

■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22日から2023年11月20日までです。	
運用方針	JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	りそな・JPX日経400オープン	アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド受益証券
	アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	日本の金融商品取引所の上場株式
組入制限	りそな・JPX日経400オープン	株式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。
	アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	株式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。
分配方針	毎決算時（毎年11月19日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として、次の通り収益分配を行います。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みません）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

りそな・JPX日経400オープン

運用報告書（全体版）

第8期（決算日 2021年11月19日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン：03-3593-5911（2022年6月30日まで）

050-4561-2500（2022年7月1日から）

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

< 1942732・1947955 >

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPX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	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
4期(2017年11月20日)	14,059	0	22.2	17,063.36	23.1	96.3	3.6	5,282
5期(2018年11月19日)	13,257	0	△5.7	16,209.18	△5.0	96.0	3.9	4,864
6期(2019年11月19日)	14,090	0	6.3	17,358.40	7.1	98.7	1.2	4,405
7期(2020年11月19日)	14,826	0	5.2	18,389.39	5.9	96.0	3.9	3,337
8期(2021年11月19日)	17,712	0	19.5	22,139.45	20.4	97.8	2.1	3,400

(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」は実質組入比率を記載しています。以下同じ。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注3) ・ベンチマークは、JPX日経インデックス400(配当込み)です。「JPX日経インデックス400」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「JPXグループ」といいます)ならびに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、JPXグループおよび日経は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX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。以下同じ。
 ・「JPX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JPXグループおよび日経に帰属します。
 ・「りそな・JPX日経400オープン」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPXグループおよび日経は、その運用および「りそな・JPX日経400オープン」の取引に関して、一切の責任を負いません。
 ・JPXグループおよび日経は、「JPX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。
 ・JPXグループおよび日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX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ます。

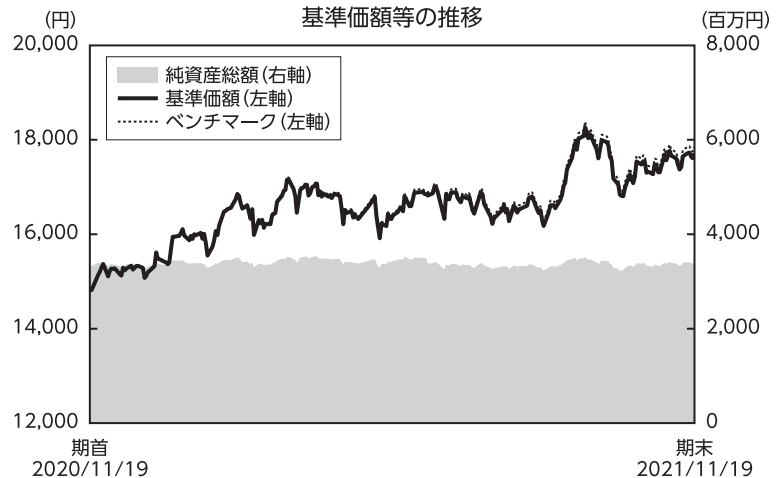
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPX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
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2020年11月19日	14,826	—	18,389.39	—	96.0	3.9
11月末	15,108	1.9	18,743.72	1.9	97.8	2.2
12月末	15,488	4.5	19,225.39	4.5	98.7	1.3
2021年1月末	15,549	4.9	19,307.10	5.0	97.6	2.3
2月末	15,985	7.8	19,856.75	8.0	97.4	2.5
3月末	16,819	13.4	20,913.30	13.7	96.3	3.5
4月末	16,321	10.1	20,297.99	10.4	96.5	3.4
5月末	16,591	11.9	20,648.99	12.3	95.3	4.5
6月末	16,715	12.7	20,821.61	13.2	97.8	2.1
7月末	16,275	9.8	20,287.57	10.3	97.3	2.6
8月末	16,834	13.5	21,005.77	14.2	97.7	2.2
9月末	17,569	18.5	21,942.86	19.3	98.6	1.3
10月末	17,311	16.8	21,629.06	17.6	97.8	2.2
(期末)						
2021年11月19日	17,712	19.5	22,139.45	20.4	97.8	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第8期首	14,826円
第8期末	17,712円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	19.5%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、JPX日経インデックス400（配当込み）です。

(注2) ベンチマークは、2020年11月19日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 2020年11月の米国大統領選挙と、その後の議会選挙で共に民主党が勝利し大規模財政支出が確実なものとなったことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が早期に始まることなどを好感したこと（2020年11月～2021年1月）
- ② 菅首相が自民党総裁選不出馬を表明したことから、政局の不透明感が払拭（ふっしょく）され次期政権への政策期待が高まったこと（2021年9月）

下落要因

- ① F R B（米連邦準備理事会）議長が金利上昇容認ともとれる発言をしたことや、新型コロナウイルス感染再拡大の国内景気への悪影響が懸念されたこと（2021年2月）
- ② 中国大手不動産会社の債務不履行懸念や、国内新政権の一部政策に対する疑問が広がったこと（2021年10月）

【投資環境】

投資環境については、主要投資対象であるアムンディ・JPX日経400オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ポートフォリオ】**<当ファンド>**

当ファンドは、アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンドの受益証券への投資を通じて、JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。また、マザーファンドの株式の組入比率は原則として高位を保ちました。

<アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド>

ポートフォリオについては、主要投資対象であるアムンディ・JPX日経400オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+19.5%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の騰落率（+20.4%）を0.9%下回る結果となりましたが、おおむねベンチマークと連動した動きとなりました。

マイナス要因：

- ① 売買手数料や信託報酬等

プラス要因：

- ① 追加設定・一部解約と株式等の売買タイミングの違い
- ② 先物取引の影響

【分配金】

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】**<当ファンド>**

引き続き、アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンドの受益証券への投資を通じて、JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

<アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド>

マザーファンドの今後の運用方針につきましては、アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 8 期 (2020年11月20日 ～2021年11月19日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	108円 (49) (54) (5)	0.660% (0.297) (0.330) (0.033)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	1 (0) (1)	0.006 (0.001) (0.004)	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他)	12 (2) (7) (4)	0.076 (0.011) (0.043) (0.022)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	121	0.742	

期中の平均基準価額は16,380円です。

(注1) 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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

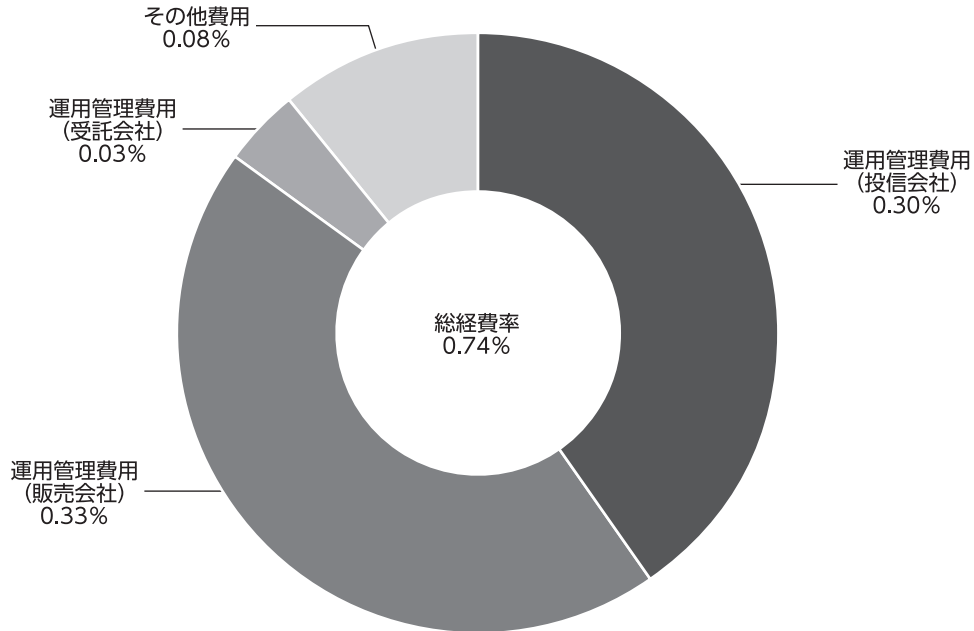
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注5) 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、売買委託手数料およ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0.74%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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応する費用を含みます。

(注5) 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。

■売買及び取引の状況（2020年11月20日から2021年11月19日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	181,018	309,718	511,348	884,841

(注) 単位未満は切捨てです。

■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
	アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,351,072千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,269,270千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.41

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) (b)は各月末現在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11月20日から2021年11月19日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細（2021年11月19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
	千口	千口	千円
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	2,153,042	1,822,713	3,399,360

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド全体の受益権口数は、当期末1,822,713千口です。

■投資信託財産の構成 (2021年11月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	3,399,360	99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,786	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	3,423,146	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,423,146,305円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,679,229
アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド(評価額)	3,399,360,076
未 収 入 金	10,107,000
(B) 負 債	23,035,866
未 払 解 約 金	10,084,845
未 払 信 託 報 酬	11,212,058
未 払 利 息	35
そ の 他 未 払 費 用	1,738,928
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,400,110,439
元 本	1,919,655,347
次 期 繰 越 損 益 金	1,480,455,092
(D) 受 益 権 総 口 数	1,919,655,347口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,712円

(注記事項)

期首元本額	2,250,864,930円
期中追加設定元本額	291,035,913円
期中一部解約元本額	622,245,496円

■損益の状況

当期 (自2020年11月20日 至2021年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 6,889円
支 払 利 息	△ 6,889
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	539,475,509
売 買 益	632,831,560
売 買 損	△ 93,356,051
(C) 信 託 報 酬 等	△ 24,906,440
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	514,562,180
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	408,214,884
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	557,678,028
(配 当 等 相 当 額)	(564,272,951)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,594,923)
(G) 計 (D+E+F)	1,480,455,092
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,480,455,092
追 加 信 託 差 損 益 金	557,678,028
(配 当 等 相 当 額)	(565,245,153)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 7,567,125)
分 配 準 備 積 立 金	922,777,064

(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。

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項 目	第8期
	(2020年11月20日～2021年11月19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	7,751

(注1) 「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る点にご留意ください。

(注2) 「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。

アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド

運用報告書

《第8期》

決算日：2021年11月19日

(計算期間：2020年11月20日～2021年11月19日)

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況について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。

運用方針	JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本の金融商品取引所の上場株式
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		JPX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	純資産 総 額
	円	騰落率	(ベンチマーク) ポイント	騰落率			
4期 (2017年11月20日)	14,380	23.1	17,063.36	23.1	96.4	3.6	5,278
5期 (2018年11月19日)	13,656	△ 5.0	16,209.18	△ 5.0	96.0	3.9	4,861
6期 (2019年11月19日)	14,619	7.1	17,358.40	7.1	98.7	1.2	4,403
7期 (2020年11月19日)	15,496	6.0	18,389.39	5.9	96.0	3.9	3,336
8期 (2021年11月19日)	18,650	20.4	22,139.45	20.4	97.9	2.1	3,399

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注2) ・ベンチマークは、JPX日経インデックス400 (配当込み) です。「JPX日経インデックス400」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「JPXグループ」といいます) ならびに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、JPXグループおよび日経は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX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。以下同じ。

- ・「JPX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JPXグループおよび日経に帰属します。
- ・「りそな・JPX日経400オープン」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPXグループおよび日経は、その運用および「りそな・JPX日経400オープン」の取引に関して、一切の責任を負いません。
- ・JPXグループおよび日経は、「JPX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。
- ・JPXグループおよび日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX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ます。

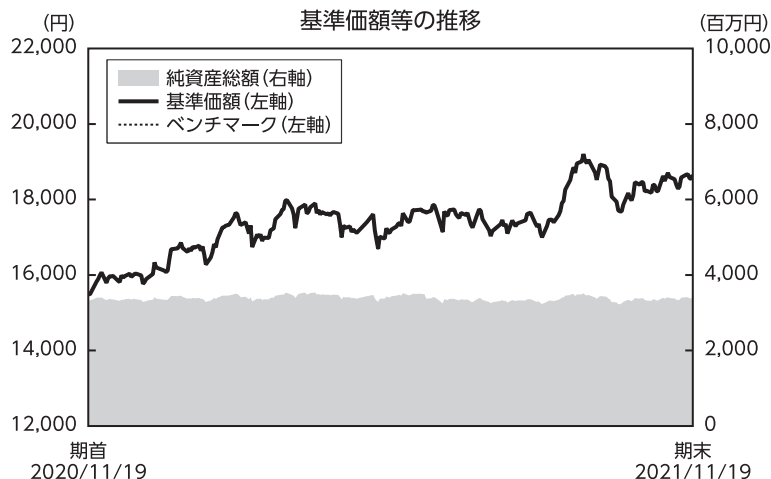
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰落率	(ベンチマーク) ポイント	騰落率		
(期首) 2020年11月19日	15,496	—	18,389.39	—	96.0	3.9
11月末	15,794	1.9	18,743.72	1.9	97.8	2.2
12月末	16,202	4.6	19,225.39	4.5	98.7	1.3
2021年1月末	16,275	5.0	19,307.10	5.0	97.6	2.3
2月末	16,741	8.0	19,856.75	8.0	97.4	2.5
3月末	17,626	13.7	20,913.30	13.7	96.3	3.5
4月末	17,114	10.4	20,297.99	10.4	96.5	3.4
5月末	17,408	12.3	20,648.99	12.3	95.3	4.5
6月末	17,549	13.2	20,821.61	13.2	97.8	2.1
7月末	17,098	10.3	20,287.57	10.3	97.3	2.6
8月末	17,696	14.2	21,005.77	14.2	97.7	2.2
9月末	18,481	19.3	21,942.86	19.3	98.7	1.3
10月末	18,220	17.6	21,629.06	17.6	97.8	2.2
(期末) 2021年11月19日	18,650	20.4	22,139.45	20.4	97.9	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第8期首	15,496円
第8期末	18,650円
騰落率	20.4%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、JPX日経インデックス400（配当込み）です。

(注2) ベンチマークは、2020年11月19日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 2020年11月の米国大統領選挙と、その後の議会選挙で共に民主党が勝利し大規模財政支出が確実なものとなったことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が早期に始まることなどを好感したこと（2020年11月～2021年1月）
- ② 菅首相が自民党総裁選不出馬を表明したことから、政局の不透明感が払拭（ふっしょく）され次期政権への政策期待が高まったこと（2021年9月）

下落要因

- ① F R B（米連邦準備理事会）議長が金利上昇容認ともとれる発言をしたことや、新型コロナウイルス感染再拡大の国内景気への悪影響が懸念されたこと（2021年2月）
- ② 中国大手不動産会社の債務不履行懸念や、国内新政権の一部政策に対する疑問が広がったこと（2021年10月）

【投資環境】**＜国内株式市場＞**

当期は、期初から米国大統領選挙と、その後の議会選挙で共に民主党が勝利し大規模財政支出が確実なものとなったことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が早期に始まることなどを好感し、世界的に株式市場は上昇基調となりました。2021年2月にパウエルFRB（米連邦準備理事会）議長が金利上昇容認ともとれる発言をしたことや、新型コロナウイルス感染再拡大の国内景気への悪影響が懸念され、市場の頭を押さえる展開となりました。その後は、世界的なワクチン接種の進展と、景況感の改善への期待や新型コロナウイルス変異株の感染拡大への懸念などを材料に高値近辺での揉み合いに終始しました。9月に菅首相が自民党総裁選不出馬を表明したことから、政局の不透明感が払拭（ふっしょく）され次期政権への政策期待が高まり国内株式市場は堅調な展開となりました。しかし、中国大手不動産会社の債務不履行懸念や、国内新政権の一部政策に対する疑問が広がり下落に転じました。その後は、米国失業率の改善や新型コロナウイルスの経口治療薬開発に進展がみられるなどの好材料に米国株が上昇したのに連れて、国内株式市場もやや値を戻したところで期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

当ファンドは、JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標とし運用を行いました。運用につきましては、「マルチファクター・リスクモデル」を活用した最適化法によりポートフォリオを維持・管理しました。ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の属性の変化や設定・解約による資金流出入に対応し、ポートフォリオの見直しを随時行いました。期首より、株式の高位組入れを維持し、株式先物を利用することにより、設定や株式配当金等のキャッシュフローに迅速に対応し、株式組入比率を出来る限り100%に近づけ推移させました。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+20.4%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の騰落率（+20.4%）とほぼ連動した動きとなりました。

プラス要因

- ① 追加設定・一部解約と株式等の売買タイミングの違い
- ② 先物取引の影響

マイナス要因

- ① 売買手数料等

【今後の運用方針】

今後の運用にあたりましても、これまでの方針を踏襲し、「マルチファクター・リスクモデル」を活用し、最適化法によりJPX日経インデックス400（配当込み）と連動した投資成果を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 8 期 (2020年11月20日 ～2021年11月19日)		項 目 の 概 要
	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)	0.006% (0.001) (0.004)	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	1	0.006	

期中の平均基準価額は17,183円です。

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況 (2020年11月20日から2021年11月19日まで)

(1) 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
		195	462,480	335	888,591
		(27)	(-)		

(注1) 金額は受渡し代金です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

(注3) ()内は株式分割、予約権行使、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。

(2) 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
		1,102	1,180	18	18

■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	1,351,072千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,269,270千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.41

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■主要な売買銘柄 (2020年11月20日から2021年11月19日まで)

株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
富士フイルムホールディングス	3	26,436	8,812	NTTドコモ	11.9	46,092	3,873
武田薬品工業	3.2	11,815	3,692	ソニーグループ	2.9	30,433	10,494
三菱UFJフィナンシャル・グループ	24.3	11,258	463	キーエンス	0.5	28,792	57,584
日本郵船	1.3	11,141	8,570	東日本旅客鉄道	3.1	23,390	7,545
日本電信電話	4.3	10,881	2,530	任天堂	0.4	23,269	58,172
三菱商事	3	10,328	3,442	ソフトバンクグループ	3.3	22,780	6,903
SGホールディングス	3.1	9,256	2,986	キャノン	8.7	22,268	2,559
商船三井	1	8,240	8,240	三菱UFJフィナンシャル・グループ	35.5	20,976	590
キーエンス	0.1	5,716	57,160	イオン	6.6	19,504	2,955
ダイキン工業	0.2	5,399	26,995	日本製鉄	7.9	17,131	2,168

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 金額の単位未満は切捨てです。

■利害関係人との取引状況等 (2020年11月20日から2021年11月19日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細 (2021年11月19日現在)

(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(0.0%)			
日本水産	2.6	2.6	1,536
マルハニチロ	0.5	—	—
鉱業(0.2%)			
INPEX	9	8.3	7,992
建設業(2.4%)			
ミライト・ホールディングス	—	0.6	1,228
安藤・間	1.5	1.5	1,339
東急建設	1	1	685
コムシスホールディングス	0.8	0.9	2,444
東建コーポレーション	—	0.1	931
大成建設	1.7	1.4	5,012
大林組	5.6	5.1	4,656
清水建設	5.8	4.8	3,624
長谷工コーポレーション	2.2	1.5	2,187
鹿島建設	3.9	3.8	5,168
西松建設	0.4	0.3	1,075
三井住友建設	1.3	1.3	535
前田建設工業	0.8	—	—
戸田建設	2.6	1.5	1,080
熊谷組	0.3	0.3	826
大東建託	0.6	0.5	6,670
NIPPO	0.4	0.5	2,030
五洋建設	1.5	2.1	1,518
住友林業	1.5	1.2	2,958
大和ハウス工業	5.1	4.8	16,358
積水ハウス	5.7	5.6	13,431
関電工	—	0.4	344
エクシオグループ	0.9	0.9	2,312
九電工	0.4	0.4	1,416
インフロニア・ホールディングス	—	1.4	1,386
食料品(3.7%)			
森永製菓	0.3	0.4	1,564
江崎グリコ	0.4	—	—
カルビー	0.7	0.7	1,889
森永乳業	—	0.3	1,758
ヤクルト本社	1.2	1.2	6,900
明治ホールディングス	1.1	1.1	7,700
プリマハム	—	0.1	259
日本ハム	0.7	0.7	2,772
アサヒグループホールディングス	3.8	3.9	17,947
キリンホールディングス	7.4	6	11,220
サントリー食品インターナショナル	1.2	1.2	5,388

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤園	—	0.5	3,770
キッコーマン	1.2	1.2	11,268
味の素	3.6	3.6	12,600
キューピー	1	1	2,456
カゴメ	—	0.7	2,024
アリアケジャパン	0.1	0.1	676
ニチレイ	0.9	0.6	1,577
東洋水産	0.9	0.9	4,158
日清食品ホールディングス	0.7	0.7	6,013
日本たばこ産業	9.1	8.9	20,452
繊維製品(0.4%)			
帝人	1.5	1.5	2,134
東レ	11.5	11.5	8,223
ゴールドウイン	0.3	0.3	2,133
パルプ・紙(0.2%)			
王子ホールディングス	7.4	7.4	4,144
大王製紙	—	0.6	1,126
レンゴー	—	2.2	1,804
化学(7.8%)			
クラレ	2.2	2.6	2,652
旭化成	10.9	10.6	12,131
昭和電工	1.3	1.3	3,426
住友化学	13.2	11.5	6,555
日産化学	0.9	0.9	6,381
東ソー	2.4	2.4	4,243
トクヤマ	0.3	0.5	986
デンカ	0.7	0.6	2,124
信越化学工業	2.9	2.4	48,564
エア・ウォーター	1.6	1.6	2,833
日本酸素ホールディングス	1.7	1.3	3,442
三菱瓦斯化学	1.6	1.6	3,219
三井化学	1.6	1.5	5,055
JSR	1.5	—	—
三菱ケミカルホールディングス	10.3	10.1	9,592
ダイセル	2.3	2.3	1,911
積水化学工業	3.3	3.3	6,286
日本ゼオン	—	1.2	1,627
アイカ工業	0.4	0.4	1,356
宇部興産	0.9	0.9	1,819
ダイキョーニシカワ	0.7	—	—
日油	0.6	0.6	3,588
花王	4	3.6	22,413
日本ペイントホールディングス	1.4	6.1	7,936

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
関西ペイント	1.8	1.8	5,088
D I C	0.7	0.6	1,890
富士フィルムホールディングス	—	2.9	27,187
資生堂	3.4	3	22,260
ライオン	2.3	2	3,472
ファンケル	—	0.7	2,492
コーセー	0.3	0.3	4,377
ポーラ・オルビスホールディングス	0.5	0.7	1,522
小林製薬	0.5	0.5	4,705
日東電工	1.2	1	8,830
エフビコ	—	0.2	831
ニフコ	0.7	0.7	2,579
ユニ・チャーム	3.6	3.2	15,500
医薬品 (6.2%)			
協和キリン	1.8	1.9	6,308
武田薬品工業	10.8	11.9	38,401
アステラス製薬	14.7	13.9	26,729
大日本住友製薬	1.3	1.3	1,908
塩野義製薬	2.2	2.1	16,522
日本新薬	0.4	0.5	4,310
中外製薬	5.3	5.2	21,382
科研製薬	0.3	0.3	1,276
エーザイ	2	1.9	13,752
ロート製薬	—	0.9	3,028
小野薬品工業	4	3.7	9,029
久光製薬	0.4	—	—
参天製薬	2.9	2.8	4,354
J C R ファーマ	—	0.6	1,573
東和薬品	—	0.4	1,101
沢井製薬	0.3	—	—
第一三共	14.6	12.7	38,036
大塚ホールディングス	3.6	3.5	14,406
ペプチドリーム	0.9	0.7	1,893
サワイグループホールディングス	—	0.3	1,341
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	1.7	1.9	5,692
ENEOSホールディングス	25	24.1	10,473
コスモエネルギーホールディングス	0.5	0.5	1,143
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	0.9	0.8	1,570
TOYO TIRE	—	0.5	979
ブリヂストン	4.6	4.8	23,553
住友ゴム工業	1.6	1.6	1,971
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	1.6	1.4	7,868
太平洋セメント	1.1	0.8	1,882

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東海カーボン	1.3	1.7	2,159
T O T O	1.2	1.2	6,480
日本碍子	2.2	1.8	3,598
日本特殊陶業	1.5	1.2	2,361
ニチアス	0.3	0.5	1,318
鉄鋼 (—%)			
日本製鉄	7.1	—	—
ジェイエフイーホールディングス	5	—	—
日立金属	1.7	—	—
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	0.2	—	—
三井金属鉱業	—	0.3	921
住友金属鉱山	2.1	2.2	9,730
DOWAホールディングス	0.5	—	—
古河電気工業	0.5	—	—
住友電気工業	5.9	5.6	9,074
アサヒホールディングス	—	0.6	1,225
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	2.3	2.4	6,060
三和ホールディングス	1.7	1.7	2,245
リンナイ	0.3	0.3	3,669
東プレ	0.1	—	—
機械 (6.1%)			
日本製鋼所	—	0.5	1,592
三浦工業	—	0.7	3,013
アマダ	2.4	2.4	2,767
F U J I	—	0.7	1,937
オーエスジー	1	0.6	1,139
DMG森精機	1	0.8	1,559
ディスコ	0.2	0.2	6,740
オプトラン	—	0.4	954
ナブテスコ	1.1	0.9	3,253
三井海洋開発	0.3	—	—
SMC	0.5	0.5	38,560
小松製作所	7.5	7.4	21,593
住友重機械工業	1.1	0.8	2,168
日立建機	0.8	0.7	2,611
ハモニック・ドライブ・システムズ	0.4	—	—
クボタ	8.8	8.1	20,124
荏原製作所	—	0.7	4,529
ダイキン工業	2.2	2.1	52,426
ダイフク	0.9	0.9	9,072
竹内製作所	0.3	0.3	890
T P R	0.3	—	—
ホシザキ	—	0.5	4,440
日本精工	2.7	3.2	2,480

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジェイテクト	1.7	—	—
THK	0.9	—	—
マキタ	2.3	2	10,558
三菱重工業	3	2.4	6,836
IHI	1.2	0.9	2,306
電気機器 (19.7%)			
コニカミノルタ	4.4	—	—
ブラザー工業	2.3	1.9	3,999
ミネベアミツミ	3.3	2.8	9,002
日立製作所	8.1	7.5	54,667
三菱電機	16.7	16.6	25,281
富士電機	0.9	1	6,080
安川電機	1.8	1.8	9,522
東芝テック	0.2	—	—
日本電産	4.1	4	53,840
日新電機	0.6	—	—
オムロン	1.5	1.4	16,002
MC J	—	0.5	563
日本電気	2.1	2.1	11,088
富士通	1.6	1.5	30,907
ルネサスエレクトロニクス	7.6	9.3	14,517
セイコーエプソン	1.8	2.1	4,036
ワコム	—	1.9	1,710
アルバック	0.3	0.3	2,094
エレコム	0.2	0.1	147
パナソニック	18.9	17.5	24,211
アンリツ	—	0.8	1,536
富士通ゼネラル	0.4	—	—
ソニーグループ	7.2	4.4	63,118
TDK	0.8	2.4	11,556
アルプスアルパイン	1.6	—	—
ヒロセ電機	0.3	—	—
横河電機	1.6	1.6	3,656
アズビル	1.1	0.8	4,336
日本光電工業	0.6	0.8	2,804
堀場製作所	0.3	0.3	2,190
アドバンテクト	1.3	1.2	12,516
キーエンス	1.2	0.8	59,712
シスメックス	1.2	1.4	20,531
OBARA GROUP	0.1	—	—
レーザーテック	0.7	0.7	22,372
スタンレー電気	1.1	1.1	3,630
カシオ計算機	1.3	1.1	1,765
ファナック	1.6	1.4	32,697
浜松ホトニクス	1.3	1.2	8,808
京セラ	2.4	2.3	16,403

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太陽誘電	0.8	0.7	4,809
村田製作所	5	4.8	42,964
小糸製作所	1	0.9	6,588
SCREENホールディングス	0.3	0.3	3,642
キヤノン	8.7	—	—
東京エレクトロン	1.1	1	62,820
輸送用機器 (6.6%)			
トヨタ紡織	0.5	0.5	1,191
豊田自動織機	1.4	1.3	13,234
デンソー	3.8	3.6	32,511
川崎重工業	1.4	—	—
いすゞ自動車	5.1	5.1	8,476
トヨタ自動車	6.5	24.5	52,246
日野自動車	2	1.6	1,696
アイシン	1.3	1.1	5,032
マツダ	4.4	—	—
本田技研工業	13.3	12.9	42,879
スズキ	3.4	3.7	19,728
SUBARU	5.4	4.7	10,847
ヤマハ発動機	2.2	2	6,080
豊田合成	0.6	0.6	1,477
シマノ	0.6	0.7	23,093
テイ・エス テック	0.4	0.8	1,162
精密機器 (3.7%)			
テルモ	4.9	4.6	23,064
島津製作所	1.9	2	9,780
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	372
東京精密	0.3	0.3	1,542
ニコン	2	—	—
オリンパス	9.6	8.7	22,894
HOYA	3.4	3.2	60,688
朝日インテック	1.8	1.9	5,397
その他製品 (1.8%)			
パンダイナムコホールディングス	1.8	1.4	12,976
パイロットコーポレーション	0.2	0.4	1,676
タカラトミー	0.5	—	—
ヤマハ	1	1	6,420
ビジョン	1.1	0.9	2,167
任天堂	1	0.7	36,358
電気・ガス業 (1.1%)			
中部電力	5	5	5,840
関西電力	6.8	6.8	6,990
中国電力	—	2.5	2,210
東北電力	3.8	3.1	2,343
九州電力	3.7	3.2	2,604
北海道電力	—	1.6	753

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電源開発	1.2	1.2	1,726
イーレックス	—	0.4	1,081
レノバ	—	0.2	1,096
東京瓦斯	3.2	3.2	6,262
大阪瓦斯	3.5	3.1	5,645
陸運業(1.7%)			
東武鉄道	1.7	—	—
相鉄ホールディングス	0.8	—	—
東急	4.1	—	—
小田急電鉄	2.5	—	—
京王電鉄	0.9	—	—
京成電鉄	1.3	—	—
東日本旅客鉄道	3	—	—
西日本旅客鉄道	1.6	—	—
東海旅客鉄道	1.4	1.4	23,457
西武ホールディングス	2.2	—	—
近鉄グループホールディングス	1.6	—	—
阪急阪神ホールディングス	2.1	2.1	7,371
京阪ホールディングス	0.9	—	—
名古屋鉄道	1.9	—	—
日本通運	0.6	0.5	3,415
ヤマトホールディングス	2.7	2	5,240
山九	0.4	0.4	1,874
センコーグループホールディングス	—	0.4	376
日立物流	0.2	0.4	1,824
丸和運輸機関	—	0.6	889
九州旅客鉄道	—	1.2	3,098
S Gホールディングス	—	3.1	8,224
海運業(0.5%)			
日本郵船	—	1.3	9,464
商船三井	—	0.9	5,661
空運業(—%)			
日本航空	2.6	—	—
ANAホールディングス	3.1	—	—
倉庫・運輸関連業(0.0%)			
近鉄エクスプレス	—	0.1	277
情報・通信業(7.8%)			
NECネットエスアイ	—	0.5	964
システナ	—	0.5	1,039
日鉄ソリューションズ	0.3	0.3	1,063
T I S	1.5	1.5	5,220
コーエーテクモホールディングス	—	0.5	2,560
ネクソン	4.2	3.9	9,925
コロプラ	0.5	—	—
ティーガイア	0.1	0.1	177
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.5	0.3	856

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
GMOペイメントゲートウェイ	0.4	0.3	4,848
ラクス	—	0.6	2,079
アカツキ	0.1	0.2	599
野村総合研究所	2.2	3.1	15,484
インフォコム	—	0.1	208
オービック	0.6	0.5	10,810
ジャストシステム	—	0.2	1,142
Zホールディングス	23.5	23.4	19,316
トレンドマイクロ	0.9	0.9	6,102
日本オラクル	0.3	0.3	3,225
伊藤忠テクノソリューションズ	0.8	0.7	2,632
大塚商会	0.8	0.9	4,914
電通国際情報サービス	—	0.3	1,159
東映アニメーション	—	0.1	1,741
デジタルガレージ	0.3	0.3	1,584
日本ユニシス	0.4	0.5	1,745
日本テレビホールディングス	1	—	—
USEN-NEXT HOLDINGS	—	0.1	349
日本電信電話	16.8	16.3	51,899
KDD I	12.2	11.7	39,897
光通信	0.2	0.2	3,720
NTTドコモ	11.9	—	—
東宝	1	1	5,300
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	4.4	11,140
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.7	0.7	4,592
カプコン	0.8	1.5	4,590
S C S K	0.4	1.2	2,658
コナミホールディングス	0.6	0.6	3,768
ソフトバンクグループ	8	4.7	32,223
卸売業(5.7%)			
双日	7.2	1.5	2,529
アルフレッサ ホールディングス	1.9	1.5	2,382
神戸物産	1.2	1.2	5,358
ダイワボウホールディングス	0.1	0.6	1,199
TOKAIホールディングス	0.9	1.3	1,140
シップヘルスケアホールディングス	0.3	0.7	1,881
コマダホールディングス	0.1	0.6	1,210
第一興商	0.4	—	—
メディパルホールディングス	1.9	1.6	3,246
日本ライフライン	0.2	0.9	1,030
伊藤忠商事	11.8	11.1	37,584
丸紅	17.2	15.9	16,448
豊田通商	1.8	1.6	8,752
兼松	0.6	0.6	775
三井物産	14.5	12.7	34,270
住友商事	10.8	10.2	17,018

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱商事	10.9	11.9	41,554
岩谷産業	0.4	0.4	2,496
PAL TAC	0.3	0.3	1,449
日鉄物産	0.2	0.1	482
ミスミグループ本社	2.2	2	10,260
小売業 (3.9%)			
ローソン	0.5	0.4	2,296
エービーシー・マート	0.3	0.3	1,668
日本マクドナルドホールディングス	0.7	0.7	3,598
セリア	0.5	0.3	1,059
ビックカメラ	1.3	1.3	1,297
Monotaro	1.2	2	4,722
J. フロント リテイリング	2.3	—	—
マツキヨココカラ&カンパニー	0.6	0.7	3,251
ZOZO	1.1	1	3,805
ヴェルシアホールディングス	1.1	0.8	3,376
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.3	1,017
すかいらくホールディングス	2.1	—	—
コスモス薬品	0.1	0.2	3,810
セブン&アイ・ホールディングス	6.5	6.3	30,372
ツルハホールディングス	0.4	0.4	5,588
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.2	1,492
FOOD & LIFE COMPANIE	—	0.9	4,716
ノジマ	0.1	0.1	227
良品計画	2.2	1.8	3,630
コーナン商事	—	0.3	1,065
パン・パシフィック・インターナショナルホ	3.6	3.5	7,693
ゼンショーホールディングス	0.9	0.8	2,140
ワークマン	0.2	0.2	1,224
ユナイテッドアローズ	0.3	—	—
スギホールディングス	0.4	0.3	2,280
ライフコーポレーション	—	0.1	356
しまむら	0.2	—	—
丸井グループ	1.7	1.6	3,660
イオン	6.3	—	—
イズミ	0.3	0.3	1,038
ヤオコー	0.2	0.2	1,410
ケーズホールディングス	1.5	1.5	1,816
アインホールディングス	0.2	0.2	1,206
ニトリホールディングス	0.7	0.6	12,378
ファーストリテイリング	0.2	0.2	14,754
サンドラッグ	0.7	0.7	2,201
銀行業 (4.7%)			
めぶきフィナンシャルグループ	10.2	8	1,840
コンソルディア・フィナンシャルグループ	9.9	9.9	4,346
新生銀行	0.9	1.3	2,382

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
あおぞら銀行	1.1	1.1	2,832
三菱UFJフィナンシャル・グループ	84.3	73.1	46,579
りそなホールディングス	17.5	17.2	7,342
三井住友トラスト・ホールディングス	3	3.1	11,240
三井住友フィナンシャルグループ	11.3	11.2	43,534
千葉銀行	5	5	3,375
ふくおかフィナンシャルグループ	—	1.4	2,720
セブン銀行	7	7.5	1,747
みずほフィナンシャルグループ	23	20.2	29,461
証券・商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	0.4	0.4	231
GMOフィナンシャルホールディングス	—	0.9	790
SBIホールディングス	2	2	5,870
ジャフコ グループ	—	0.2	1,492
大和証券グループ本社	12.4	11.2	7,144
野村ホールディングス	29.5	24.5	11,995
松井証券	1.3	—	—
保険業 (2.5%)			
SOMPOホールディングス	3.2	2.8	13,608
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	4.4	3.5	12,414
第一生命ホールディングス	9.7	8.1	18,763
東京海上ホールディングス	5.9	5.4	31,914
T&Dホールディングス	4.6	3.8	5,373
その他金融業 (1.4%)			
全国保証	0.5	0.4	2,056
芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,548
みずほリース	—	0.1	314
東京センチュリー	0.3	0.4	2,336
イオンフィナンシャルサービス	1.1	1.1	1,479
アコム	—	3.4	1,234
オリエントコーポレーション	3.5	7.8	1,037
オリックス	10.1	9.9	23,195
三菱HCキャピタル	4.8	4.8	2,664
日本取引所グループ	4.9	4.3	10,421
不動産業 (2.2%)			
いちご	3.2	0.5	156
ヒューリック	3.7	3.7	4,147
野村不動産ホールディングス	1.2	1	2,677
サムティ	—	0.4	1,010
プレサンスコーポレーション	0.1	0.1	171
オープンハウス	0.6	0.5	3,510
東急不動産ホールディングス	5.4	4.4	2,846
飯田グループホールディングス	1.2	1.3	3,295
パーク24	0.7	—	—
三井不動産	8.1	7.4	18,799
三菱地所	11.5	10.3	17,041

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京建物	1.8	1.9	3,173
住友不動産	3.8	3.4	13,205
スターツコーポレーション	0.1	0.3	795
日本エスコ	—	0.7	575
イオンモール	1	0.7	1,198
カチタス	—	0.3	1,411
日本空港ビルデング	0.5	—	—
サービス業(5.8%)			
ミクシイ	0.5	0.5	1,141
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	—	—
日本M&Aセンターホールディングス	1.3	2.6	9,620
UTグループ	0.3	0.1	447
エス・エム・エス	0.5	0.5	2,282
パーソルホールディングス	1.4	1.4	5,040
総合警備保障	0.7	0.6	3,084
カクコム	1.1	1.3	4,745
ディップ	0.2	0.2	933
ベネフィット・ワン	0.6	0.5	2,815
エムスリー	3.6	2.8	17,942
アウトソーシング	1	1	1,556
ディー・エヌ・エー	0.8	—	—
博報堂DYホールディングス	2.4	2.5	4,435
電通グループ	1.9	—	—
オリエンタルランド	1.7	1.8	34,614
リゾートトラスト	0.8	—	—
ユー・エス・エス	1.8	1.6	2,884
サイバーエージェント	1	—	—
楽天グループ	7.3	—	—
フルキャストホールディングス	—	0.3	882
エン・ジャパン	0.3	0.2	787
テクノプロ・ホールディングス	0.3	0.9	3,307

銘柄	期首 (前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.1	788	
ジャパンマテリアル	—	0.1	151	
リクルートホールディングス	11.6	9.4	71,374	
ベルシステム24ホールディングス	—	0.3	420	
ペイカレント・コンサルティング	—	0.1	5,310	
ジャパエレベーターサービスホールディングス	—	0.3	684	
リログループ	0.9	0.9	2,161	
カナモト	0.3	0.3	715	
セコム	1.7	1.6	12,734	
メイテック	0.2	0.2	1,404	
イオンディライト	—	0.1	372	
合計	株数・金額	1,212	1,099	3,327,007
	銘柄数<比率>	395	400	<97.9%>

(注1) 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です。

(注2) 合計欄の< >内は、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です。ただし、評価額が単位未満の場合は小数で記載しています。

(注4) —印は組入れなしです。以下同じ。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄	当期末	
		買建額	売建額
国内	JPX日経400	百万円	百万円
		70	—

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2021年11月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	3,327,007	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	82,459	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	3,409,466	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,409,466,184円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	50,188,846
株 式(評価額)	3,327,007,770
未 収 入 金	2,426,820
未 収 配 当 金	28,929,748
差 入 委 託 証 拠 金	913,000
(B) 負 債	10,107,130
未 払 解 約 金	10,107,000
未 払 利 息	130
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,399,359,054
元 本	1,822,713,178
次 期 繰 越 損 益 金	1,576,645,876
(D) 受 益 権 総 口 数	1,822,713,178口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,650円

(注記事項)

期首元本額	2,153,042,811円
期中追加設定元本額	181,018,561円
期中一部解約元本額	511,348,194円

(当期末元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	1,822,713,178円
------------------	----------------

■損益の状況

当期 (自2020年11月20日 至2021年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	71,592,753円
受 取 配 当 金	71,638,104
そ の 他 収 益 金	15,601
支 払 利 息	△ 60,952
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	549,405,565
売 買 益	665,267,577
売 買 損	△ 115,862,012
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	17,109,600
取 引 益	23,124,160
取 引 損	△ 6,014,560
(D) そ の 他 費 用 等	△ 284
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	638,107,634
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,183,331,609
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	128,699,439
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 373,492,806
(I) 計 (E+F+G+H)	1,576,645,876
次 期 繰 越 損 益 金(I)	1,576,645,876

(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) (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。

(注3) (H)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。