

## ■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9期（決算日 2022年11月21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

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

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/>

&lt; 2613432・2634231 &gt;

## ■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
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
9期(2022年11月21日)	17,435	0	△1.6	21,945.43	△0.9	97.7	2.2	3,278

(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) ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。)およ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、JPX総研および日経は、「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。

「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総研、株式会社日本取引所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総研および日経は、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総研および日経は、「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総研および日経は、「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。

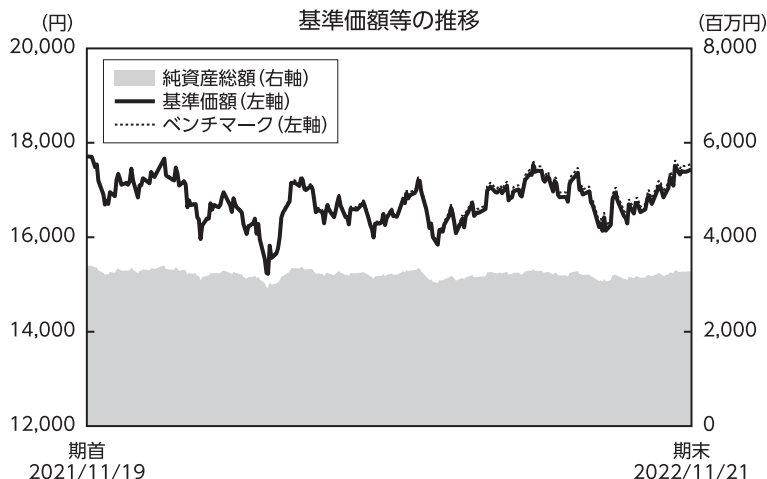
## ■当期中の基準価額と市況等の推移

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	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2021年11月19日	17,712	—	22,139.45	—	97.8	2.1
11月末	16,693	△5.8	20,881.36	△5.7	97.9	2.0
12月末	17,276	△2.5	21,618.03	△2.4	97.2	2.6
2022年1月末	16,400	△7.4	20,533.68	△7.3	96.4	3.4
2月末	16,291	△8.0	20,404.36	△7.8	96.5	3.4
3月末	17,026	△3.9	21,340.09	△3.6	96.8	3.0
4月末	16,600	△6.3	20,812.33	△6.0	97.7	2.2
5月末	16,723	△5.6	20,980.72	△5.2	96.8	3.1
6月末	16,315	△7.9	20,480.70	△7.5	98.4	1.5
7月末	16,932	△4.4	21,275.60	△3.9	98.0	1.9
8月末	17,138	△3.2	21,545.34	△2.7	98.1	1.8
9月末	16,139	△8.9	20,301.49	△8.3	96.7	3.2
10月末	16,965	△4.2	21,355.66	△3.5	96.7	3.1
(期末)						
2022年11月21日	17,435	△1.6	21,945.43	△0.9	97.7	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

## 【基準価額等の推移】

第9期首	17,712円
第9期末	17,435円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△1.6%



(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、2021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】

## 下落要因

- ① ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が悪材料となったこと（2022年2～3月上旬）
- ② 米国における金融引き締めへの警戒感やウクライナ情勢の悪化が嫌気されたこと（2022年6月）
- ③ F R B（米連邦準備理事会）議長が金利引き上げに積極的な姿勢を示したことや、その後に発表された物価指標でインフレ懸念が高まったこと（2022年9月）

## 上昇要因

- ① 原油価格の上昇が一服したことで過度なインフレ懸念が後退し、世界的に株式市場が急反発したこと（2022年3月下旬）
- ② 米国における景気鈍化観測を背景にした金利低下が好感されたこと（2022年7～8月）
- ③ 米国での利上げペースが緩やかになるとの期待と企業の決算内容が好感されたこと（2022年10～11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-1.6%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（-0.9%）を0.7%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 9 期 (2021年11月20日 ～2022年11月21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 )	111円 ( 50 ) ( 55 )  ( 6 )	0.664% (0.299) (0.332)  (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种書類の送付、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 ) ( 0 )	0.003 (0.000) (0.003)	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 )	9 ( 2 ) ( 4 ) ( 4 )	0.057 (0.011) (0.024) (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	0.724	
期中の平均基準価額は16,708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。

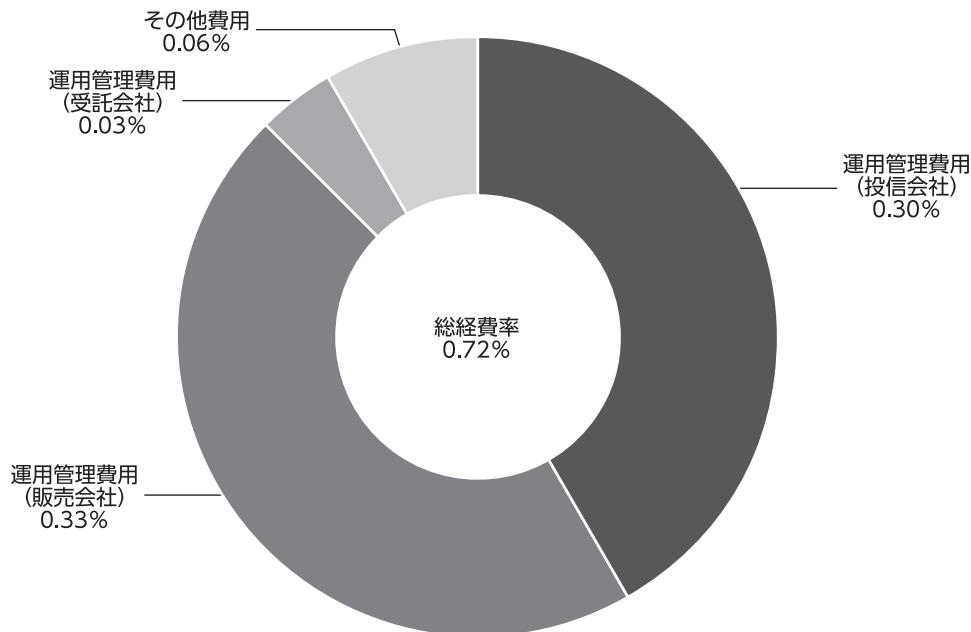
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.72%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（2021年11月20日から2022年11月21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	120,315	210,536	170,603	303,454

(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	693,521千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,128,358千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.22

(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（2021年11月20日から2022年11月21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（2022年11月21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	1,822,713	1,772,425	3,277,392

(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1,772,425千口です。

## ■投資信託財産の構成 (2022年11月21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	3,277,392	99.5
コール・ローン等、その他	15,031	0.5
投資信託財産総額	3,292,423	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

(2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,292,423,896円
コール・ローン等	13,694,581
アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド(評価額)	3,277,392,315
未 収 入 金	1,337,000
(B) 負 債	13,467,206
未 払 解 約 金	1,438,870
未 払 信 託 報 酬	10,768,040
未 払 利 息	27
そ の 他 未 払 費 用	1,260,269
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,278,956,690
元 本	1,880,677,023
次 期 繰 越 損 益 金	1,398,279,667
(D) 受 益 権 総 口 数	1,880,677,023口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,435円

(注記事項)

期首元本額	1,919,655,347円
期中追加設定元本額	180,579,321円
期中一部解約元本額	219,557,645円

## ■損益の状況

当期(自2021年11月20日 至2022年11月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 6,244円
支 払 利 息	△ 6,244
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 10,257,283
売 買 損 益	16,418,291
売 買 損	△ 26,675,574
(C) 信 託 報 酬 等	△ 23,206,467
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 33,469,994
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	823,176,228
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	608,573,433
(配 当 等 相 当 額)	( 634,632,097)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 26,058,664)
(G) 計 (D+E+F)	1,398,279,667
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,398,279,667
追 加 信 託 差 損 益 金	608,573,433
(配 当 等 相 当 額)	( 635,801,874)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 27,228,441)
分 配 準 備 積 立 金	883,853,293
繰 越 損 益 金	△ 94,147,059

(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9期
	(2021年11月20日～2022年11月21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	8,080

(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9期》

決算日：2022年11月21日

(計算期間：2021年11月20日～2022年11月21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
	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率	(ベンチマーク)			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
9期(2022年11月21日)	18,491	△ 0.9	21,945.43	△ 0.9	97.7	2.2	3,277

(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) ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。)およ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、JPX総研および日経は、「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。

「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総研、株式会社日本取引所グループおよび日経に帰属します。

- ・「リソナ・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総研および日経は、その運用および「リソナ・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総研および日経は、「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総研および日経は、「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。

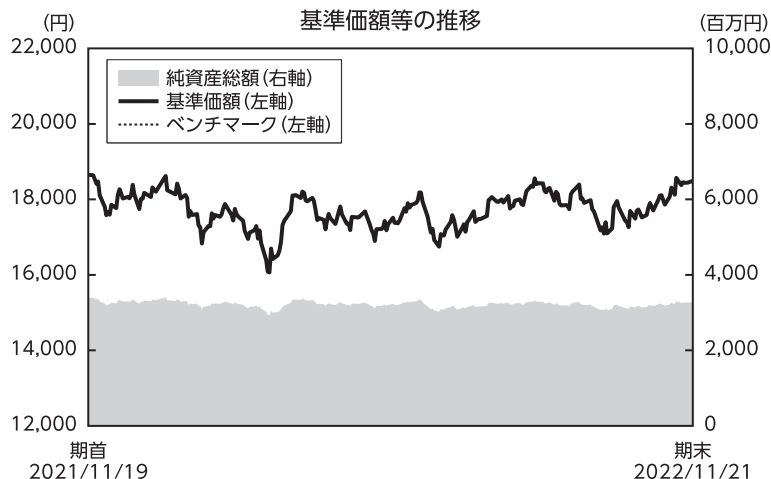
■当期中の基準価額と市況等の推移

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	(ベンチマーク)		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2021年11月19日	18,650	—	22,139.45	—	97.9	2.1
11月末	17,581	△5.7	20,881.36	△5.7	97.9	2.0
12月末	18,205	△2.4	21,618.03	△2.4	97.2	2.6
2022年1月末	17,293	△7.3	20,533.68	△7.3	96.4	3.4
2月末	17,187	△7.8	20,404.36	△7.8	96.5	3.4
3月末	17,974	△3.6	21,340.09	△3.6	96.9	3.0
4月末	17,534	△6.0	20,812.33	△6.0	97.7	2.2
5月末	17,675	△5.2	20,980.72	△5.2	96.8	3.1
6月末	17,254	△7.5	20,480.70	△7.5	98.5	1.5
7月末	17,917	△3.9	21,275.60	△3.9	98.0	1.9
8月末	18,147	△2.7	21,545.34	△2.7	98.1	1.8
9月末	17,099	△8.3	20,301.49	△8.3	96.7	3.2
10月末	17,985	△3.6	21,355.66	△3.5	96.7	3.1
(期末)						
2022年11月21日	18,491	△0.9	21,945.43	△0.9	97.7	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第9期首	18,650円
第9期末	18,491円
騰落率	△0.9%



(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標準とする指数）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、2021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】

下落要因

- ① ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が悪材料となったこと（2022年2～3月上旬）
- ② 米国における金融引き締めへの警戒感やウクライナ情勢の悪化が嫌気されたこと（2022年6月）
- ③ F R B（米連邦準備理事会）議長が金利引き上げに積極的な姿勢を示したことや、その後に発表された物価指標でインフレ懸念が高まったこと（2022年9月）

上昇要因

- ① 原油価格の上昇が一服したことで過度なインフレ懸念が後退し、世界的に株式市場が急反発したこと（2022年3月下旬）
- ② 米国における景気鈍化観測を背景にした金利低下が好感されたこと（2022年7～8月）
- ③ 米国での利上げペースが緩やかになるとの期待と企業の決算内容が好感されたこと（2022年10～11月）

**【投資環境】****＜国内株式市場＞**

当期の国内株式市場は下落しました。2021年秋から年末にかけ、好材料と悪材料の綱引きでレンジ内でのみみ合いを続けた国内株式市場は、年が明けて2022年になるとFOMC（米連邦公開市場委員会）で、3月の利上げが示唆されるなど予想以上にタカ派的な姿勢が確認されたことを嫌気して下落しました。さらに2月末のロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受け一段安となりました。しかし、原油価格の上昇が一服すると過度に織り込まれていたインフレ懸念が後退し、世界的に株式市場が急反発したなかで日本株も同様に急反発しました。その後は、米国のインフレ動向、金融政策の見通しや長期金利の動きを睨み、広めのレンジ内でもみ合いましたが、米国での連続利上げにより景気が鈍化するとの懸念から米国金利が低下すると米国株が上昇に転じ、日本株もそれに連れて下値を切り上げる展開となりました。その勢いも8月末のジャクソンホール会議においてパウエルFRB（米連邦準備理事会）議長が強い金融引き締め策の維持を明言したことから世界的に株式市場は急落しました。9月に入り米国での高い物価の伸びが確認されると、さらに強いタカ派姿勢の維持を明言したことから下落に拍車が掛かり、日本株も同様に大きく値を下げました。10月に発表された米国消費者物価指数の伸びがわずかに鈍化したことから利上げペースが緩やかになるとの期待が広がり世界的に株式市場が上昇すると、好決算企業への買いにも支えられ、国内株式市場は強い地合いを保ち下落幅を縮小して期末を迎えました。

**【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-0.9%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（-0.9%）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、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 9 期 (2021年11月20日 ～2022年11月21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) (0)	0.003% (0.000) (0.003)	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	0.003	

期中の平均基準価額は17,654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 (2021年11月20日から2022年11月21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
		131 ( 21)	341,350 ( - )	128	352,170

(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
		652	649	-	-

■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	693,521千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,128,358千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.22

(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 (2021年11月20日から2022年11月21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
ソフトバンク	25.9	39,769	1,535	オリエンタルランド	1.9	38,843	20,443
ソフトバンクグループ	4	22,270	5,567	日本電信電話	7.2	26,273	3,649
日本製鉄	7.2	16,027	2,226	KDDI	2.5	10,791	4,316
日本電信電話	3	11,487	3,829	日立製作所	1.5	10,234	6,823
キーエンス	0.2	10,638	53,190	三菱商事	2.2	9,131	4,150
リクルートホールディングス	2.2	9,749	4,431	三菱UFJフィナンシャル・グループ	12	8,704	725
JFEホールディングス	4.3	6,435	1,496	阪急阪神ホールディングス	2.1	8,683	4,135
第一三共	1.6	6,251	3,907	トヨタ自動車	3.5	7,405	2,115
任天堂	0.1	6,131	61,316	ソニーグループ	0.6	6,795	11,325
東京エレクトロン	0.1	5,676	56,760	ソフトバンクグループ	1.1	6,628	6,026

(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 (2021年11月20日から2022年11月21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 (2022年11月21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
<b>水産・農林業(0.0%)</b>			
日本水産	2.6	2.6	1,344
<b>鉱業(0.4%)</b>			
INPEX	8.3	8	12,048
<b>建設業(2.1%)</b>			
ウエストホールディングス	—	0.2	916
ショーボンドホールディングス	—	0.3	1,821
ミライト・ワン	0.6	0.6	910
安藤・間	1.5	0.8	688
東急建設	1	—	—
コムシスホールディングス	0.9	0.9	2,240
東建コーポレーション	0.1	—	—
大成建設	1.4	1.4	5,628
大林組	5.1	5.1	5,135
清水建設	4.8	4.8	3,494
長谷工コーポレーション	1.5	1.5	2,257
鹿島建設	3.8	3.8	5,787
西松建設	0.3	0.3	1,138
三井住友建設	1.3	—	—
戸田建設	1.5	1.5	1,057
熊谷組	0.3	0.3	749
大東建託	0.5	—	—
NIPPON	0.5	—	—
五洋建設	2.1	2.1	1,362
住友林業	1.2	1.2	2,798
大和ハウス工業	4.8	4.3	13,588
積水ハウス	5.6	4.8	12,007
関電工	0.4	0.4	352
エクシオグループ	0.9	0.9	1,896
九電工	0.4	0.4	1,316
インフロンア・ホールディングス	1.4	2.1	2,194
<b>食料品(3.9%)</b>			
森永製菓	0.4	0.4	1,482
カルビー	0.7	0.7	2,013
森永乳業	0.3	0.3	1,326
ヤクルト本社	1.2	1.1	9,130
明治ホールディングス	1.1	0.9	6,012
プリマハム	0.1	0.1	205
日本ハム	0.7	0.7	2,600
アサヒグループホールディングス	3.9	3.5	15,064

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	6	6.9	15,069
宝ホールディングス	—	1	1,052
サントリー食品インターナショナル	1.2	1	4,635
伊藤園	0.5	—	—
キッコーマン	1.2	1	7,700
味の素	3.6	3.8	16,039
キューピー	1	0.7	1,740
カゴメ	0.7	0.7	2,128
アリアケジャパン	0.1	—	—
ニチレイ	0.6	0.6	1,667
東洋水産	0.9	0.7	3,927
日清食品ホールディングス	0.7	0.6	6,282
日本たばこ産業	8.9	10	27,950
<b>繊維製品(0.4%)</b>			
帝人	1.5	1.5	1,938
東レ	11.5	10.6	7,818
ゴールドウイン	0.3	0.3	2,850
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
王子ホールディングス	7.4	7.4	3,914
大王製紙	0.6	0.6	655
レンゴー	2.2	1.3	1,157
<b>化学(7.1%)</b>			
クラレ	2.6	2.6	2,797
旭化成	10.6	9.7	9,850
昭和電工	1.3	—	—
住友化学	11.5	11.5	5,658
日産化学	0.9	0.7	4,599
東ソー	2.4	2	3,220
トクヤマ	0.5	0.5	919
デンカ	0.6	0.6	1,992
信越化学工業	2.4	2.7	47,115
エア・ウォーター	1.6	1.6	2,561
日本酸素ホールディングス	1.3	1.3	2,973
三菱瓦斯化学	1.6	1.2	2,330
三井化学	1.5	1.3	4,023
三菱ケミカルグループ	10.1	10.8	7,765
KHネオケム	—	0.3	851
ダイセル	2.3	2.3	2,260
積水化学工業	3.3	3.3	6,349
日本ゼオン	1.2	1.2	1,629



銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイカ工業	0.4	0.4	1,308
UBE	0.9	0.9	1,806
日油	0.6	0.5	2,810
花王	3.6	3.8	21,014
日本ペイントホールディングス	6.1	6.9	7,541
関西ペイント	1.8	1.5	2,817
DIC	0.6	—	—
富士フイルムホールディングス	2.9	3	22,005
資生堂	3	3.2	18,508
ライオン	2	2	2,950
ファンケル	0.7	0.7	1,854
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	0.7	—	—
小林製薬	0.5	0.4	3,456
タカラバイオ	—	0.5	905
デクセリアルズ	—	0.3	985
日東電工	1	1.1	9,504
エフピコ	0.2	0.2	759
ニフコ	0.7	0.7	2,534
ユニ・チャーム	3.2	3.1	15,772
<b>医薬品(7.4%)</b>			
協和キリン	1.9	1.7	5,559
武田薬品工業	11.9	11.8	46,704
アステラス製薬	13.9	15.1	31,777
住友ファーマ	1.3	1.3	1,394
塩野義製薬	2.1	2	13,956
日本新薬	0.5	0.4	3,408
中外製薬	5.2	4.9	17,208
科研製薬	0.3	0.3	1,183
エーザイ	1.9	1.9	16,991
ロート製薬	0.9	0.7	3,027
小野薬品工業	3.7	3	10,515
参天製薬	2.8	2.8	3,141
JCRファーマ	0.6	0.6	1,173
東和薬品	0.4	0.2	418
第一三共	12.7	13.5	62,302
大塚ホールディングス	3.5	3.6	16,747
ペプチドリーム	0.7	0.7	1,265
サワイグループホールディングス	0.3	—	—
<b>石油・石炭製品(0.7%)</b>			
出光興産	1.9	1.9	5,985
ENEOSホールディングス	24.1	28	12,978
コスモエネルギーホールディングス	0.5	0.7	2,702

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>ゴム製品(1.0%)</b>			
横浜ゴム	0.8	0.8	1,709
TOYO TIRE	0.5	0.9	1,379
ブリヂストン	4.8	5	26,415
住友ゴム工業	1.6	1.6	1,844
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>			
AGC	1.4	1.5	6,825
太平洋セメント	0.8	0.8	1,681
東海カーボン	1.7	1.1	1,163
TOTO	1.2	1	4,705
日本碍子	1.8	1.8	3,157
日本特殊陶業	1.2	1.2	3,184
MARUWA	—	0.1	1,836
ニチアス	0.5	0.5	1,209
<b>鉄鋼(0.7%)</b>			
日本製鉄	—	7.2	16,041
JFEホールディングス	—	4.3	6,424
東京製鐵	—	0.5	690
<b>非鉄金属(0.7%)</b>			
三井金属鉱業	0.3	0.3	942
住友金属鉱山	2.2	1.9	8,629
DOWAホールディングス	—	0.4	1,782
住友電気工業	5.6	5.7	9,185
アサヒホールディングス	0.6	0.6	1,205
<b>金属製品(0.3%)</b>			
SUMCO	2.4	2.8	5,770
三和ホールディングス	1.7	1.7	2,153
リンナイ	0.3	0.3	3,051
<b>機械(5.7%)</b>			
日本製鋼所	0.5	—	—
三浦工業	0.7	0.7	2,334
アマダ	2.4	2.4	2,661
FUJ I	0.7	0.7	1,466
オーエスジー	0.6	—	—
DMG森精機	0.8	0.8	1,474
ディスコ	0.2	0.3	12,150
オプトラン	0.4	0.1	262
ナブテスコ	0.9	0.9	2,997
SMC	0.5	0.5	32,120
小松製作所	7.4	7.3	22,615
住友重機械工業	0.8	0.8	2,288
日立建機	0.7	0.7	2,166
ローツェ	—	0.1	853

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クボタ	8.1	8.3	17,056
荏原製作所	0.7	0.6	3,018
ダイキン工業	2.1	1.9	42,902
ダイフク	0.9	0.8	5,656
竹内製作所	0.3	0.3	915
ホシザキ	0.5	1	4,605
日本精工	3.2	—	—
マキタ	2	2.1	6,405
三菱重工業	2.4	2.7	14,029
I H I	0.9	1.1	3,740
<b>電気機器 (17.4%)</b>			
イビデン	—	0.9	5,013
ブラザー工業	1.9	1.9	4,174
ミネベアミツミ	2.8	2.8	6,199
日立製作所	7.5	6.6	48,160
三菱電機	16.6	15.9	22,132
富士電機	1	1	5,870
安川電機	1.8	1.8	7,929
日本電産	4	3.8	32,984
オムロン	1.4	1.4	9,884
MC J	0.5	0.5	498
日本電気	2.1	2.1	10,216
富士通	1.5	1.6	29,648
ルネサスエレクトロニクス	9.3	9.8	13,568
セイコーエプソン	2.1	2.1	4,515
ワコム	1.9	1.9	1,238
アルバック	0.3	0.3	1,800
エレコム	0.1	0.5	747
パナソニック ホールディングス	17.5	18.1	22,833
シャープ	—	1.9	1,858
アンリツ	0.8	0.9	1,359
ソニーグループ	4.4	4.1	46,145
TDK	2.4	2.6	12,857
横河電機	1.6	1.6	3,996
アズビル	0.8	1.1	4,482
日本光電工業	0.8	0.8	2,584
堀場製作所	0.3	0.3	1,935
アドバンテス	1.2	1.3	11,856
キーエンス	0.8	1	58,760
シスメックス	1.4	1.3	10,990
フェローテックホールディングス	—	0.4	1,290
レーザーテック	0.7	0.8	20,108
スタンレー電気	1.1	—	—

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カシオ計算機	1.1	1.1	1,496
ファナック	1.4	1.5	30,772
浜松ホトニクス	1.2	1.2	8,628
新光電気工業	—	0.5	2,002
京セラ	2.3	2.4	16,845
太陽誘電	0.7	0.9	3,955
村田製作所	4.8	4.7	35,908
小糸製作所	0.9	1.8	4,014
SCREENホールディングス	0.3	0.3	2,691
東京エレクトロン	1	1	44,750
<b>輸送用機器 (5.8%)</b>			
トヨタ紡織	0.5	0.5	987
豊田自動織機	1.3	1.2	9,228
デンソー	3.6	3.2	24,332
いすゞ自動車	5.1	4.5	8,082
トヨタ自動車	24.5	23.2	46,469
日野自動車	1.6	—	—
アイシン	1.1	1.3	4,966
本田技研工業	12.9	12.6	42,184
スズキ	3.7	2.8	14,134
SUBARU	4.7	4.7	10,857
ヤマハ発動機	2	2.4	8,148
豊田合成	0.6	0.6	1,401
シマノ	0.7	0.6	13,824
テイ・エス テック	0.8	0.8	1,351
<b>精密機器 (3.4%)</b>			
テルモ	4.6	4.9	19,350
島津製作所	2	1.9	7,961
ブイ・テクノロジー	0.1	—	—
東京精密	0.3	0.3	1,326
オリンパス	8.7	9.7	26,510
HOYA	3.2	3.3	47,190
朝日インテック	1.9	1.9	4,755
<b>その他製品 (2.1%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	1.4	1.4	12,397
パイロットコーポレーション	0.4	0.2	989
ヤマハ	1	1	5,340
ビジョン	0.9	0.8	1,629
任天堂	0.7	7.7	45,329
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			
中部電力	5	5.7	7,199
関西電力	6.8	6.2	7,173
中国電力	2.5	—	—

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東北電力	3.1	—	—
九州電力	3.2	3.2	2,329
北海道電力	1.6	1.6	713
電源開発	1.2	1.2	2,487
イーレックス	0.4	0.4	974
レノバ	0.2	0.4	1,093
東京瓦斯	3.2	3.2	7,971
大阪瓦斯	3.1	3.1	6,460
<b>陸運業(1.2%)</b>			
東海旅客鉄道	1.4	1.2	19,638
阪急阪神ホールディングス	2.1	—	—
日本通運	0.5	—	—
ヤマトホールディングス	2	2	4,576
山九	0.4	0.4	1,954
センコーグループホールディングス	0.4	0.4	401
日立物流	0.4	0.3	2,670
AZ-COM丸和ホールディングス	0.6	0.6	888
九州旅客鉄道	1.2	—	—
S Gホールディングス	3.1	2.8	5,723
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	0.5	3,925
<b>海運業(0.7%)</b>			
日本郵船	1.3	4.2	11,520
商船三井	0.9	2.7	8,316
川崎汽船	—	1.5	3,783
<b>倉庫・運輸関連業(-%)</b>			
近鉄エクスプレス	0.1	—	—
<b>情報・通信業(9.4%)</b>			
NECネットエスアイ	0.5	0.5	846
システナ	0.5	2	868
日鉄ソリューションズ	0.3	0.3	1,047
T I S	1.5	1.7	6,791
コーエーテクモホールディングス	0.5	1	2,415
ネクソン	3.9	4	11,124
ティーガイア	0.1	0.5	834
ガホー・オンライン・エンターテイメント	0.3	0.3	642
GMOペイメントゲートウェイ	0.3	0.4	5,076
インターネットイニシアティブ	—	1	2,375
ラクス	0.6	0.6	1,147
アカツキ	0.2	—	—
チェンジ	—	0.4	800
野村総合研究所	3.1	3.1	10,400
インフォコム	0.1	0.1	204
オービック	0.5	0.5	10,900

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	0.2	663
Zホールディングス	23.4	22.1	7,944
トレンドマイクロ	0.9	0.9	6,444
日本オラクル	0.3	0.3	2,574
伊藤忠テクノソリューションズ	0.7	0.7	2,299
大塚商会	0.9	0.9	4,207
電通国際情報サービス	0.3	0.3	1,410
東映アニメーション	0.1	0.1	1,393
デジタルガレージ	0.3	0.3	1,231
ネットワンシステムズ	—	0.6	2,145
B I P R O G Y	0.5	0.5	1,592
USEN-NEXT HOLDINGS	0.1	0.1	230
日本電信電話	16.3	12.1	46,500
KDD I	11.7	10.2	41,799
ソフトバンク	—	24.9	36,777
光通信	0.2	0.2	4,002
GMOインターネットグループ	—	0.5	1,285
東宝	1	1	5,300
エス・ティ・ティ・データ	4.4	4.7	9,832
D T S	—	0.3	1,030
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.7	0.8	5,096
カプコン	1.5	1.5	6,600
S C S K	1.2	1.2	2,587
N S D	—	0.5	1,272
コナミグループ	0.6	0.7	4,739
ソフトバンクグループ	4.7	7.6	46,185
<b>卸売業(6.7%)</b>			
双日	1.5	1.8	4,350
アルフレッサ ホールディングス	1.5	1.5	2,500
神戸物産	1.2	1.2	4,164
ダイワボウホールディングス	0.6	0.6	1,329
TOKAIホールディングス	1.3	1.3	1,155
シップヘルスケアホールディングス	0.7	0.7	1,948
コマダホールディングス	0.6	—	—
メディバルホールディングス	1.6	1.6	2,867
日本ライフライン	0.9	—	—
伊藤忠商事	11.1	10.1	42,521
丸紅	15.9	12.9	19,279
豊田通商	1.6	1.4	7,168
兼松	0.6	0.6	912
三井物産	12.7	12	46,116
住友商事	10.2	10.2	22,409
三菱商事	11.9	10.2	45,339

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
阪和興業	—	0.3	1,095
岩谷産業	0.4	0.4	2,260
PALTAC	0.3	0.3	1,320
日鉄物産	0.1	0.1	515
ミスミグループ本社	2	2.5	8,700
<b>小売業(4.1%)</b>			
ローソン	0.4	0.4	2,008
エービーシー・マート	0.3	0.3	2,115
日本マクドナルドホールディングス	0.7	0.9	4,680
セリア	0.3	0.3	808
ビックカメラ	1.3	—	—
Monotaro	2	2.6	6,250
マツキョココカラ&カンパニー	0.7	1	5,790
ZOZO	1	1.2	3,750
ウエルシアホールディングス	0.8	0.8	2,504
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.3	993
ネクステージ	—	0.3	878
コスモス薬品	0.2	0.2	2,942
セブン&アイ・ホールディングス	6.3	5.7	31,794
ツルハホールディングス	0.4	0.4	3,764
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.2	1,542
FOOD & LIFE COMPANIES	0.9	0.9	2,331
ノジマ	0.1	0.6	787
良品計画	1.8	2.2	3,192
コーナン商事	0.3	0.3	991
パ・パファイナ・インターナショナルホールディングス	3.5	3.8	9,184
ゼンショーホールディングス	0.8	0.8	2,852
ワークマン	0.2	0.2	1,020
スギホールディングス	0.3	0.3	1,896
日本瓦斯	—	0.8	1,720
ライフコーポレーション	0.1	0.1	246
丸井グループ	1.6	1.3	3,004
イズミ	0.3	0.3	933
ヤオコー	0.2	0.2	1,360
ケーズホールディングス	1.5	1.5	1,680
アインホールディングス	0.2	—	—
ニトリホールディングス	0.6	0.7	10,881
ファーストリテイリング	0.2	0.2	16,432
サンドラッグ	0.7	0.7	2,604
<b>銀行業(5.4%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	8	8	2,376
コンソルディア・フィナンシャルグループ	9.9	8.5	3,961
新生銀行	1.3	0.4	873

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	0.9	2,315
三菱UFJフィナンシャル・グループ	73.1	62.4	44,909
りそなホールディングス	17.2	18.5	11,643
三井住友トラスト・ホールディングス	3.1	2.9	12,327
三井住友フィナンシャルグループ	11.2	11	50,369
千葉銀行	5	5	4,050
ふくおかフィナンシャルグループ	1.4	1.1	2,783
セブン銀行	7.5	5	1,290
みずほフィナンシャルグループ	20.2	22	35,860
<b>証券・商品先物取引業(0.7%)</b>			
FPG	0.4	—	—
GMOフィナンシャルホールディングス	0.9	0.9	469
SBIホールディングス	2	—	—
ジャフコグループ	0.2	0.6	1,372
大和証券グループ本社	11.2	11.2	6,697
野村ホールディングス	24.5	28.1	13,769
マネックスグループ	—	1.4	625
<b>保険業(3.0%)</b>			
SOMPOホールディングス	2.8	2.6	14,640
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.5	3.4	13,474
第一生命ホールディングス	8.1	7.8	18,478
東京海上ホールディングス	5.4	15.4	42,981
T&Dホールディングス	3.8	4.1	6,232
<b>その他金融業(1.3%)</b>			
全国保証	0.4	0.4	2,024
芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,710
みずほリース	0.1	0.1	324
東京センチュリー	0.4	0.3	1,449
イオンフィナンシャルサービス	1.1	1.1	1,589
アコム	3.4	3.4	1,074
オリエントコーポレーション	7.8	0.7	833
オリックス	9.9	10.2	22,052
三菱HCキャピタル	4.8	5.1	3,243
日本取引所グループ	4.3	4	7,828
<b>不動産業(2.5%)</b>			
大東建託	—	0.6	9,204
いちご	0.5	—	—
ヒューリック	3.7	3.7	4,229
野村不動産ホールディングス	1	1	3,225
サムティ	0.4	—	—
プレサンスコーポレーション	0.1	0.1	158
オープンハウスグループ	0.5	0.5	2,935
東急不動産ホールディングス	4.4	4.4	3,181

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
飯田グループホールディングス	1.3	1.3	2,871
三井不動産	7.4	6.8	18,162
三菱地所	10.3	9.5	18,126
東京建物	1.9	1.5	2,886
住友不動産	3.4	2.8	10,245
スターツコーポレーション	0.3	0.3	864
日本エスコン	0.7	0.7	585
イオンモール	0.7	0.7	1,185
カチタス	0.3	0.3	984
<b>サービス業(3.9%)</b>			
M I X I	0.5	—	—
日本M&Aセンターホールディングス	2.6	—	—
UTグループ	0.1	0.1	282
エス・エム・エス	0.5	0.5	1,855
パーソルホールディングス	1.4	1.8	5,427
総合警備保障	0.6	0.6	2,238
カカコム	1.3	1.3	2,983
ディップ	0.2	0.2	787
ベネフィット・ワン	0.5	0.8	1,684
エムスリー	2.8	3.1	13,689
アウトソーシング	1	—	—
博報堂DYホールディングス	2.5	2.5	3,327
H. U. グループホールディングス	—	0.4	1,116
オリエンタルランド	1.8	—	—
ビー・エム・エル	—	0.2	696
ユー・エス・エス	1.6	1.9	4,104
サイバーエージェント	—	3.6	4,417
フルキャストホールディングス	0.3	0.3	870
エン・ジャパン	0.2	0.2	465
テクノプロ・ホールディングス	0.9	1.1	4,213
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	—	—
ジャパンマテリアル	0.1	0.5	1,253

銘柄	期首 (前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
リクルートホールディングス	9.4	11.2	49,616	
ベルシステム24ホールディングス	0.3	0.3	392	
ペイカレント・コンサルティング	0.1	1.3	5,668	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.3	0.3	503	
リログループ	0.9	0.9	2,049	
カナモト	0.3	—	—	
トランス・コスモス	—	0.2	666	
セコム	1.6	1.6	13,214	
メイテック	0.2	0.6	1,503	
イオンディライト	0.1	0.1	296	
合計	株数・金額	1,099	1,123	3,202,575
	銘柄数<比率>	400	396	<97.7%>

(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
		73	—

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	3,202,575	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	76,152	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	3,278,727	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

(2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,278,727,846円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	37,414,631
株 式(評価額)	3,202,575,040
未 収 入 金	4,642,590
未 収 配 当 金	35,483,185
差 入 委 託 証 拠 金	△ 1,387,600
(B) 負 債	1,337,074
未 払 解 約 金	1,337,000
未 払 利 息	74
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,277,390,772
元 本	1,772,425,675
次 期 繰 越 損 益 金	1,504,965,097
(D) 受 益 権 総 口 数	1,772,425,675口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,491円

(注記事項)

期首元本額	1,822,713,178円
期中追加設定元本額	120,315,678円
期中一部解約元本額	170,603,181円

(当期末元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	1,772,425,675円
------------------	----------------

■損益の状況

当期(自2021年11月20日 至2022年11月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	85,716,076円
受 取 配 当 金	85,768,883
そ の 他 収 益 金	238
支 払 利 息	△ 53,045
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 113,612,582
売 買 損 益	243,930,147
売 買 損	△ 357,542,729
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 1,148,250
取 引 益	11,846,750
取 引 損	△ 12,995,000
(D) そ の 他 費 用 等	△ 5,526
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△ 29,050,282
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,576,645,876
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	90,220,322
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 132,850,819
(I) 計 (E+F+G+H)	1,504,965,097
次 期 繰 越 損 益 金(I)	1,504,965,097

(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。