

■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5期（決算日 2018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
5期(2018年11月19日)	13,257	0	△5.7	16,209.18	△5.0	96.0	3.9	4,864

(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。

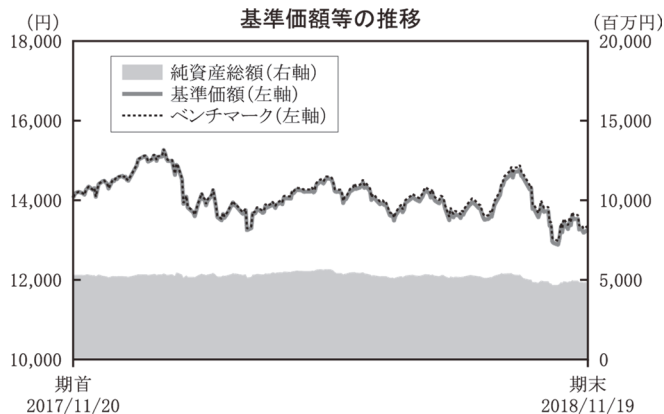
## ◆当期中の基準価額と市況等の推移

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	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2017年11月20日	円 14,059	% —	ポイント 17,063.36	% —	% 96.3	% 3.6
11月末	14,303	1.7	17,359.92	1.7	96.9	3.1
12月末	14,492	3.1	17,604.38	3.2	97.8	2.1
2018年1月末	14,640	4.1	17,799.18	4.3	97.8	2.1
2月末	14,058	△0.0	17,106.08	0.3	97.0	3.0
3月末	13,785	△1.9	16,783.34	△1.6	96.6	3.4
4月末	14,264	1.5	17,372.46	1.8	96.2	3.8
5月末	14,020	△0.3	17,082.26	0.1	98.0	2.0
6月末	13,909	△1.1	16,966.23	△0.6	97.9	2.1
7月末	14,069	0.1	17,175.41	0.7	98.1	1.9
8月末	13,911	△1.1	16,994.69	△0.4	97.5	2.4
9月末	14,716	4.7	17,986.11	5.4	98.4	1.6
10月末	13,332	△5.2	16,297.09	△4.5	96.7	3.2
(期末) 2018年11月19日	13,257	△5.7	16,209.18	△5.0	96.0	3.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 【基準価額等の推移】

第5期首	14,059円
第5期末	13,257円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△5.7%



(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、2017年11月20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 加速する米国の物価・賃金上昇がFRB（米連邦準備理事会）による利上げペース加速の思惑を強めたことで米国株が急落し、それが世界の株式市場に連鎖したこと（2018年2月）
- ② 米中貿易摩擦が株式市場の懸念材料となったこと（2018年6月～9月）
- ③ 新興国通貨が大きく下落するなど、新興国経済に対する懸念が高まったこと（2018年6月～8月）

## 上昇要因

- ① 衆院選総選挙における与党の大勝により、安定した政権による成長戦略への期待が高まったこと（2017年11月～12月）
- ② 米国税制改革による景気拡大への期待から株価が堅調となったこと（2017年12月～2018年1月）
- ③ 好調な米企業業績を背景とした米株高にけん引される形で、日本株も堅調となったこと（2018年9月）

# りそな・JPX日経400オープン

## 【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-5.7%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（-5.0%）を0.7%下回りましたが、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 5 期 (2017年11月21日 ～2018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 )	91円 ( 41 ) ( 46 )  ( 5 )	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 ) ( 1 )	0.009 (0.003) (0.006)	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 )	10 ( 1 ) ( 5 ) ( 3 )	0.069 (0.010) (0.036) (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	102	0.724	

期中の平均基準価額は14,124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 (2017年11月21日から2018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	763,345	1,094,232	874,085	1,292,614

(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	1,923,413千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,146,182千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.37

(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 (2017年11月21日から2018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 (2018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
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	千口 3,670,699	千口 3,559,959	千円 4,861,480

(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3,559,959千口です。

## ◆投資信託財産の構成 (2018年11月19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	4,861,480	99.5
コール・ローン等、その他	24,120	0.5
投資信託財産総額	4,885,600	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

(2018年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,885,600,875円
コール・ローン等	20,920,704
アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド(評価額)	4,861,480,171
未 収 入 金	3,200,000
(B) 負 債	21,178,976
未 払 解 約 金	1,887,054
未 払 信 託 報 酬	16,863,521
そ の 他 未 払 費 用	2,428,401
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	4,864,421,899
元 本	3,669,419,983
次 期 繰 越 損 益 金	1,195,001,916
(D) 受 益 権 総 口 数	3,669,419,983口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,257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

3,757,117,227円  
1,038,882,714円  
1,126,579,958円

## ◆損益の状況

当期 (自2017年11月21日 至2018年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△8,245円
支 払 利 息	△8,245
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△253,633,998
売 買 益	38,967,944
売 買 損	△292,601,942
(C) 信 託 報 酬 等	△37,636,000
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△291,278,243
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	634,911,793
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	851,368,366
(配 当 等 相 当 額)	( 802,453,212)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 48,915,154)
(G) 計 (D + E + F)	1,195,001,916
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,195,001,916
追 加 信 託 差 損 益 金	851,368,366
(配 当 等 相 当 額)	( 804,603,915)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 46,764,451)
分 配 準 備 積 立 金	707,082,182
繰 越 損 益 金	△363,448,632

(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5期
	(2017年11月21日～2018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	4,119

(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5期》

決算日：2018年11月19日

(計算期間：2017年11月21日～2018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	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	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(設定日) 2014年1月22日	円 10,000	% —	ポイント 11,823.52	% —	% —	% —	百万円 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
5期(2018年11月19日)	13,656	△5.0	16,209.18	△5.0	96.0	3.9	4,861

(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」を示す標準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。

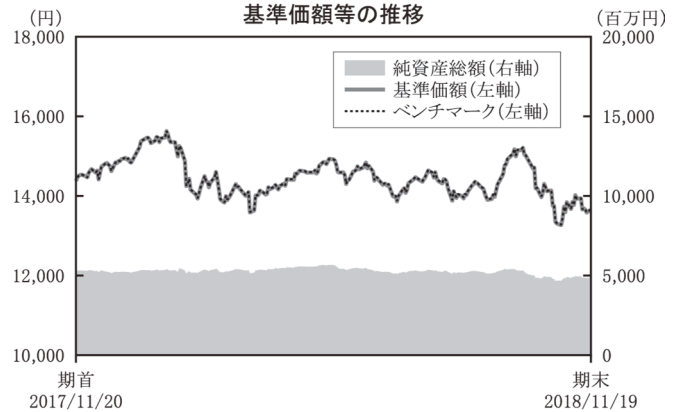
◆当期中の基準価額と市況等の推移

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)	騰落率		
(期首) 2017年11月20日	円 14,380	% —	ポイント 17,063.36	% —	% 96.4	% 3.6
11月末	14,632	1.8	17,359.92	1.7	96.9	3.1
12月末	14,834	3.2	17,604.38	3.2	97.8	2.1
2018年1月末	14,995	4.3	17,799.18	4.3	97.9	2.1
2月末	14,407	0.2	17,106.08	0.3	97.0	3.0
3月末	14,135	△1.7	16,783.34	△1.6	96.6	3.4
4月末	14,634	1.8	17,372.46	1.8	96.2	3.8
5月末	14,394	0.1	17,082.26	0.1	98.0	2.0
6月末	14,288	△0.6	16,966.23	△0.6	97.9	2.1
7月末	14,461	0.6	17,175.41	0.7	98.1	1.9
8月末	14,308	△0.5	16,994.69	△0.4	97.5	2.4
9月末	15,144	5.3	17,986.11	5.4	98.4	1.6
10月末	13,728	△4.5	16,297.09	△4.5	96.8	3.2
(期末) 2018年11月19日	円 13,656	% △5.0	ポイント 16,209.18	% △5.0	% 96.0	% 3.9

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第5期首	14,380円
第5期末	13,656円
騰落率	△5.0%



(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、2017年11月20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 加速する米国の物価・賃金上昇がFRB (米連邦準備理事会) による利上げペース加速の思惑を強めたことで米国株が急落し、それが世界の株式市場に連鎖したこと (2018年2月)
- ② 米中貿易摩擦が株式市場の懸念材料となったこと (2018年6月～9月)
- ③ 新興国通貨が大きく下落するなど、新興国経済に対する懸念が高まったこと (2018年6月～8月)

上昇要因

- ① 衆院選総選挙における与党の大勝により、安定した政権による成長戦略への期待が高まったこと (2017年11月～12月)
- ② 米国税制改革による景気拡大への期待から株価が堅調となったこと (2017年12月～2018年1月)
- ③ 好調な米企業業績を背景とした米株高にけん引される形で、日本株も堅調となったこと (2018年9月)

## 【投資環境】

### ＜国内株式市場＞

当期の国内株式市場は、下落となりました。2017年10月に行われた衆議院選挙において与党が大勝したことで、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、国内株式市場は期初から上昇して始まりました。2018年に入り、米国税制改革法案の成立で相場は一段高しました。しかし、加速する米国の物価・賃金上昇がFRB（米連邦準備理事会）の利上げペース加速の思惑を強め、米国株が急落したことで、日本株も大幅な調整を強いられました。5月以降、日本株は好悪両材料に振られる展開となりました。具体的には、米国が自動車や自動車部品への高関税を検討するとの報道や、イタリアでの反EU（欧州連合）政権の誕生の可能性が相場を崩しました。6月に誕生したイタリア新政権の穏健さが株式の買戻しを促した反面、米中間での輸入関税の応酬やトルコやアルゼンチンなど新興国通貨の急落はリスク回避の売り圧力につながりました。7月には、米国が拡大した対中制裁リストの公表が株価の急落を招来した一方、両国の通商協議再開の動きが買戻しを誘いました。その後、9月中旬に米側から中国に再交渉が提案され、トルコの大幅な利上げ断行で新興国不安が後退すると、米国株が史上最高値を更新する展開になりました。日本株は、円安の好材料も相まって、10月初にかけて急騰しました。ところが米国景気好調に呼応して、内外金利が上昇すると、米中貿易摩擦が中国企業、株式、為替に悪影響を及ぼし、ひいては中国の経済成長が鈍化するとの見方が強まりました。これらを嫌気した売りで世界的に株価が大幅に調整し、日本株も大きく値を下げて期末を迎えました。

## 【ポートフォリオ】

当ファンドは、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J P X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-5.0%となり、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）の騰落率（-5.0%）に連動しました。

### 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J P X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 5 期 (2017年11月21日 ～2018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 )	0.009% (0.003) (0.006)	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 )	0.001 (0.001)	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	0.010	

期中の平均基準価額は14,496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 (2017年11月21日から2018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 414 ( △80)	千円 918,931 ( - )	千株 436	千円 1,004,481

(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	株式先物取引	百万円 2,386	百万円 2,388	百万円 -	百万円 -

◆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	1,923,413千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,146,182千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.37

(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 (2017年11月21日から2018年11月19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
任天堂	1.7	67,472	39,689	トヨタ自動車	3.9	27,014	6,926
リクルートホールディングス	20	67,394	3,369	ソニー	4.3	26,582	6,182
JXTGホールディングス	46.3	36,902	797	本田技研工業	4.2	14,223	3,386
三菱UFJフィナンシャル・グループ	40.1	27,771	692	ソフトバンクグループ	1.5	14,151	9,434
ソフトバンクグループ	2.3	22,180	9,643	三井住友フィナンシャルグループ	3.1	14,120	4,555
日本電信電話	3.8	19,009	5,002	キーエンス	0.2	12,492	62,463
三井住友フィナンシャルグループ	3.7	16,928	4,575	アステラス製薬	6.4	11,385	1,778
電通	3.2	16,585	5,183	リコー	9.7	11,126	1,147
出光興産	2.3	13,052	5,674	N T T ドコモ	3.7	10,764	2,909
KDDI	3.5	9,742	2,783	日本たばこ産業	3.4	10,509	3,091

(注) 金額は受渡し代金です。

◆利害関係人との取引状況等 (2017年11月21日から2018年11月19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 (2018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
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
日本水産	3.5	3.5	2,478
マルハニチロ	—	0.5	2,145
<b>鉱業(0.4%)</b>			
国際石油開発帝石	15	14.1	18,210
<b>建設業(2.8%)</b>			
安藤・間	2.3	2.3	1,598
東急建設	0.6	1	1,117
コムシスホールディングス	1.1	1.1	3,119
大成建設	3.1	2.8	13,594
大林組	9.1	8.9	9,701
清水建設	9.2	9.1	8,281
長谷工コーポレーション	3.4	3.7	4,817
鹿島建設	13	6.8	10,268
西松建設	—	0.7	1,753
三井住友建設	3	2.1	1,488
前田建設工業	2	2	2,174
戸田建設	3	3.6	2,624
熊谷組	0.6	0.4	1,324
大東建託	1.1	1	14,460
NIPPPO	1	0.8	1,444
前田道路	1	0.9	1,923
五洋建設	4.4	3.4	2,301
住友林業	1.9	1.9	3,053
大和ハウス工業	9	8	27,336
積水ハウス	9.9	8.9	14,960
協和エクシオ	0.7	1.1	3,093
九電工	0.7	0.6	2,595
<b>食料品(4.2%)</b>			
森永製菓	—	0.6	2,898
江崎グリコ	0.8	0.7	3,668
カルビー	1.1	1.2	4,470
ヤクルト本社	1.7	1.9	15,694
明治ホールディングス	1.9	1.8	15,624
日本ハム	2	1.1	4,592
アサヒグループホールディングス	5.7	5.5	27,500
キリンホールディングス	13.1	11.7	29,998
サントリー食品インターナショナル	2.1	1.8	8,226
キッコーマン	2.3	1.7	10,336
味の素	6.2	6.2	11,935
キューピー	1.5	1.5	4,093
ニチレイ	1.2	1.2	3,696
東洋水産	1.5	1.4	5,299
日清食品ホールディングス	1.2	1.1	7,744
日本たばこ産業	16.6	15	42,300
<b>繊維製品(0.5%)</b>			
帝人	2.4	2.2	4,217

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	20.6	19.6	18,047
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
王子ホールディングス	12	11	7,359
大王製紙	1.6	—	—
<b>化学(7.4%)</b>			
クラレ	4.6	4.4	7,761
旭化成	17.7	18.3	22,234
昭和電工	—	1.7	7,641
住友化学	21	20	11,840
日産化学	1.7	1.5	8,955
東ソー	4	4	6,368
デンカ	1.1	1	3,380
信越化学工業	4.7	4.5	43,618
エア・ウォーター	2.5	2.1	3,836
大陽日酸	1.9	2.2	4,136
日本パーカライジング	1.1	1.5	2,179
三菱瓦斯化学	2.3	2.6	4,685
三井化学	2.5	2.3	6,791
J S R	2.8	2.4	4,190
三菱ケミカルホールディングス	19.5	16.9	15,637
ダイセル	4.1	3.7	4,728
積水化学工業	5.9	5.4	10,092
日本ゼオン	2.1	2.1	2,415
アイカ工業	0.8	0.8	2,828
宇部興産	1.3	1.3	3,368
日立化成	1.2	1.2	2,115
ダイキョーニシカワ	0.7	0.7	688
日本化薬	2	—	—
日油	1.1	1.1	4,174
花王	6.7	6.3	50,601
日本ペイントホールディングス	2.2	2.1	7,717
関西ペイント	3.1	2.8	5,031
D I C	1.2	1.1	3,844
資生堂	5	5.1	37,536
ライオン	3.9	3.5	7,227
コーセー	0.5	0.4	7,508
シーズ・ホールディングス	0.5	0.3	1,761
ポーラ・オルビスホールディングス	—	1.1	3,536
小林製薬	0.7	0.7	5,278
日東電工	2.1	1.9	11,472
ニフコ	0.5	1	2,870
ユニ・チャーム	5.7	5.5	18,430
<b>医薬品(5.9%)</b>			
協和発酵キリン	3.7	3.2	7,238
武田薬品工業	10	10.2	45,400
アステラス製薬	27.9	23.8	40,674
大日本住友製薬	1.8	1.9	5,605

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	千円	
塩野義製菓	4	3.4	26,112	
田辺三菱製菓	3.2	2.7	4,584	
中外製菓	2.8	2.7	19,305	
科研製菓	0.4	0.5	2,725	
エーザイ	3.2	3.1	31,186	
小野薬品工業	7.2	6.2	16,972	
久光製菓	0.8	0.8	5,712	
参天製菓	5	4.9	9,050	
ツムラ	0.9	0.9	3,177	
沢井製菓	0.4	0.5	2,835	
第一三共	8	7.4	30,451	
大塚ホールディングス	5.6	4.9	25,367	
<b>石油・石炭製品(0.9%)</b>				
出光興産	—	2	8,270	
JXTGホールディングス	—	44	29,994	
コスモエネルギーホールディングス	—	0.7	2,383	
<b>ゴム製品(0.9%)</b>				
横浜ゴム	1.5	1.5	3,507	
東洋ゴム工業	1.7	—	—	
ブリヂストン	9.6	7.9	34,143	
住友ゴム工業	2.6	2.5	3,865	
<b>ガラス・土石製品(0.8%)</b>				
AGC	2.7	2.6	9,958	
住友大阪セメント	5	—	—	
太平洋セメント	1.8	1.6	6,088	
OTTO	2.2	2	8,800	
日本碍子	3	3.2	5,366	
日本特殊陶業	2.3	2.2	5,420	
ニチアス	—	0.7	1,592	
<b>鉄鋼(0.9%)</b>				
新日鐵住金	12	11.4	24,156	
ジェイエフイーホールディングス	7.5	6.9	14,338	
東京製鐵	0.6	1.4	1,349	
日立金属	3.1	2.7	3,507	
<b>非鉄金属(0.8%)</b>				
日本軽金属ホールディングス	5.7	8.2	2,033	
三菱マテリアル	1.8	1.6	4,856	
住友金属鉱山	3.4	3.5	11,060	
DOWAホールディングス	0.6	0.7	2,523	
古河電気工業	—	0.7	2,285	
住友電気工業	10.4	9.6	15,115	
<b>金属製品(0.3%)</b>				
SUMCO	—	2.7	4,239	
三和ホールディングス	2.6	2.6	3,484	
リンナイ	0.5	0.5	4,215	
東プレ	—	0.5	1,127	
日本発條	2.8	2.8	2,749	
<b>機械(5.0%)</b>				
アマダホールディングス	4	4	4,608	
オーエスジー	1.1	1.3	2,827	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
DMG森精機	1.3	1.7	2,504	
ディスコ	0.4	0.3	5,046	
ニューフレアテクノロジー	0.1	—	—	
ナブテスコ	1.5	1.3	3,706	
三井海洋開発	—	0.3	842	
SMC	0.9	0.8	30,448	
小松製作所	13.1	11.7	34,427	
住友重機械工業	1.5	1.5	5,460	
日立建機	1.3	1	3,065	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.3	0.4	1,412	
クボタ	14.6	13.9	26,938	
荏原製作所	1.1	1.1	3,311	
ダイキン工業	3.7	3.5	41,037	
椿本チエイン	2	0.3	1,269	
ダイフク	1.3	1.4	7,742	
タダノ	1.3	1.3	1,654	
平和	0.5	0.8	1,928	
竹内製作所	0.2	0.4	893	
TPR	0.4	0.4	1,088	
ホシザキ	0.8	0.8	6,704	
日本精工	5.4	5.3	5,575	
ジェイテクト	3.1	2.5	3,402	
THK	1.7	1.7	4,248	
イーグル工業	0.6	—	—	
マキタ	3.5	3.1	13,981	
三菱重工業	4.5	4.3	18,429	
<b>電気機器(14.1%)</b>				
コニカミノルタ	7	5.9	6,348	
ブラザー工業	3.1	3.2	6,070	
ミネベアミツミ	5.2	4.7	7,773	
日立製作所	65	11.6	38,465	
三菱電機	27.1	25.9	38,435	
富士電機	7	1.6	5,408	
安川電機	3.3	3	10,155	
日本電産	3.3	3.1	44,469	
オムロン	2.9	2.7	12,838	
日本電気	3.6	3.3	11,121	
富士通	28	2.5	17,712	
ルネサスエレクトロニクス	1.2	2.7	1,544	
セイコーエプソン	4.2	3.2	5,980	
アルバック	0.5	0.6	2,508	
エレコム	0.2	0.2	567	
パナソニック	31	29.5	32,892	
富士通ゼネラル	0.7	0.7	1,087	
日立国際電気	0.5	—	—	
ソニー	15.8	13.2	77,761	
TDK	1.5	1.4	12,390	
アルプス電気	2.1	2.4	6,043	
クラリオン	3	0.2	494	
ヒロセ電機	0.4	0.4	4,804	



銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額 千円
日本航空電子工業	1	—	—	—
横河電機	2.5	2.5	5,385	—
日本光電工業	1.2	1.1	3,547	—
堀場製作所	0.6	0.5	2,525	—
アドバンテスト	1.4	1.8	3,981	—
キーエンス	1.3	1.2	73,920	—
シスメックス	2.1	2	13,100	—
OBARA GROUP	0.2	0.1	447	—
スタンレー電気	2	1.8	5,985	—
カシオ計算機	2.5	2.3	3,636	—
ファナック	2.6	2.5	47,500	—
浜松ホトニクス	1.9	1.9	7,172	—
京セラ	4.5	3.9	22,908	—
村田製作所	2.8	2.7	43,956	—
小糸製作所	1.7	1.5	9,000	—
ミツバ	0.6	—	—	—
SCREENホールディングス	0.5	0.5	2,805	—
キャノン	14.6	13.8	44,698	—
リコー	8.7	—	—	—
東京エレクトロン	1.8	1.7	25,364	—
<b>輸送用機器(6.9%)</b>				
トヨタ紡織	0.4	0.9	1,648	—
豊田自動織機	2.2	2.1	11,865	—
デンソー	6	5.7	29,206	—
川崎重工業	2.2	2.1	5,514	—
日産自動車	32	30.5	30,667	—
いすゞ自動車	7.8	8.2	12,923	—
トヨタ自動車	12.2	9.5	62,814	—
日野自動車	4	3.2	3,408	—
日信工業	0.6	—	—	—
NOK	1.5	1.4	2,301	—
アイシン精機	2.3	2.1	9,271	—
マツダ	8.4	8.1	9,553	—
本田技研工業	23.4	21.5	68,348	—
スズキ	5.3	4.7	25,083	—
SUBARU	8.4	8	20,212	—
ヤマハ発動機	3.8	3.8	8,721	—
豊田合成	1.1	0.8	1,753	—
シマノ	1.1	1	15,570	—
テイ・エス テック	0.6	0.6	1,989	—
<b>精密機器(1.9%)</b>				
テルモ	4.3	3.7	23,435	—
島津製作所	3.3	3.3	8,276	—
オリンパス	4.1	3.8	14,174	—
HOYA	5.5	5.2	35,604	—
朝日インテック	0.7	1.2	6,348	—
セイコーホールディングス	0.2	—	—	—
<b>その他製品(1.9%)</b>				
パンダイナムコホールディングス	2.9	2.7	13,338	—
パイロットコーポレーション	0.5	0.4	2,264	—

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額 千円
アシックス	2.9	2.6	4,118	—
ヤマハ	1.8	1.5	7,380	—
ビジョン	1.6	1.5	7,560	—
任天堂	—	1.6	52,960	—
<b>電気・ガス業(1.8%)</b>				
中部電力	8.2	7.8	13,076	—
関西電力	10.8	10.7	19,447	—
東北電力	6.5	6	9,036	—
九州電力	—	5.3	7,218	—
電源開発	2.1	2.1	6,232	—
東京瓦斯	6	5.1	14,540	—
大阪瓦斯	5.3	5	10,565	—
東邦瓦斯	1.4	1.2	5,304	—
<b>陸運業(5.1%)</b>				
東武鉄道	2.9	2.7	8,626	—
相鉄ホールディングス	1	1.2	4,068	—
東京急行電鉄	7.6	6.9	12,972	—
小田急電鉄	4	4.1	9,975	—
京王電鉄	1.6	1.5	9,285	—
京成電鉄	2	1.9	6,754	—
東日本旅客鉄道	4.8	4.6	46,782	—
西日本旅客鉄道	2.4	2.3	18,273	—
東海旅客鉄道	2.4	2.3	50,335	—
西武ホールディングス	3.9	3.4	7,374	—
西日本鉄道	0.8	—	—	—
近鉄グループホールディングス	2.6	2.4	11,016	—
阪急阪神ホールディングス	3.4	3.3	12,639	—
南海電気鉄道	1.7	—	—	—
京阪ホールディングス	1.6	1.5	6,982	—
名古屋鉄道	2.7	2.7	7,568	—
日本通運	1	1	7,330	—
ヤマトホールディングス	4.7	4.3	12,233	—
山九	0.6	0.6	3,288	—
日立物流	0.7	0.4	1,254	—
<b>空運業(0.8%)</b>				
日本航空	4.8	4.5	18,886	—
ANAホールディングス	5	4.5	18,256	—
<b>情報・通信業(7.5%)</b>				
新日鉄住金ソリューションズ	0.6	0.4	1,290	—
T I S	—	0.8	4,128	—
ネクソン	3	6.2	6,931	—
コロブラ	1	1	838	—
ティーガイア	0.5	0.3	703	—
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5.5	6.1	1,488	—
野村総合研究所	1.8	1.6	8,192	—
オービック	0.8	0.9	8,811	—
ヤフー	20.4	17	5,253	—
トレンドマイクロ	1.3	1.3	8,294	—
日本オラクル	0.4	0.4	2,872	—
伊藤忠テクノソリューションズ	0.6	1.2	2,454	—

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	千円	
大塚商会	0.8	1.4	5,222	
日本ユニシス	—	0.7	1,919	
日本テレビホールディングス	2.5	2.2	3,962	
日本電信電話	12	14.1	64,662	
KDDI	22.1	22.4	57,108	
光通信	0.3	0.3	5,577	
NTTドコモ	19.7	18.2	47,119	
GMOインターネット	1.3	0.9	1,386	
東宝	1.8	1.7	6,358	
エヌ・ティ・ティ・データ	7.8	6.7	8,944	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.3	1.2	4,338	
カブコン	—	1.1	2,437	
SCSK	0.7	0.7	3,125	
コナミホールディングス	1.1	1.1	5,412	
ソフトバンクグループ	7.8	8.6	79,550	
<b>卸売業(5.1%)</b>				
双日	16.8	14.2	5,609	
アルフレッサ ホールディングス	2.8	2.8	8,652	
神戸物産	0.2	0.4	1,284	
シブヘルスケアホールディングス	0.3	0.5	2,177	
第一興商	0.6	0.5	2,635	
メディカルホールディングス	2.7	2.8	7,238	
伊藤忠商事	19.6	18.7	37,848	
丸紅	21.4	25.1	21,646	
豊田通商	2.9	2.8	11,102	
兼松	1.6	1	1,464	
三井物産	22.7	21	37,180	
日立ハイテクノロジーズ	1	0.8	3,280	
住友商事	16.7	15	26,010	
三菱商事	18.8	17.9	53,914	
阪和興業	0.6	0.5	1,535	
岩谷産業	0.6	0.6	2,286	
東邦ホールディングス	1.1	0.7	2,194	
サンリオ	0.5	—	—	
PALTAC	—	0.4	2,356	
日鉄住金物産	0.3	0.2	1,014	
ミスミグループ本社	2.9	3.2	7,382	
<b>小売業(5.0%)</b>				
ローソン	0.7	0.7	4,998	
エービーシー・マート	0.4	0.4	2,508	
アダストリア	0.5	0.5	1,006	
セリア	0.7	0.7	3,164	
ビックカメラ	1.3	1.3	1,989	
MonotaRO	0.8	1.6	4,476	
J. フロント リテイリング	3.3	3.3	5,299	
マツモトキヨシホールディングス	0.5	1	4,220	
ZOZO	2.7	2.7	6,309	
ウエルシアホールディングス	0.8	0.7	4,193	
クリエイティブSDホールディングス	0.5	0.5	1,515	
すかいらーくホールディングス	—	2.4	4,219	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
コスモス薬品	0.1	0.1	2,173	
セブン&アイ・ホールディングス	11.2	10.6	52,841	
ツルハホールディングス	0.5	0.6	6,846	
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.2	1,658	
ノジマ	0.1	0.5	1,322	
良品計画	0.4	0.4	11,800	
ドンキホーテホールディングス	1.7	1.6	11,344	
ゼンショーホールディングス	—	1.4	3,819	
ユナイテッドアローズ	0.2	0.3	1,189	
スギホールディングス	0.6	0.6	3,174	
ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.9	0.7	10,787	
日本瓦斯	0.6	0.5	1,892	
しまむら	0.3	0.3	2,829	
高島屋	4	—	—	
丸井グループ	—	2.2	5,425	
イオン	10.4	9.8	26,259	
イズミ	0.4	0.5	3,265	
ヤオコー	0.4	0.3	1,893	
ケーズホールディングス	1.2	2.7	3,283	
アインホールディングス	0.4	0.3	2,673	
ニトリホールディングス	1.1	1.1	16,054	
バローホールディングス	0.7	—	—	
ファーストリテイリング	0.4	0.3	17,622	
サンドラッグ	1.2	1	3,970	
<b>銀行業(6.2%)</b>				
めぶきフィナンシャルグループ	12.3	13.3	4,482	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	0.2	—	—	
九州フィナンシャルグループ	5.4	5.4	2,716	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	16.8	16.2	8,051	
新生銀行	2.5	2.1	3,370	
あおぞら銀行	1.7	1.5	5,662	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	88.6	117.4	75,065	
りそなホールディングス	30.3	28	16,086	
三井住友トラスト・ホールディングス	5.4	5	22,195	
三井住友フィナンシャルグループ	15.5	16.1	67,346	
千葉銀行	9	9.3	6,547	
群馬銀行	5.2	—	—	
静岡銀行	7	6.5	6,448	
スルガ銀行	2.7	—	—	
ほくほくフィナンシャルグループ	1.8	—	—	
広島銀行	4	4	2,760	
中国銀行	2.9	—	—	
セブン銀行	10.4	7.8	2,901	
みずほフィナンシャルグループ	349.4	344	65,463	
山口フィナンシャルグループ	3	—	—	
<b>証券・商品先物取引業(1.1%)</b>				
FPG	0.2	0.7	870	
SBIホールディングス	3.1	3.1	8,782	
ジャフコ	0.5	—	—	
大和証券グループ本社	23	21	13,097	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
野村ホールディングス	48.2	46.7	23,788	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3.2	2.4	1,353	
松井証券	0.5	1.3	1,558	
カブドットコム証券	2.1	—	—	
<b>保険業(3.1%)</b>				
SOMPOホールディングス	5.4	5	22,800	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	7.2	6.7	23,094	
ソニーフィナンシャルホールディングス	2.1	2.1	4,968	
第一生命ホールディングス	15.1	14.4	29,268	
東京海上ホールディングス	10.1	9.2	50,876	
T&Dホールディングス	7.9	7.8	13,123	
<b>その他金融業(1.3%)</b>				
全国保証	0.9	0.7	2,716	
芙蓉総合リース	0.2	0.3	1,860	
興銀リース	0.2	—	—	
東京センチュリー	0.6	0.5	2,655	
イオンフィナンシャルサービス	2.1	1.6	3,592	
オリエントコーポレーション	4.3	4.3	774	
日立キャピタル	0.8	0.6	1,679	
オリックス	17.9	17	30,634	
三菱UFJリース	6.5	6.5	3,789	
日本取引所グループ	8.1	6.9	14,069	
<b>不動産業(2.8%)</b>				
いちご	3.2	3.2	1,248	
ヒューリック	4.9	5.2	5,496	
野村不動産ホールディングス	2.2	1.7	3,666	
プレサンスコーポレーション	0.8	0.2	266	
オープンハウス	0.2	0.4	1,490	
東急不動産ホールディングス	6.3	7	4,249	
飯田グループホールディングス	2.4	2.1	4,237	
パーク24	1.6	1.5	4,507	
三井不動産	13.4	13.5	37,212	
三菱地所	20	17.8	31,408	
東京建物	2.8	2.8	3,256	
住友不動産	6	5.8	23,959	
レオパレス21	4.5	3.1	1,370	
スターツコーポレーション	0.1	0.4	1,050	
イオンモール	1.9	1.3	2,728	
エヌ・ティ・ティ都市開発	2.2	1.6	2,689	
<b>サービス業(4.3%)</b>				
ミクシィ	0.6	0.6	1,504	
日本M&Aセンター	0.9	1.8	4,656	
パーソルホールディングス	2.5	2.3	4,558	
総合警備保障	1	1	5,320	
カカコム	2.1	1.9	3,908	
ディップ	0.2	0.4	947	
エムスリー	2.5	5.2	9,344	
ディー・エヌ・エー	1.7	1.3	2,752	
博報堂DYホールディングス	3.5	3.5	6,030	
電通	—	3	14,985	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
オリエンタルランド	3.1	2.9	31,653	
リゾートトラスト	1.2	1.1	2,016	
ユー・エス・エス	3	3.1	5,846	
サイバーエージェント	1.8	1.6	7,928	
楽天	12.8	11.5	10,810	
エン・ジャパン	—	0.3	1,246	
テクノプロ・ホールディングス	—	0.5	2,700	
リクルートホールディングス	—	17.7	54,268	
リログループ	1.4	1.4	3,949	
カナモト	0.3	0.3	1,032	
セコム	2.8	2.6	23,454	
メイテック	0.4	0.3	1,456	
イオンディライト	0.2	0.3	1,200	
<b>合計</b>	<b>株数・金額</b>	<b>2,253</b>	<b>2,150</b>	<b>4,667,920</b>
	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>400</b>	<b>400</b>	<b>&lt;96.0%&gt;</b>

(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) ー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
	百万円	百万円
国内 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 (2018年11月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	4,667,920	95.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	199,001	4.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,866,921	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

(2018年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,865,580,901円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	146,227,023
株 式 (評価額)	4,667,920,130
未 収 配 当 金	43,245,248
差 入 委 託 証 拠 金	8,188,500
(B) 負 債	4,010,756
未 払 金	810,756
未 払 解 約 金	3,200,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	4,861,570,145
元 本	3,559,959,118
次 期 繰 越 損 益 金	1,301,611,027
(D) 受 益 権 総 口 数	3,559,959,118口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,656円

(注記事項)

期首元本額	3,670,699,124円
期中追加設定元本額	763,345,774円
期中一部解約元本額	874,085,780円

(当期末元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	3,559,959,118円
------------------	----------------

◆損益の状況

当期 (自2017年11月21日 至2018年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	111,812,073円
受 取 配 当 金	111,808,759
そ の 他 収 益 金	91,484
支 払 利 息	△88,170
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△332,257,793
売 買 益	281,867,602
売 買 損	△614,125,395
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	2,112,080
取 引 益	31,848,088
取 引 損	△29,736,008
(D) そ の 他 費 用 等	△41,819
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△218,375,459
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,607,628,480
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	330,886,226
(H) 解 約 差 損 益 金	△418,528,220
(I) 計 (E + F + G + H)	1,301,611,027
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,301,611,027

(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。