

■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	J P X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・J P X日経400オープン	アムンディ・J P X日経400オープンマザーファンド受益証券
	アムンディ・J P X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・J P X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・J P X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（評価益を含みます）等の全額とします。分配金額は、委託会社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・J P X日経400オープン

運用報告書（全体版）

第4期（決算日 2017年11月20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お願い申し上げます。

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 0120-202-900（フリーダイヤル）

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/>

◆設定以来の運用実績

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			
(設定日) 2014年1月22日	円 10,000	円 —	% —	ポイント 11,823.52	% —	% —	% —	百万円 400
1期(2014年11月19日)	11,026	0	10.3	13,098.51	10.8	98.5	1.5	7,163
2期(2015年11月19日)	12,646	0	14.7	15,110.20	15.4	98.9	1.1	11,071
3期(2016年11月21日)	11,503	0	△9.0	13,858.95	△8.3	97.6	2.4	11,288
4期(2017年11月20日)	14,059	0	22.2	17,063.36	23.1	96.3	3.6	5,282

(注1) 設定日の基準価額は設定時の価額(10,000円)、純資産総額は設定元本を表示しております。

(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」は実質組入比率を記載しております。以下同じ。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。以下同じ。

(注4) ・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。

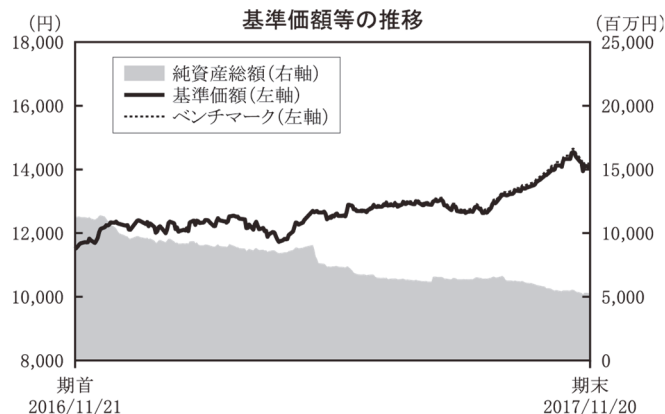
◆当期中の基準価額と市況等の推移

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	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2016年11月21日	円 11,503	% —	ポイント 13,858.95	% —	% 97.6	% 2.4
11月末	11,714	1.8	14,113.19	1.8	98.8	1.2
12月末	12,107	5.3	14,594.98	5.3	97.7	2.2
2017年1月末	12,125	5.4	14,625.65	5.5	97.8	2.1
2月末	12,222	6.3	14,746.85	6.4	96.6	3.3
3月末	12,121	5.4	14,633.84	5.6	95.3	4.6
4月末	12,269	6.7	14,816.98	6.9	96.0	3.9
5月末	12,523	8.9	15,126.52	9.1	98.0	2.0
6月末	12,863	11.8	15,564.54	12.3	98.9	1.1
7月末	12,889	12.0	15,605.27	12.6	96.9	3.1
8月末	12,825	11.5	15,538.65	12.1	96.5	3.4
9月末	13,331	15.9	16,167.82	16.7	98.0	2.0
10月末	14,082	22.4	17,089.88	23.3	96.7	3.2
(期末) 2017年11月20日	14,059	22.2	17,063.36	23.1	96.3	3.6

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第4期首	11,503円
第4期末	14,059円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	22.2%



- (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、2016年11月21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 2016年12月に、米国のトランプ次期政権への政策期待に加え、好調な国内外経済を背景に企業業績に対する期待が高まったこと
- ② 2017年4月のフランス大統領選挙でのマクロン氏の勝利により、反EU(欧州連合)派台頭への警戒感が解消され、リスクオンの動きが強まったこと
- ③ 2017年10月の衆院選において与党が大勝し、安倍政権の経済戦略や日銀の金融緩和政策の継続が期待されたこと

下落要因

- ① 2017年3月に、トランプ政権の景気浮揚策への期待の後退、欧州の反EU派台頭の懸念の高まりなどから、為替が円高に動いたこと
- ② 北朝鮮による一連のミサイル発射実験により高まった地政学リスクが、2017年9月初旬の核実験によりピークに達したことで円高が進行したこと

【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。

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>

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】

当期の騰落率は+22.2%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（+23.1%）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。

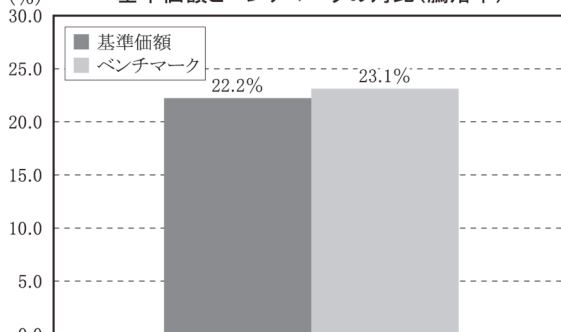
マイナス要因

- 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

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



2016年11月21日～2017年11月20日

(注) ベンチマーク（ファンドの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。

【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 4 期 (2016年11月22日 ～2017年11月20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)	81円 (37) (41) (4)	0.646% (0.291) (0.323) (0.032)	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)	3 (0) (2)	0.020 (0.001) (0.018)	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)	8 (1) (3) (4)	0.066 (0.010) (0.026) (0.030)	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	92	0.732	

期中の平均基準価額は12,589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。

◆ 売買及び取引の状況 (2016年11月22日から2017年11月20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	818,509	1,051,530	6,805,594	8,798,052

(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	9,282,144千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,652,474千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.21

(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 (2016年11月22日から2017年11月20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 (2017年11月20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	9,657,783	3,670,699	5,278,465

(注1) 口数・評価額の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3,670,699千口です。

◆投資信託財産の構成 (2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	5,278,465	98.7
コール・ローン等、その他	67,700	1.3
投資信託財産総額	5,346,165	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

(2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,346,165,478円
コール・ローン等	58,800,138
アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド(評価額)	5,278,465,340
未 収 入 金	8,900,000
(B) 負 債	63,861,807
未 払 解 約 金	40,193,718
未 払 信 託 報 酬	20,515,545
未 払 利 息	169
そ の 他 未 払 費 用	3,152,375
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,282,303,671
元 本	3,757,117,227
次 期 繰 越 損 益 金	1,525,186,444
(D) 受 益 権 総 口 数	3,757,117,227口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	14,059円

(注記事項)

期首元本額

期中追加設定元本額

期中一部解約元本額

9,813,148,439円

1,549,881,797円

7,605,913,009円

◆損益の状況

当期 (自2016年11月22日 至2017年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△14,013円
支 払 利 息	△14,013
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	904,519,064
売 買 益	1,456,791,707
売 買 損	△552,272,643
(C) 信 託 報 酬 等	△55,045,591
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	849,459,460
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,015,346
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	664,711,638
(配 当 等 相 当 額)	(607,524,977)
(売 買 損 益 相 当 額)	(57,186,661)
(G) 計 (D + E + F)	1,525,186,444
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,525,186,444
追 加 信 託 差 損 益 金	664,711,638
(配 当 等 相 当 額)	(611,240,318)
(売 買 損 益 相 当 額)	(53,471,320)
分 配 準 備 積 立 金	860,474,806

(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 4 期
	(2016年11月22日～2017年11月20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	4,059

(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4期》

決算日：2017年11月20日

(計算期間：2016年11月22日～2017年11月20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	J P X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。

◆設定以来の運用実績

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	%	(ベンチマーク) ポイント	騰落率			
(設定日) 2014年1月22日	10,000	—	11,823.52	—	—	—	400
1期(2014年11月19日)	11,088	10.9	13,098.51	10.8	98.5	1.5	7,161
2期(2015年11月19日)	12,808	15.5	15,110.20	15.4	98.9	1.1	11,067
3期(2016年11月21日)	11,682	△8.8	13,858.95	△8.3	97.6	2.4	11,281
4期(2017年11月20日)	14,380	23.1	17,063.36	23.1	96.4	3.6	5,278

(注1) 設定日の基準価額は設定時の価額(10,000円)、純資産総額は設定元本を表示しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。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。

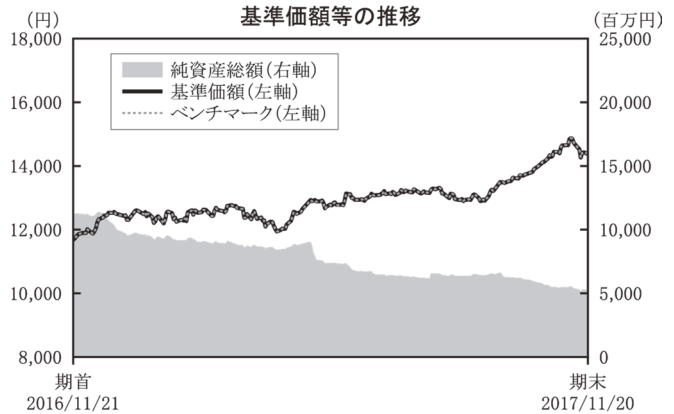
◆当期中の基準価額と市況等の推移

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
	円	%	(ベンチマーク) ポイント	騰落率		
(期首) 2016年11月21日	11,682	—	13,858.95	—	97.6	2.4
11月末	11,898	1.8	14,113.19	1.8	98.8	1.2
12月末	12,304	5.3	14,594.98	5.3	97.8	2.2
2017年1月末	12,330	5.5	14,625.65	5.5	97.8	2.1
2月末	12,436	6.5	14,746.85	6.4	96.7	3.3
3月末	12,340	5.6	14,633.84	5.6	95.4	4.6
4月末	12,498	7.0	14,816.98	6.9	96.1	3.9
5月末	12,765	9.3	15,126.52	9.1	98.0	2.0
6月末	13,119	12.3	15,564.54	12.3	98.9	1.1
7月末	13,153	12.6	15,605.27	12.6	96.9	3.1
8月末	13,096	12.1	15,538.65	12.1	96.6	3.4
9月末	13,621	16.6	16,167.82	16.7	98.0	2.0
10月末	14,397	23.2	17,089.88	23.3	96.8	3.2
(期末) 2017年11月20日	14,380	23.1	17,063.36	23.1	96.4	3.6

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第4期首	11,682円
第4期末	14,380円
騰落率	23.1%



(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、2016年11月21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 2016年12月に、米国のトランプ次期政権への政策期待に加え、好調な国内外経済を背景に企業業績に対する期待が高まったこと
- ② 2017年4月のフランス大統領選挙でのマクロン氏の勝利により、反EU（欧州連合）派台頭への警戒感が解消され、リスクオンの動きが強まったこと
- ③ 2017年10月の衆院選において与党が大勝し、安倍政権の経済戦略や日銀の金融緩和政策の継続が期待されたこと

下落要因

- ① 2017年3月に、トランプ政権の景気浮揚策への期待の後退、欧州の反EU派台頭の懸念の高まりなどから、為替が円高に動いたこと
- ② 北朝鮮による一連のミサイル発射実験により高まった地政学リスクが、2017年9月初旬の核実験によりピークに達したことで円高が進行したこと

【投資環境】

<国内株式市場>

当期の国内株式市場は大きく上昇しました。期初からドル高・円安が進むなか、株式市場は業績上方修正期待を受けて堅調なスタートとなりました。2017年4月には、反EU（欧州統合）派台頭が懸念さ

れたフランス大統領選挙で、中道のマクロン氏が勝利したことで欧州への警戒感が解消し、海外市場対比で出遅れていた日本株は大幅に上昇しました。その後は、トランプ政権とロシアの不透明な関係に対する疑惑や、政権の政策実行能力が疑問視されたことなどで円高が進み始めると、株式市場もじりじりと上値を切り下げていきました。北朝鮮と米国の軍事衝突の可能性が取りざたされたことも売り材料となりました。しかし、安倍首相が急きょ衆院解散・総選挙に打って出ると、野党の敵失も手伝って与党が大勝し、安倍政権の成長戦略と日銀の金融緩和が維持されるとの期待から様子見だった外国人投資家が大規模な買いを入れてきました。また、3割の企業が過去最高益を更新するなど好調な決算発表が好感されたこともあり、国内株式市場は前期末比で大幅に上昇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】

当期の騰落率は+23.1%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（+23.1%）と連動しました。

マイナス要因

- ① 売買手数料等

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

【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 4 期 (2016年11月22日 ～2017年11月20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)	3円 (0) (2)	0.020% (0.001) (0.018)	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)	1 (1)	0.009 (0.009)	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	4	0.029	

期中の平均基準価額は12,829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 (2016年11月22日から2017年11月20日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 497 (△519)	千円 908,656 (-)	千株 4,891	千円 8,373,487

(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、合併等による増加分で、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	百万円 9,040	百万円 9,163	百万円 888	百万円 888

◆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	9,282,144千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	7,652,474千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.21

(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 (2016年11月22日から2017年11月20日まで)

株 式

買 柄	付			売 柄	付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ソニー	22.6	97,605	4,318	三菱UFJフィナンシャル・グループ	224.6	162,434	723
KDDI	9.7	28,778	2,966	三井住友フィナンシャルグループ	35.3	153,125	4,337
関西電力	15.6	23,653	1,516	みずほフィナンシャルグループ	643.4	133,042	206
日本たばこ産業	6.3	23,615	3,748	本田技研工業	38.7	129,952	3,357
日本電信電話	3.9	20,646	5,293	トヨタ自動車	19.6	129,050	6,584
トヨタ自動車	2.8	17,423	6,222	ソフトバンクグループ	15.3	128,468	8,396
本田技研工業	5.6	17,410	3,109	日本電信電話	22.8	116,611	5,114
武田薬品工業	2.5	14,249	5,699	武田薬品工業	20.1	110,360	5,490
サントリー食品インターナショナル	2.4	12,480	5,200	ファナック	5	110,284	22,056
三井化学	19	12,343	649	KDDI	33.9	102,506	3,023

(注) 金額は受渡し代金です。

◆利害関係人との取引状況等 (2016年11月22日から2017年11月20日まで)

当期中の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 (2017年11月20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	5.6	3.5	2,037
鉱業(0.4%)			
国際石油開発帝石	39	15	18,892
建設業(3.5%)			
安藤・間	6.5	2.3	2,040
東急建設	0.6	0.6	609
コムシスホールディングス	3.9	1.1	3,344
大成建設	38	3.1	18,941
大林組	20.9	9.1	13,313
清水建設	23	9.2	11,481
長谷工コーポレーション	9.7	3.4	5,912
鹿島建設	36	13	14,859
三井住友建設	35.3	3	1,917
前田建設工業	—	2	3,302
戸田建設	—	3	2,598
熊谷組	6	0.6	1,851
大東建託	2.9	1.1	22,412
NIPPO	2	1	2,568
前田道路	2	1	2,473
五洋建設	—	4.4	3,612
住友林業	6.1	1.9	3,613
大和ハウス工業	23.5	9	36,252
積水ハウス	24.8	9.9	20,646
協和エクシオ	3	0.7	1,806
九電工	1	0.7	3,500
日揮	9	—	—
食料品(4.6%)			
江崎グリコ	2.3	0.8	4,392
カルビー	3.3	1.1	4,202
ヤクルト本社	4.6	1.7	15,028
明治ホールディングス	4.7	1.9	18,259
日本ハム	6	2	5,478
アサヒグループホールディングス	14.1	5.7	31,543
キリンホールディングス	32.5	13.1	34,826
サントリー食品インターナショナル	—	2.1	10,227
伊藤園	2.7	—	—
キッコーマン	6	2.3	9,303
味の素	16.9	6.2	13,088
キュービー	4.4	1.5	4,284
ニチレイ	2.5	1.2	3,768
東洋水産	3.2	1.5	6,817
日清食品ホールディングス	3.6	1.2	9,492
日本たばこ産業	33.2	16.6	61,420
繊維製品(0.6%)			
帝人	—	2.4	5,661

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	56	20.6	23,514
パルプ・紙(0.2%)			
王子ホールディングス	31	12	8,064
大王製紙	3.7	1.6	2,214
化学(7.6%)			
クラレ	10.3	4.6	10,143
旭化成	47	17.7	24,771
住友化学	57	21	16,716
日産化学工業	3.4	1.7	7,344
東ソー	21	4	9,772
デンカ	17	1.1	4,460
信越化学工業	13.2	4.7	57,363
エア・ウォーター	7	2.5	5,740
大陽日酸	6	1.9	2,703
日本パーカライジング	4.4	1.1	1,965
三菱瓦斯化学	5.1	2.3	6,886
三井化学	—	2.5	8,687
JSR	7.5	2.8	6,014
三菱ケミカルホールディングス	51	19.5	22,522
ダイセル	10.8	4.1	5,325
積水化学工業	17.7	5.9	12,891
日本ゼオン	7	2.1	3,229
アイカ工業	2.4	0.8	3,032
宇部興産	43	1.3	4,231
日立化成	2.9	1.2	3,565
ダイキョーニシカワ	—	0.7	1,257
日本化薬	5	2	3,338
日油	6	1.1	3,426
花王	18.6	6.7	46,437
日本ペイントホールディングス	5	2.2	8,239
関西ペイント	7.9	3.1	8,153
DIC	3	1.2	4,848
富士フイルムホールディングス	14.9	—	—
資生堂	13.2	5	25,815
ライオン	—	3.9	7,647
コーセー	0.9	0.5	8,320
シーズ・ホールディングス	1	0.5	2,132
小林製薬	2.4	0.7	4,879
日東電工	5.6	2.1	22,879
ニフコ	1.5	0.5	3,860
ユニ・チャーム	13.5	5.7	15,794
医薬品(5.3%)			
協和発酵キリン	9.3	3.7	7,844
武田薬品工業	27.6	10	61,890
アステラス製薬	75.2	27.9	40,468
大日本住友製薬	—	1.8	3,016

アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
塩野義製薬	9.5	4	25,056
田辺三菱製薬	7.7	3.2	7,564
中外製薬	8.2	2.8	15,428
科研製薬	1.4	0.4	2,300
エーザイ	8.7	3.2	20,416
小野薬品工業	17.1	7.2	17,463
久光製薬	2.5	0.8	4,936
参天製薬	12	5	8,855
ツムラ	2.4	0.9	3,528
沢井製薬	1.4	0.4	2,468
第一三共	23	8	21,212
キョーリン製薬ホールディングス	2.1	—	—
大塚ホールディングス	16.2	5.6	27,496
大正製薬ホールディングス	1.4	—	—
ゴム製品 (1.2%)			
横浜ゴム	4.7	1.5	3,630
東洋ゴム工業	4.2	1.7	3,857
ブリヂストン	24.5	9.6	47,731
住友ゴム工業	7.5	2.6	5,036
ガラス・土石製品 (1.0%)			
旭硝子	34	2.7	12,595
住友大阪セメント	10	5	2,740
太平洋セメント	49	1.8	8,514
TOTO	5.1	2.2	12,584
日本碍子	10	3	6,180
日本特殊陶業	7.2	2.3	5,770
鉄鋼 (1.0%)			
新日鐵住金	32.1	12	30,180
神戸製鋼所	10.6	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	21.3	7.5	18,097
東京製鐵	—	0.6	579
日立金属	8.4	3.1	4,411
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	—	5.7	1,749
三菱マテリアル	3.8	1.8	7,209
住友金属鉱山	21	3.4	15,017
DOWAホールディングス	10	0.6	2,628
住友電気工業	26.5	10.4	19,682
金属製品 (0.2%)			
三和ホールディングス	8.1	2.6	3,751
三協立山	0.8	—	—
リンナイ	1.5	0.5	4,910
日本発條	7.5	2.8	3,494
機械 (5.8%)			
アマダホールディングス	—	4	5,728
オーエスジー	3.8	1.1	2,572
DMG森精機	2.9	1.3	3,003
ディスコ	0.6	0.4	10,960
ニューフレアテクノロジー	0.1	0.1	729

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	4.2	1.5	6,495
SMC	2.3	0.9	41,976
小松製作所	33.7	13.1	46,085
住友重機械工業	18	1.5	7,102
日立建機	3.7	1.3	4,784
ハーモニック・ドライブ・システムズ	—	0.3	2,082
クボタ	36.1	14.6	29,389
荏原製作所	3.6	1.1	4,933
ダイキン工業	9.8	3.7	47,212
椿本チエイン	4	2	1,772
ダイフク	2.5	1.3	8,021
タダノ	4	1.3	2,199
平和	2.3	0.5	1,014
竹内製作所	1.7	0.2	454
T P R	0.9	0.4	1,552
ホシザキ	2.2	0.8	8,384
日本精工	15.4	5.4	8,996
ジェイテクト	6.8	3.1	6,134
不二越	7	—	—
THK	5.1	1.7	6,749
イーグル工業	0.8	0.6	1,217
マキタ	4.5	3.5	16,292
三菱重工業	120	4.5	18,535
I H I	45	—	—
電気機器 (17.1%)			
コニカミノルタ	14.6	7	7,245
ブラザー工業	8	3.1	8,835
ミネベアミツミ	12	5.2	11,835
日立製作所	167	65	54,847
三菱電機	76.5	27.1	50,148
富士電機	23	7	5,677
安川電機	7.7	3.3	16,087
日本電産	8.9	3.3	51,661
オムロン	7.9	2.9	19,894
日本電気	88	3.6	10,447
富士通	68	28	23,066
沖電気工業	3.4	—	—
ルネサスエレクトロニクス	5.3	1.2	1,752
セイコーエプソン	9.3	4.2	11,209
アルバック	—	0.5	4,135
エレコム	1.1	0.2	478
パナソニック	81.5	31	52,560
富士通ゼネラル	2	0.7	1,588
日立国際電気	2	0.5	1,620
ソニー	—	15.8	82,918
T D K	3.8	1.5	13,050
アルプス電気	6.7	2.1	7,686
クラリオン	—	3	1,344
ヒロセ電機	1.3	0.4	6,912

銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本航空電子工業	2	1	2,138
横河電機	8	2.5	5,322
日本光電工業	3.3	1.2	2,973
堀場製作所	1.5	0.6	4,410
アドバンテス	—	1.4	3,269
キーエンス	1.6	1.3	86,853
シスメックス	5.1	2.1	17,535
OBARA GROUP	—	0.2	1,546
スタンレー電気	5.6	2	8,790
カシオ計算機	7.7	2.5	4,185
ファナック	7.3	2.6	70,785
エンプラス	0.3	—	—
浜松ホトニクス	4.9	1.9	7,543
京セラ	11.1	4.5	35,392
村田製作所	7.5	2.8	44,296
小糸製作所	4.5	1.7	13,311
ミツバ	1.3	0.6	903
SCREENホールディングス	1	0.5	5,370
キヤノン	37.5	14.6	62,458
リコー	21.6	8.7	8,508
東京エレクトロン	4.8	1.8	40,878
輸送用機器(8.2%)			
トヨタ紡織	—	0.4	879
豊田自動織機	7	2.2	15,004
デンソー	17.8	6	38,730
川崎重工業	48	2.2	8,206
名村造船所	1.8	—	—
日産自動車	87.1	32	34,160
いすゞ自動車	18.5	7.8	13,384
トヨタ自動車	29	12.2	84,558
日野自動車	10.6	4	5,328
日信工業	2	0.6	1,323
NOK	2	1.5	4,143
カルソニックカンセイ	6	—	—
アイシン精機	7	2.3	13,731
マツダ	24.2	8.4	12,784
本田技研工業	56.5	23.4	86,275
スズキ	14.2	5.3	31,789
SUBARU	21.3	8.4	29,962
ヤマハ発動機	10.6	3.8	13,471
豊田合成	0.5	1.1	3,055
シマノ	2.7	1.1	16,841
テイ・エス テック	1.7	0.6	2,703
精密機器(1.7%)			
テルモ	11	4.3	21,543
島津製作所	8	3.3	8,811
ニコン	11.6	—	—
トプコン	2.9	—	—
オリンパス	11.9	4.1	18,491

銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
HOYA	15.5	5.5	32,252
朝日インテック	1.3	0.7	5,264
セイコーホールディングス	5	0.2	603
その他製品(0.6%)			
バンダイナムコホールディングス	7	2.9	11,136
パイロットコーポレーション	1.2	0.5	2,665
アシックス	5.8	2.9	4,570
ヤマハ	5.6	1.8	7,029
ビジョン	4.2	1.6	6,528
電気・ガス業(1.4%)			
中部電力	24.5	8.2	11,492
関西電力	—	10.8	15,568
東北電力	16.1	6.5	9,392
電源開発	5.3	2.1	6,331
東京瓦斯	74	6	15,519
大阪瓦斯	72	5.3	11,177
東邦瓦斯	21	1.4	4,207
陸運業(4.7%)			
東武鉄道	40	2.9	9,802
相鉄ホールディングス	17	1	2,807
東京急行電鉄	37	7.6	12,699
小田急電鉄	10.5	4	9,128
京王電鉄	21	1.6	7,360
京成電鉄	6	2	6,590
東日本旅客鉄道	13.4	4.8	51,384
西日本旅客鉄道	7.1	2.4	18,657
東海旅客鉄道	5.8	2.4	48,228
西武ホールディングス	—	3.9	7,917
西日本鉄道	13	0.8	2,242
近鉄グループホールディングス	65	2.6	10,842
阪急阪神ホールディングス	9.6	3.4	14,178
南海電気鉄道	15	1.7	4,544
京阪ホールディングス	16	1.6	5,136
名古屋鉄道	40	2.7	7,009
日本通運	29	1	6,860
ヤマトホールディングス	11.9	4.7	9,820
山九	10	0.6	2,709
日立物流	—	0.7	1,900
海運業(-%)			
日本郵船	49	—	—
空運業(0.8%)			
日本航空	13.5	4.8	19,252
ANAホールディングス	130	5	21,770
情報・通信業(7.3%)			
新日鉄住金ソリューションズ	—	0.6	1,644
グリー	5.1	—	—
ネクソン	8.1	3	9,585
コロプラ	2.2	1	1,083
ティーガイア	0.5	0.5	1,202

アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
カンホー・オンライン・エンターテイメント	17.1	5.5	1,644	
野村総合研究所	5	1.8	8,937	
オービック	2.6	0.8	6,008	
ヤフー	55.2	20.4	10,363	
トレンドマイクロ	3.9	1.3	8,034	
日本オラクル	1.2	0.4	3,948	
伊藤忠テクノソリューションズ	1.7	0.6	2,784	
大塚商会	2	0.8	6,624	
USEN	4.9	—	—	
日本テレビホールディングス	6.7	2.5	5,015	
日本電信電話	30.9	12	69,192	
KDDI	46.3	22.1	65,780	
光通信	0.5	0.3	4,683	
NTTドコモ	51.5	19.7	55,228	
GMOインターネット	2.5	1.3	2,294	
東宝	5.3	1.8	6,516	
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	7.8	9,906	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	1.3	6,786	
SCSK	1.7	0.7	3,626	
コナミホールディングス	—	1.1	6,534	
ソフトバンクグループ	21.8	7.8	73,858	
卸売業 (4.5%)				
双日	36.2	16.8	5,409	
アルフレッサ ホールディングス	6.8	2.8	6,739	
神戸物産	—	0.2	985	
シップヘルスケアホールディングス	1.5	0.3	1,086	
第一興商	1.8	0.6	3,072	
メディカルホールディングス	7.5	2.7	5,985	
伊藤忠商事	50.2	19.6	37,191	
丸紅	63.1	21.4	15,427	
豊田通商	8.2	2.9	11,890	
兼松	16	1.6	2,185	
三井物産	62.4	22.7	36,887	
日立ハイテクノロジーズ	1.8	1	4,990	
住友商事	46.1	16.7	27,529	
三菱商事	53.2	18.8	51,831	
阪和興業	3	0.6	2,349	
岩谷産業	9	0.6	1,962	
東邦ホールディングス	2.4	1.1	2,530	
サンリオ	2.3	0.5	911	
日鉄住金物産	0.6	0.3	1,665	
ミスミグループ本社	8.5	2.9	9,396	
小売業 (4.3%)				
ローソン	2.8	0.7	5,117	
エービーシー・マート	1	0.4	2,376	
ゲオホールディングス	1.3	—	—	
アダストリア	—	0.5	1,214	
セリア	0.8	0.7	4,452	
ビックカメラ	—	1.3	1,846	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
MonotaRO	2.7	0.8	2,532	
J. フロント リテイリング	9.2	3.3	5,781	
マツモトキヨシホールディングス	1.6	0.5	4,490	
スタートトゥデイ	7.1	2.7	8,694	
ウエルシアホールディングス	0.8	0.8	3,584	
クリエイトSDホールディングス	1.3	0.5	1,428	
コスモス薬品	0.2	0.1	2,502	
セブン&アイ・ホールディングス	28.8	11.2	50,780	
ツルハホールディングス	1.4	0.5	7,210	
クスリのアオキホールディングス	0.7	0.3	2,085	
ノジマ	1.7	0.1	242	
良品計画	0.9	0.4	13,640	
ドンキホーテホールディングス	4.9	1.7	8,619	
VTホールディングス	2.9	—	—	
ユナイテッドアローズ	1	0.2	789	
エスギホールディングス	1.3	0.6	3,552	
ユニ・ファミリーマートホールディングス	2.3	0.9	6,066	
日本瓦斯	1	0.6	2,343	
しまむら	0.9	0.3	3,906	
高島屋	11	4	4,164	
イオン	28.7	10.4	18,142	
イズミ	0.8	0.4	2,428	
ヤオコー	0.9	0.4	2,072	
ケーズホールディングス	3.2	1.2	3,250	
アインホールディングス	0.9	0.4	2,880	
ニトリホールディングス	2.8	1.1	19,459	
パローホールディングス	1.5	0.7	1,710	
ファーストリテイリング	1.2	0.4	16,076	
サンドラッグ	1.6	1.2	5,952	
銀行業 (6.2%)				
めぶきフィナンシャルグループ	—	12.3	5,645	
東京TYフィナンシャルグループ	1	0.2	554	
九州フィナンシャルグループ	12.1	5.4	3,585	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	49.4	16.8	9,794	
新生銀行	63	2.5	4,280	
あおぞら銀行	34	1.7	7,021	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	297.6	88.6	65,138	
りそなホールディングス	86.3	30.3	17,613	
三井住友トラスト・ホールディングス	15.3	5.4	21,897	
三井住友フィナンシャルグループ	49.1	15.5	67,223	
千葉銀行	29	9	7,362	
群馬銀行	17	5.2	3,385	
ふくおかフィナンシャルグループ	25	—	—	
静岡銀行	22	7	7,231	
スルガ銀行	7.1	2.7	6,226	
八十二銀行	18	—	—	
ほくほくフィナンシャルグループ	4.9	1.8	2,899	
広島銀行	23	4	3,472	
中国銀行	6.9	2.9	4,115	

銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セブン銀行	28.8	10.4	3,889
みずほフィナンシャルグループ	937.3	349.4	68,167
山口フィナンシャルグループ	9	3	3,909
北洋銀行	12	—	—
証券、商品先物取引業(1.1%)			
FPG	3.7	0.2	253
SBIホールディングス	6.5	3.1	5,015
ジャフコ	1.3	0.5	2,830
大和証券グループ本社	69	23	15,757
野村ホールディングス	145.9	48.2	30,500
岡三証券グループ	7	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	7.9	3.2	2,256
松井証券	1.1	0.5	476
カブドットコム証券	5.4	2.1	703
保険業(2.9%)			
SOMPOホールディングス	14	5.4	23,436
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	20	7.2	25,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	7	2.1	3,748
第一生命ホールディングス	43	15.1	32,404
東京海上ホールディングス	28.1	10.1	48,884
T&Dホールディングス	24.4	7.9	13,560
その他金融業(1.4%)			
全国保証	1.2	0.9	4,243
芙蓉総合リース	0.8	0.2	1,450
興銀リース	1.4	0.2	551
東京センチュリー	1.6	0.6	2,868
イオンフィナンシャルサービス	5.1	2.1	4,916
オリエン特コーポレーション	19.9	4.3	748
日立キャピタル	2	0.8	2,112
オリックス	50.4	17.9	33,231
三菱UFJリース	14.9	6.5	3,776
日本取引所グループ	21.5	8.1	15,892
不動産業(2.8%)			
いちご	7.4	3.2	1,264
ヒューリック	11.8	4.9	5,835
野村不動産ホールディングス	5	2.2	5,319
プレサンスコーポレーション	0.8	0.8	1,101
オープンハウス	—	0.2	1,024
東急不動産ホールディングス	17.9	6.3	4,951
飯田グループホールディングス	4.4	2.4	4,701
パーク24	2.6	1.6	4,273
三井不動産	37	13.4	34,109
三菱地所	51	20	40,150
東京建物	8.4	2.8	4,331
住友不動産	17	6	22,206
大京	15	—	—
レオパレス21	8.8	4.5	4,027
スターツコーポレーション	1.3	0.1	262
住友不動産販売	0.5	—	—

銘柄	期首 (前期末)			
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
タカラレーベン	3.1	—	—	
イオンモール	4.9	1.9	3,822	
エヌ・ティ・ティ都市開発	4.6	2.2	2,593	
サービス業(2.7%)				
ミクシィ	2	0.6	3,366	
日本M&Aセンター	2.4	0.9	4,977	
パーソルホールディングス	5.6	2.5	6,825	
クックパッド	1.9	—	—	
総合警備保障	2.7	1	5,930	
カカクコム	5.5	2.1	3,513	
ディップ	0.2	0.2	546	
エムスリー	5.5	2.5	9,250	
ディー・エヌ・エー	2.4	1.7	4,571	
博報堂DYホールディングス	10.9	3.5	5,138	
ぐるなび	1.1	—	—	
電通	8.8	—	—	
オリエンタルランド	8.4	3.1	29,896	
リゾートトラスト	3.3	1.2	2,700	
ユー・エス・エス	9.6	3	6,954	
サイバーエージェント	4.2	1.8	7,380	
楽天	35.3	12.8	14,508	
リログroup	0.4	1.4	4,076	
エイチ・アイ・エス	1.3	—	—	
カナモト	0.9	0.3	1,126	
セコム	7.3	2.8	23,100	
メイテック	—	0.4	2,312	
イオンディライト	0.8	0.2	816	
合計	株数・金額	7,167	2,253	5,085,727
	銘柄数<比率>	400	400	<96.4%>

(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。

(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	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
J P X日経400	191	—

(注) 単位未満は切捨てです。

◆投資信託財産の構成 (2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	5,085,727	96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	205,484	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	5,291,211	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

(2017年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,290,197,392円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	147,510,410
株 式 (評価額)	5,085,727,820
未 収 配 当 金	49,171,662
差 入 委 託 証 拠 金	7,787,500
(B) 負 債	11,869,788
未 払 金	2,969,364
未 払 解 約 金	8,900,000
未 払 利 息	424
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,278,327,604
元 本	3,670,699,124
次 期 繰 越 損 益 金	1,607,628,480
(D) 受 益 権 総 口 数	3,670,699,124口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	14,380円

(注記事項)

期首元本額	9,657,783,862円
期中追加設定元本額	818,509,431円
期中一部解約元本額	6,805,594,169円

(当期末元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	3,670,699,124円
------------------	----------------

◆損益の状況

当期 (自2016年11月22日 至2017年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	159,656,060円
受 取 配 当 金	159,691,461
そ の 他 収 益 金	128,597
支 払 利 息	△163,998
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,536,573,853
売 買 益	1,660,117,194
売 買 損	△123,543,341
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	47,505,720
取 引 益	72,667,648
取 引 損	△25,161,928
(D) そ の 他 費 用 等	△705,723
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	1,743,029,910
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,624,035,832
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	233,020,569
(H) 解 約 差 損 益 金	△1,992,457,831
(I) 計 (E + F + G + H)	1,607,628,480
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,607,628,480

(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。