9	2,105	
日立化成	1	0.8	3,676	
ダイキョーニシカワ	0.4	0.4	325	
日油	0.8	0.7	2,453	
花王	5.3	4.4	40,585	
日本ペイントホールディングス	1.8	1.5	8,670	
関西ペイント	2.4	2	5,478	
D I C	1	0.8	2,389	
資生堂	4.3	3.6	28,738	
ライオン	3	2.4	5,030	
コーセー	0.4	0.3	5,115	
ポーラ・オルビスホールディングス	0.9	0.8	2,102	
小林製薬	0.6	0.5	4,630	
日東電工	1.6	1.3	7,943	
ニフコ	0.9	0.7	2,062	
ユニ・チャーム	4.6	3.5	13,300	
医薬品 (6.9%)				
協和キリン	2.7	1.8	4,721	
武田薬品工業	8.6	11.6	51,028	
アステラス製薬	20	16	30,352	
大日本住友製薬	1.6	1.3	2,776	
塩野義製薬	2.8	2.3	15,842	
田辺三菱製薬	2.3	2.2	4,411	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本新薬	-	0.5	5,090
中外製薬	2.3	1.9	19,760
科研製薬	0.4	0.3	1,782
エーザイ	2.6	2.2	18,077
小野薬品工業	5.1	4.2	10,791
久光製薬	0.6	0.5	3,000
参天製薬	4.1	3.4	7,490
ツムラ	0.7	-	-
沢井製薬	0.4	0.4	2,800
第一三共	6.2	5.2	36,878
大塚ホールディングス	4.1	3.5	17,272
ペプチドリーム	-	0.9	5,139
石油・石炭製品 (0.6%)			
出光興産	1.7	2	5,866
J X T Gホールディングス	36.4	27.3	13,445
コスモエネルギーホールディングス	0.6	0.5	1,222
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	1.3	1.1	2,256
ブリヂストン	6.7	5.6	22,456
住友ゴム工業	1.9	1.6	2,060
ガラス・土石製品 (0.8%)			
A G C	2.1	1.8	6,930
太平洋セメント	1.4	1.1	3,393
東海カーボン	-	1.9	1,968
T O T O	1.7	1.3	6,194
日本碍子	2.6	2.2	4,296
日本特殊陶業	1.8	1.4	2,926
ニチアス	0.6	0.5	1,366
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	9.6	8	13,548
ジェイエフイーホールディングス	5.8	4.9	7,266
東京製鐵	1.1	-	-
日立金属	2.3	1.9	3,176
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	5.8	4.5	1,003
三菱マテリアル	1.4	-	-
住友金属鉱山	2.9	2.3	7,886
DOWAホールディングス	0.5	0.5	2,082
古河電気工業	0.6	0.6	1,634
住友電気工業	8	6.7	10,820
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	2.4	2.2	4,206
三和ホールディングス	2.2	1.7	2,091
リンナイ	0.4	0.3	2,484
東プレ	0.4	0.3	521
日本発条	2.1	-	-
機械 (5.0%)			
アマダホールディングス	3.3	2.3	2,879
オーエスジー	1.1	0.8	1,612
DMG森精機	1.4	1.1	1,841
ディスコ	0.3	0.2	5,308

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナブテスコ	1.2	1.1	3,740
三井海洋開発	0.2	0.2	524
S M C	0.6	0.6	31,980
小松製作所	9.8	8.2	21,484
住友重機械工業	1.2	1	3,100
日立建機	0.9	0.7	2,324
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.4	0.4	2,084
クボタ	11.6	9.6	16,339
荏原製作所	1	-	-
ダイキン工業	3	2.3	35,155
橋本チエイン	0.3	-	-
ダイフク	1.2	0.9	6,498
タダノ	1	-	-
平和	0.6	-	-
竹内製作所	0.4	0.3	549
T P R	0.3	0.2	403
ホシザキ	0.6	-	-
日本精工	4.5	3.4	3,485
ジェイテクト	2.1	1.7	2,179
T H K	1.4	1.1	3,454
マキタ	2.6	2.4	9,672
三菱重工業	3.6	3	12,732
I H I	-	1.3	3,664
電気機器 (16.1%)			
コニカミノルタ	4.7	4	2,864
ブラザー工業	2.8	2.2	5,046
ミネベアミツミ	4	3.4	8,095
日立製作所	9.8	8.7	39,306
三菱電機	21.7	18.2	27,764
富士電機	1.4	1.1	3,690
安川電機	2.5	2	8,690
東芝テック	-	0.2	902
日本電産	2.6	2.2	33,693
日新電機	-	0.4	540
オムロン	2.3	1.6	10,288
日本電気	2.8	2.2	10,868
富士通	2.1	1.8	19,953
ルネサスエレクトロニクス	2.2	8.7	6,846
セイコーエプソン	2.7	2.3	3,753
アルバック	0.5	0.4	1,682
エレコム	0.2	0.2	903
パナソニック	24.8	20.8	22,640
富士通ゼネラル	0.7	0.5	1,279
ソニー	11	7.8	61,464
T D K	1.1	0.9	11,124
アルプスアルパイン	2	1.6	4,078
クラリオン	0.2	-	-
ヒロセ電機	0.3	0.3	4,215
横河電機	2.2	1.7	3,400
アズビル	-	1.1	3,311
日本光電工業	1	0.8	2,408

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
堀場製作所	0.4	0.4	2,868	
アドバンテスト	1.5	1.4	8,694	
キーエンス	1	1.3	51,974	
シスメックス	1.7	1.3	9,994	
OBARA GROUP	0.1	0.1	369	
レーザーテック	—	0.8	4,672	
スタンレー電気	1.5	1.3	4,095	
カシオ計算機	1.9	1.6	3,604	
ファナック	2.1	1.7	35,232	
浜松ホトニクス	1.6	1.3	5,882	
京セラ	3.3	2.6	20,053	
太陽誘電	—	0.8	2,916	
村田製作所	2.3	5.3	35,785	
小糸製作所	1.3	1.1	5,511	
SCREENホールディングス	0.4	0.3	2,373	
キャノン	11.7	9.8	30,105	
東京エレクトロン	1.4	1.2	30,000	
輸送用機器 (5.9%)				
トヨタ紡織	0.8	0.5	853	
豊田自動織機	1.8	1.5	9,495	
デンソー	4.8	4	19,584	
川崎重工業	1.7	1.4	3,309	
日産自動車	25.6	—	—	
いすゞ自動車	6.9	5.3	6,452	
トヨタ自動車	8	7	53,704	
日野自動車	2.7	2.3	2,596	
NOK	1.2	—	—	
アイシン精機	1.8	1.5	5,782	
マツダ	6.8	5.3	5,035	
本田技研工業	18	14.3	43,514	
スズキ	4	3.6	16,970	
SUBARU	6.7	5.6	14,952	
ヤマハ発動機	3.1	2.4	5,104	
豊田合成	0.7	0.6	1,651	
シマノ	0.9	0.7	12,278	
テイ・エス テック	0.5	0.4	1,300	
精密機器 (2.8%)				
テルモ	3.1	5.1	20,063	
島津製作所	2.8	2.2	7,260	
ブイ・テクノロジー	—	0.1	529	
東京精密	—	0.3	1,284	
ニコン	—	2.9	4,007	
オリンパス	3.2	10.1	17,907	
HOYA	4.4	3.6	38,430	
朝日インテック	1	2.1	6,856	
その他製品 (2.1%)				
バンダイナムコホールディングス	2.2	1.9	12,435	
パイロットコーポレーション	0.4	0.3	1,330	
タカラトミー	—	0.8	1,029	
アシックス	2.2	—	—	
ヤマハ	1.3	1.1	6,677	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
ビジョン	1.3	1.1	4,609	
任天堂	1.3	1.1	47,377	
電気・ガス業 (1.3%)				
中部電力	6.6	5.6	8,114	
関西電力	8.8	6.9	8,542	
東北電力	5.1	4.5	4,590	
九州電力	4.5	3.7	3,293	
電源開発	1.7	1.4	3,589	
東京瓦斯	4.3	3.5	8,949	
大阪瓦斯	4.2	3.5	6,933	
東邦瓦斯	1.1	—	—	
陸運業 (4.9%)				
東武鉄道	2.3	1.9	7,571	
相鉄ホールディングス	1	0.8	2,374	
東急	5.9	4.6	9,200	
小田急電鉄	3.5	2.7	6,852	
京王電鉄	1.2	0.9	5,913	
京成電鉄	1.6	1.3	5,694	
東日本旅客鉄道	3.9	3.2	31,808	
西日本旅客鉄道	1.9	1.6	15,051	
東海旅客鉄道	1.9	1.5	32,595	
西武ホールディングス	2.8	2.4	4,408	
近鉄グループホールディングス	2.1	1.7	10,200	
阪急阪神ホールディングス	2.7	2.3	10,729	
京阪ホールディングス	1.2	1	5,290	
名古屋鉄道	2.2	1.9	6,450	
日本通運	0.8	0.6	3,834	
ヤマトホールディングス	3.6	3	5,508	
山九	0.6	0.5	2,795	
日立物流	0.5	0.3	967	
空運業 (0.6%)				
日本航空	3.8	3.1	10,605	
ANAホールディングス	3.8	3.1	11,098	
情報・通信業 (8.0%)				
日鉄ソリューションズ	0.3	0.3	1,126	
TIS	0.7	0.6	3,996	
ネクソン	5.4	5.1	8,068	
コロブラ	0.6	0.6	714	
ティーガイア	0.2	0.2	531	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5.1	0.4	902	
GMOペイメントゲートウェイ	—	0.3	2,406	
アカツキ	—	0.1	584	
野村総合研究所	1.4	3	7,068	
オービック	0.7	0.6	9,240	
Zホールディングス	13.9	24.5	11,245	
トレンドマイクロ	1.1	0.8	4,584	
日本オラクル	0.3	0.4	3,988	
伊藤忠テクノソリューションズ	1	0.8	2,620	
大塚商会	1.2	1	4,495	
デジタルガレージ	—	0.3	1,369	
日本ユニシス	0.7	0.6	2,091	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
日本テレビホールディングス	2	1.5	2,200	
日本電信電話	11.8	18.2	50,869	
KDDI	18.7	13.3	43,491	
光通信	0.3	0.2	5,594	
NTTドコモ	15.3	13.2	40,722	
GMOインターネット	0.8	—	—	
東宝	1.4	1.1	4,719	
エヌ・ティ・ティ・データ	5.7	4.7	7,238	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1	0.8	4,344	
カプコン	0.9	0.8	2,440	
SCSK	0.6	0.4	2,360	
コナミホールディングス	0.9	0.6	2,685	
ソフトバンクグループ	7.2	8.6	42,819	
卸売業 (5.2%)				
双日	11.8	9.9	3,435	
アルフレッサ ホールディングス	2.4	2	4,474	
神戸物産	0.3	0.6	2,463	
ダイワボウホールディングス	—	0.2	1,286	
TOKAIホールディングス	—	0.9	960	
シップヘルスケアホールディングス	0.4	0.3	1,509	
コマダホールディングス	—	0.4	908	
第一興商	0.4	0.4	2,228	
メディアパルホールディングス	2.3	1.9	4,632	
日本ライフライン	—	0.5	738	
伊藤忠商事	14.9	12.5	31,956	
丸紅	21.1	18.6	15,136	
豊田通商	2.4	2	7,410	
兼松	0.9	0.7	1,007	
三井物産	17.6	15.7	30,654	
日立ハイテクノロジーズ	0.6	0.6	4,674	
住友商事	12.6	11.3	18,289	
三菱商事	15	12.6	36,275	
阪和興業	0.4	—	—	
岩谷産業	0.5	0.4	1,484	
東邦ホールディングス	0.6	—	—	
PALTAC	0.4	0.3	1,671	
日鉄物産	0.2	0.1	510	
ミスミグループ本社	2.7	2.2	6,560	
小売業 (4.5%)				
ローソン	0.5	0.5	3,175	
エービーシー・マート	0.3	0.3	2,115	
アダストリア	0.3	—	—	
日本マクドナルドホールディングス	—	0.8	4,224	
セリア	0.6	0.4	1,338	
ビックカメラ	1.1	1.1	1,487	
MonotaRO	1.3	1.3	3,555	
J. フロント リテイリング	2.7	2.1	3,221	
マツモトキヨシホールディングス	0.9	0.7	3,052	
ZOZO	2.3	1.2	2,365	
ウエルシアホールディングス	0.6	0.5	3,350	
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.3	879	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
すかいらーくホールディングス	2	2	4,334	
コスモス薬品	0.1	0.1	2,467	
セブン&アイ・ホールディングス	8.9	7	29,743	
ツルハホールディングス	0.5	0.4	5,528	
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.2	1,390	
ノジマ	0.4	0.3	661	
良品計画	0.3	2.4	4,953	
パナソニック・インターナショナルホールディングス	1.4	4.3	7,955	
ゼンショーホールディングス	1	0.9	2,230	
ワークマン	—	0.2	1,948	
ユナイテッドアローズ	0.2	0.2	576	
スギホールディングス	0.5	0.4	2,260	
ファミリーマート	0.6	1.4	3,795	
日本瓦斯	0.3	—	—	
しまむら	0.2	0.2	1,622	
丸井グループ	1.8	1.6	4,376	
イオン	8.2	6.9	16,442	
イズミ	0.4	0.4	1,516	
ヤオコー	0.2	0.2	1,110	
ケーズホールディングス	2.2	1.7	2,400	
アインホールディングス	0.3	0.2	1,312	
ニトリホールディングス	0.9	0.8	13,844	
ファーストリテイリング	0.3	0.2	12,864	
サンドラッグ	0.8	0.7	2,789	
銀行業 (5.3%)				
めざぎフィナンシャルグループ	11.1	9.3	2,445	
九州フィナンシャルグループ	4.7	—	—	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	13.6	10.5	4,504	
新生銀行	1.6	1.3	2,108	
あおぞら銀行	1.2	1.1	3,206	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	98.5	91	52,679	
りそなホールディングス	23.5	19.7	9,168	
三井住友トラスト・ホールディングス	4.2	3.4	14,297	
三井住友フィナンシャルグループ	13.5	12	47,616	
千葉銀行	7.6	6.2	3,912	
静岡銀行	5.4	—	—	
広島銀行	3.2	—	—	
セブン銀行	7.2	6	2,016	
みずほフィナンシャルグループ	290.5	243.6	40,267	
証券・商品先物取引業 (0.9%)				
FPG	0.7	0.6	622	
SBIホールディングス	2.5	2	4,876	
大和証券グループ本社	17.2	14.4	8,206	
野村ホールディングス	39.2	31.5	18,049	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2.5	—	—	
松井証券	1	1	880	
保険業 (2.9%)				
SOMPOホールディングス	3.8	3.4	14,331	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	5.6	4.7	17,192	
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.8	1.5	3,867	
第一生命ホールディングス	12.1	10.1	17,649	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京海上ホールディングス	7.7	6.4	39,116
T&Dホールディングス	6.6	5.5	7,227
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	0.6	0.5	2,360
芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,430
東京センチュリー	0.4	0.4	2,284
イオンフィナンシャルサービス	1.4	1.1	1,872
オリエントコーポレーション	5.8	4.8	820
日立キャピタル	0.5	—	—
オリックス	14.3	11.2	20,658
三菱UFJリース	4.8	4.5	3,118
日本取引所グループ	5.8	5.1	10,118
不動産業 (2.8%)			
いちご	2.7	2.3	1,062
ヒューリック	4.5	3.7	4,880
野村不動産ホールディングス	1.4	1.1	3,003
プレサンスコーポレーション	0.3	0.3	405
オープンハウス	0.3	0.5	1,515
東急不動産ホールディングス	5.7	4.9	3,630
飯田グループホールディングス	1.8	1.5	2,878
パーク24	1.2	1	2,677
三井不動産	11.3	8.8	24,274
三菱地所	15	12.6	26,315
東京建物	2.3	2	3,404
住友不動産	4.8	4	15,160
レオパレス21	2.6	—	—
スターツコーポレーション	0.3	0.2	545
イオンモール	1.1	0.9	1,693
日本空港ビルデング	—	0.6	3,432
サービス業 (5.0%)			
ミクシィ	0.6	0.4	807
ジェイエイシーリクルートメント	—	0.1	189
日本M&Aセンター	1.5	1.3	5,154
UTグループ	—	0.3	958
エス・エム・エス	—	0.5	1,520
パーソルホールディングス	2.1	1.7	3,570
総合警備保障	0.8	0.7	4,193
カカココム	1.6	1.3	3,906

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ディップ	0.3	0.2	710
ベネフィット・ワン	—	0.6	1,373
エムスリー	4.4	3.8	12,502
アウトソーシング	—	1	1,107
ディー・エヌ・エー	1.1	0.9	1,628
博報堂DYホールディングス	2.9	2.4	4,159
電通グループ	2.5	1.8	6,786
オリエンタルランド	2.4	1.8	28,611
リゾートトラスト	0.9	0.8	1,446
ユー・エス・エス	2.5	1.9	3,858
サイバーエージェント	1.3	1	3,890
楽天	9.7	8.1	7,387
エン・ジャパン	0.3	0.3	1,461
テクノプロ・ホールディングス	0.4	0.3	2,223
リクルートホールディングス	14.8	12.4	52,055
リログループ	1.1	0.9	2,692
カナモト	0.3	0.3	831
セコム	2.2	1.8	17,458
メイテック	0.3	0.2	1,248
イオンディライト	0.3	—	—
合 計	株 数・金 額 銘柄数<比率>	千株 1,801.8 398銘柄	千株 1,518 400銘柄 3,435,798 <98.2%>

(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 61	百万円 —
J P X 日経400		

■投資信託財産の構成

2020年1月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 3,435,798	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	99,671	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	3,535,470	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

(2020年1月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,535,455,726円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	92,353,526
株 式(評価額)	3,435,798,250
未 収 入 金	455,500
未 収 配 当 金	5,836,950
差 入 委 託 証 拠 金	1,011,500
(B) 負 債	36,468,000
未 払 解 約 金	36,468,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,498,987,726
元 本	2,325,607,335
次 期 繰 越 損 益 金	1,173,380,391
(D) 受 益 権 総 口 数	2,325,607,335口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,045円

(注1) 期首元本額 3,017,566,816円
追加設定元本額 333,156,912円
一部解約元本額 1,025,116,393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 1,138,597,174円
J P X 日 経 400 イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド 650,715,581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) 536,294,580円
期末元本合計 2,325,607,335円

■損益の状況

当期 自2019年1月16日 至2020年1月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	94,504,831円
受 取 配 当 金	94,481,272
そ の 他 収 益 金	99,253
支 払 利 息	△75,694
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	467,686,390
売 買 益	597,868,393
売 買 損	△130,182,003
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	18,372,914
取 引 益	26,838,572
取 引 損	△8,465,658
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	580,564,135
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	892,615,775
(F) 解 約 差 損 益 金	△408,996,607
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	109,197,088
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,173,380,391
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,173,380,391

(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。