

■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7期（決算日 2020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：0120-202-900(2021年6月30日まで)
03-3593-5911※(2021年7月1日から)
※通話料は有料です
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/>

■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
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
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

(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。

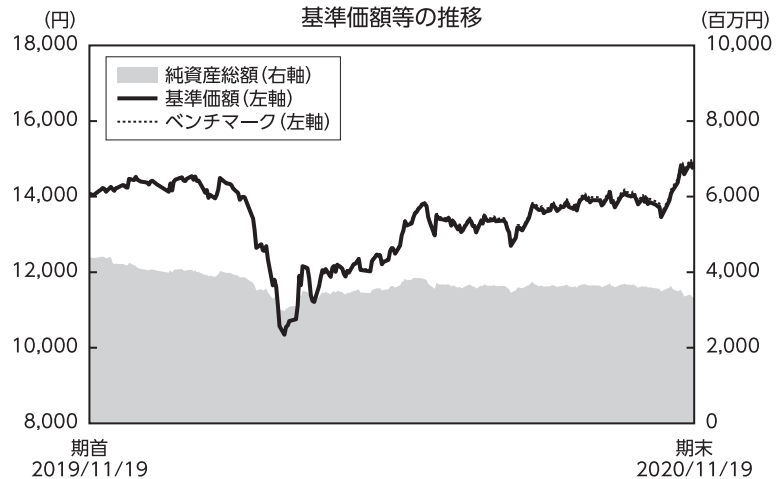
■当期中の基準価額と市況等の推移

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	%	%	%
2019年11月19日	14,090	—	17,358.40	—	98.7	1.2
11月末	14,127	0.3	17,406.85	0.3	97.3	2.6
12月末	14,321	1.6	17,660.14	1.7	97.8	2.1
2020年1月末	14,047	△0.3	17,334.61	△0.1	99.1	0.8
2月末	12,642	△10.3	15,608.03	△10.1	97.2	2.7
3月末	11,840	△16.0	14,619.02	△15.8	95.0	4.9
4月末	12,351	△12.3	15,263.44	△12.1	96.7	3.2
5月末	13,235	△6.1	16,371.21	△5.7	97.0	2.9
6月末	13,223	△6.2	16,361.03	△5.7	96.8	3.2
7月末	12,696	△9.9	15,717.99	△9.5	97.0	3.0
8月末	13,738	△2.5	17,015.46	△2.0	97.0	3.0
9月末	13,850	△1.7	17,167.47	△1.1	97.3	2.6
10月末	13,457	△4.5	16,690.07	△3.9	98.3	1.6
(期末)						
2020年11月19日	14,826	5.2	18,389.39	5.9	96.0	3.9

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第7期首	14,090円
第7期末	14,826円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	5.2%



(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、2019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 世界各国で景気を支えるための金融および財政政策が発表されたことで景気回復期待が高まったこと（2020年4月～6月）
- ② 米国において大型財政支出への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に進展がみられたこと（2020年10月～11月）

下落要因

- ① 新型コロナウイルスの感染拡大により世界的に景気見通しが悪化したこと（2020年2月～3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+5.2%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（+5.9%）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7期 (2019年11月20日 ～2020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)	88円 (39) (44) (4)	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)	0.009 (0.001) (0.008)	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 (1) (5) (3)	0.071 (0.010) (0.038) (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	98	0.740	

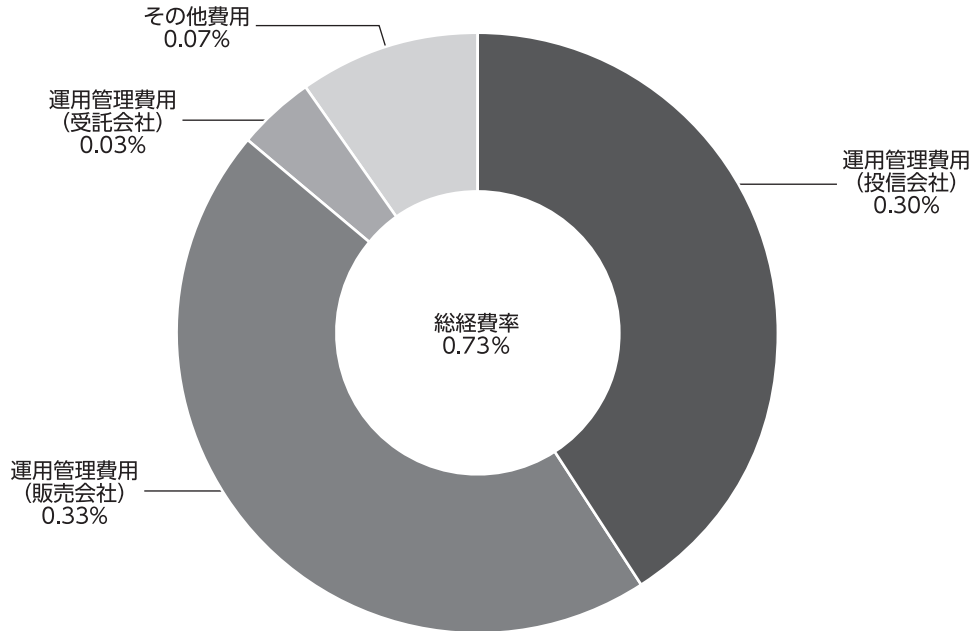
期中の平均基準価額は13,293円です。

- (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0.73%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（2019年11月20日から2020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	189,264	240,008	1,048,160	1,533,806

(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	1,586,387千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,598,350千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.44

(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（2019年11月20日から2020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（2020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	3,011,939	2,153,042	3,336,355

(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2,153,042千口です。

■投資信託財産の構成 (2020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	3,336,355	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	80,718	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	3,417,073	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

(2020年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,417,073,000円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,051,861
アムンディ・JPX日経400 オープンマザーファンド(評価額)	3,336,355,139
未 収 入 金	62,666,000
(B) 負 債	79,969,375
未 払 解 約 金	66,007,722
未 払 信 託 報 酬	12,042,755
未 払 利 息	44
そ の 他 未 払 費 用	1,918,854
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,337,103,625
元 本	2,250,864,930
次 期 繰 越 損 益 金	1,086,238,695
(D) 受 益 権 総 口 数	2,250,864,930口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,826円

(注記事項)

期首元本額	3,126,998,901円
期中追加設定元本額	312,003,052円
期中一部解約元本額	1,188,137,023円

■損益の状況

当期 (自2019年11月20日 至2020年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 5,267円
支 払 利 息	△ 5,267
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	229,056,607
売 買 益	275,528,848
売 買 損	△ 46,472,241
(C) 信 託 報 酬 等	△ 27,049,044
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	202,002,296
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	349,456,223
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	534,780,176
(配 当 等 相 当 額)	(586,549,007)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 51,768,831)
(G) 計 (D+E+F)	1,086,238,695
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	1,086,238,695
追 加 信 託 差 損 益 金	534,780,176
(配 当 等 相 当 額)	(588,818,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 54,038,640)
分 配 準 備 積 立 金	551,458,519

(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7期
	(2019年11月20日～2020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	5,065

(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7期》

決算日：2020年11月19日

(計算期間：2019年11月20日～2020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
		期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
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

(注1) 株式先物比率は、買建比率ー売建比率です。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。

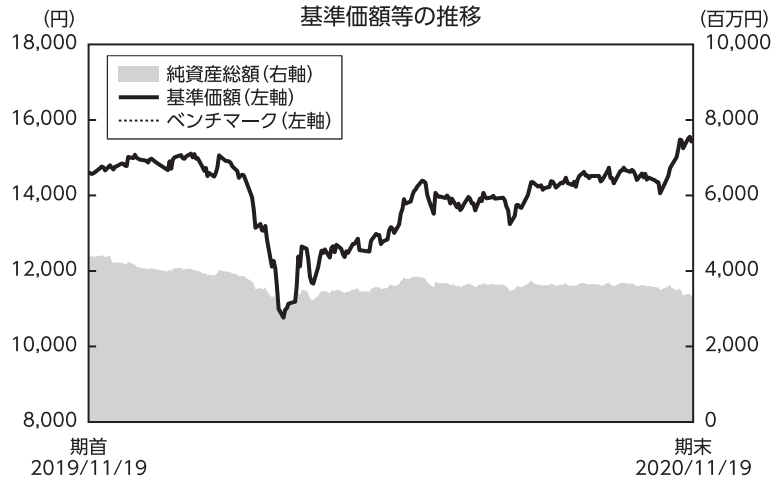
■当期中の基準価額と市況等の推移

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
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期 首)	円	%	ポイント	%	%	%
2019年11月19日	14,619	—	17,358.40	—	98.7	1.2
11月末	14,661	0.3	17,406.85	0.3	97.3	2.6
12月末	14,871	1.7	17,660.14	1.7	97.8	2.1
2020年1月末	14,596	△ 0.2	17,334.61	△ 0.1	99.1	0.8
2月末	13,143	△10.1	15,608.03	△10.1	97.3	2.7
3月末	12,317	△15.7	14,619.02	△15.8	95.0	4.9
4月末	12,856	△12.1	15,263.44	△12.1	96.8	3.2
5月末	13,784	△ 5.7	16,371.21	△ 5.7	97.1	2.9
6月末	13,781	△ 5.7	16,361.03	△ 5.7	96.8	3.2
7月末	13,240	△ 9.4	15,717.99	△ 9.5	97.0	3.0
8月末	14,335	△ 1.9	17,015.46	△ 2.0	97.0	3.0
9月末	14,461	△ 1.1	17,167.47	△ 1.1	97.4	2.6
10月末	14,059	△ 3.8	16,690.07	△ 3.9	98.3	1.6
(期 末)						
2020年11月19日	15,496	6.0	18,389.39	5.9	96.0	3.9

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第7期首	14,619円
第7期末	15,496円
騰落率	6.0%



(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、2019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 世界各国で景気を支えるための金融および財政政策が発表されたことで景気回復期待が高まったこと（2020年4月～6月）
- ② 米国において大型財政支出への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に進展がみられたこと（2020年10月～11月）

下落要因

- ① 新型コロナウイルスの感染拡大により世界的に景気見通しが悪化したこと（2020年2月～3月）

【投資環境】

＜国内株式市場＞

米中貿易摩擦が激化しなかったことを好感した世界の株式市場は2019年末にかけて堅調に推移しました。年明け後、新型コロナウイルスの感染拡大が世界中の至るところで経済活動に強く影響したことから、株式市場は大暴落しました。しかし、主要中央銀行が追加金融緩和策を相次いで打ち出し、各国が財政による景気刺激策の導入にも積極的な姿勢を示したことから株式市場は急反発し、緊急事態宣言解除後の経済活動再開への期待感もあり一段高となりました。その後はやや狭いレンジ内でのみみ合いを続けながらも、米国の財政出動期待の高まりを好感して、底堅い動きをみせていました。米大統領選を目前に控え、一時やや神経質な展開となったものの、結果はバイデン氏の勝利がほぼ確定的となり大規模財政支出への期待から、さらに新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったとの発表を好感し、世界的に株式市場は上昇しそのまま期末を迎えました。

【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】

当期の基準価額の騰落率は+6.0%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（+5.9%）を0.1%上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。

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7期 (2019年11月20日 ～2020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% (0.001) (0.008)	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	0.009	

期中の平均基準価額は13,842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 (2019年11月20日から2020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 76 (△212)	千円 156,440 ()	千株 605	千円 1,429,946

(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 1,948	百万円 1,884	百万円 102	百万円 102

■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	1,586,387千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,598,350千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.44

(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 (2019年11月20日から2020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
任天堂	0.1	4,730	47,300	任天堂	0.5	26,098	52,197
キーエンス	0.1	4,544	45,440	ソニー	3.2	25,900	8,093
日本電信電話	1.1	2,733	2,484	キーエンス	0.5	23,347	46,695
ユニ・チャーム	0.6	2,699	4,499	トヨタ自動車	2.9	21,383	7,373
トヨタ自動車	0.4	2,643	6,609	リクルートホールディングス	4.9	20,721	4,228
ソニー	0.4	2,622	6,555	ソフトバンクグループ	3.5	20,081	5,737
KDDI	0.8	2,586	3,233	日本電信電話	6.5	19,887	3,059
ソフトバンクグループ	0.6	2,529	4,215	N T T ドコモ	5.8	19,222	3,314
アサヒグループホールディングス	0.6	2,296	3,827	武田薬品工業	4.8	19,096	3,978
東京エレクトロン	0.1	2,210	22,109	三菱UFJフィナンシャル・グループ	37.3	18,530	496

(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 (2019年11月20日から2020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 (2020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(0.1%)			
日本水産	3.5	2.6	1,086
マルハニチロ	0.5	0.5	1,140
鉱業(0.2%)			
国際石油開発帝石	13.3	9	5,175
建設業(2.3%)			
安藤・間	2.3	1.5	1,081
東急建設	1	1	496
コムシスホールディングス	1.1	0.8	2,556
大成建設	2.5	1.7	6,120
大林組	7.6	5.6	5,454
清水建設	7.7	5.8	4,703
長谷工コーポレーション	2.3	2.2	2,615
鹿島建設	5.3	3.9	5,335
西松建設	0.7	0.4	789
三井住友建設	2.1	1.3	556
前田建設工業	1.8	0.8	679
戸田建設	2.6	2.6	1,645
熊谷組	0.4	0.3	744
大東建託	0.9	0.6	6,066
NIPPPO	0.7	0.4	1,101
五洋建設	3.4	1.5	1,183
住友林業	1.8	1.5	2,797
大和ハウス工業	7.1	5.1	16,932
積水ハウス	8.2	5.7	10,901
協和エクシオ	1.1	0.9	2,485
九電工	0.6	0.4	1,220
食料品(3.5%)			
森永製菓	0.6	0.3	1,192
江崎グリコ	0.7	0.4	1,766
カルビー	0.9	0.7	2,089
ヤクルト本社	1.6	1.2	6,144
明治ホールディングス	1.6	1.1	8,415
日本ハム	0.8	0.7	3,048
アサヒグループホールディングス	4.9	3.8	15,416
キリンホールディングス	10	7.4	16,431
サントリー食品インターナショナル	1.6	1.2	4,680
キッコーマン	1.7	1.2	7,980
味の素	5.4	3.6	8,128
キューピー	1.2	1	2,220
アリアケジャパン	0.2	0.1	717
ニチレイ	1.1	0.9	2,727
東洋水産	1.3	0.9	4,752

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	1	0.7	6,076
日本たばこ産業	13.6	9.1	19,605
繊維製品(0.3%)			
帝人	1.5	1.5	2,773
東レ	17.2	11.5	6,514
ゴールドウイン	0.4	0.3	2,016
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	9.3	7.4	3,692
化学(7.6%)			
クラレ	3.9	2.2	2,424
旭化成	15.3	10.9	10,777
昭和電工	1.6	1.3	2,522
住友化学	16.9	13.2	5,029
日産化学	1.3	0.9	5,715
東ソー	3.7	2.4	4,099
トクヤマ	0.7	0.3	662
デンカ	0.8	0.7	2,254
信越化学工業	4	2.9	43,688
エア・ウォーター	1.6	1.6	2,851
日本酸素ホールディングス	2.3	1.7	3,031
三菱瓦斯化学	2.2	1.6	3,121
三井化学	2	1.6	4,780
JSR	2.3	1.5	4,195
三菱ケミカルホールディングス	15.8	10.3	6,094
ダイセル	2.9	2.3	1,821
積水化学工業	4.6	3.3	5,715
アイカ工業	0.8	0.4	1,534
宇部興産	1.3	0.9	1,639
日立化成	1	—	—
ダイキョーニシカワ	0.7	0.7	475
日油	0.9	0.6	2,763
花王	5.6	4	31,440
日本ペイントホールディングス	2	1.4	16,702
関西ペイント	2.7	1.8	5,364
DIC	1	0.7	1,800
資生堂	4.6	3.4	24,483
ライオン	3.1	2.3	5,819
コーセー	0.4	0.3	4,686
ポーラ・オルビスホールディングス	1.1	0.5	1,017
小林製薬	0.7	0.5	5,800
日東電工	1.7	1.2	9,828
ニフコ	1	0.7	2,439
ユニ・チャーム	4.5	3.6	18,568

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
医薬品 (6.8%)			
協和キリン	2.5	1.8	4,955
武田薬品工業	15	10.8	39,150
アステラス製薬	20.7	14.7	23,468
大日本住友製薬	1.6	1.3	1,801
塩野義製薬	3	2.2	12,324
田辺三菱製薬	2.5	—	—
日本新薬	0.6	0.4	3,052
中外製薬	2.5	5.3	24,247
科研製薬	0.4	0.3	1,185
エーザイ	2.9	2	15,596
小野薬品工業	5.2	4	12,696
久光製薬	0.7	0.4	2,364
参天製薬	4	2.9	4,802
沢井製薬	0.5	0.3	1,404
第一三共	6.7	14.6	52,560
大塚ホールディングス	4.5	3.6	15,562
ペプチドリーム	1.3	0.9	4,315
石油・石炭製品 (0.4%)			
出光興産	2.7	1.7	3,768
ENEOSホールディングス	37.6	25	9,380
コスモエネルギーホールディングス	0.5	0.5	873
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	1.5	0.9	1,475
ブリヂストン	7.2	4.6	16,923
住友ゴム工業	2	1.6	1,640
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	2.2	1.6	5,640
太平洋セメント	1.3	1.1	3,207
東海カーボン	2.7	1.3	1,543
TOTO	1.7	1.2	7,128
日本碍子	2.8	2.2	3,586
日本特殊陶業	2.1	1.5	2,652
ニチアス	0.7	0.3	693
鉄鋼 (0.5%)			
日本製鉄	10.7	7.1	8,399
ジェイ・エフ・イー・ホールディングス	5.7	5	4,485
日立金属	2.7	1.7	2,374
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	2.5	0.2	348
住友金属鉱山	3.1	2.1	7,700
DOWAホールディングス	0.5	0.5	1,727
古河電気工業	0.7	0.5	1,204
住友電気工業	8.9	5.9	7,330
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	2.8	2.3	3,976
三和ホールディングス	2.6	1.7	2,097
リンナイ	0.4	0.3	3,564
東プレ	0.5	0.1	120

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械 (5.8%)			
アマダ	2.9	2.4	2,474
オーエスジー	1	1	1,871
DMG森精機	1.3	1	1,507
ダイスコ	0.3	0.2	6,030
ナブテスコ	1.3	1.1	4,427
三井海洋開発	0.3	0.3	499
SMC	0.7	0.5	30,290
小松製作所	10.6	7.5	18,810
住友重機械工業	1.3	1.1	2,638
日立建機	1	0.8	2,259
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.5	0.4	3,064
クボタ	12.8	8.8	18,515
ダイキン工業	3	2.2	52,459
ダイフク	1.2	0.9	10,296
竹内製作所	0.4	0.3	728
T P R	0.4	0.3	404
日本精工	4.6	2.7	2,367
ジェイテクト	2.5	1.7	1,475
THK	1.3	0.9	2,731
マキタ	3.1	2.3	12,213
三菱重工業	4.1	3	7,798
I H I	1.7	1.2	1,810
電気機器 (17.7%)			
ユニカミノルタ	5.3	4.4	1,355
ブラザー工業	2.9	2.3	4,450
ミネベアミツミ	4.6	3.3	6,834
日立製作所	11.3	8.1	32,100
三菱電機	23.5	16.7	24,523
富士電機	1.4	0.9	3,046
安川電機	2.6	1.8	8,604
東芝テック	0.3	0.2	814
日本電産	2.8	4.1	46,535
日新電機	0.6	0.6	682
オムロン	2.1	1.5	12,780
日本電気	2.9	2.1	11,655
富士通	2.3	1.6	21,632
ルネサスエレクトロニクス	11.1	7.6	6,840
セイコーエプソン	3.1	1.8	2,613
アルバック	0.5	0.3	1,164
エレコム	0.2	0.2	883
パナソニック	27.3	18.9	20,534
富士通ゼネラル	0.7	0.4	1,236
ソニー	10	7.2	66,592
TDK	1.1	0.8	10,896
アルプスアルパイン	2.1	1.6	2,168
ヒロセ電機	0.4	0.3	4,308
横河電機	2.1	1.6	2,958
アズビル	1.6	1.1	5,038

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本光電工業	1	0.6	2,013
堀場製作所	0.5	0.3	1,662
アドバンテスト	1.7	1.3	9,152
キーエンス	1.6	1.2	62,772
シスメックス	1.7	1.2	12,066
OBARA GROUP	0.2	0.1	331
レーザーテック	0.5	0.7	6,902
スタンレー電気	1.6	1.1	3,265
カシオ計算機	2.3	1.3	2,627
ファナック	2.2	1.6	39,336
浜松ホトニクス	1.7	1.3	7,345
京セラ	3.4	2.4	14,356
太陽誘電	1.1	0.8	3,344
村田製作所	6.9	5	40,805
小糸製作所	1.4	1	6,250
SCREENホールディングス	0.4	0.3	1,860
キヤノン	12.7	8.7	16,560
東京エレクトロン	1.6	1.1	34,980
輸送用機器 (5.7%)			
トヨタ紡織	0.5	0.5	712
豊田自動織機	1.8	1.4	10,304
デンソー	5.3	3.8	19,402
川崎重工業	1.9	1.4	2,223
いすゞ自動車	7	5.1	4,875
トヨタ自動車	9	6.5	47,456
日野自動車	2.5	2	1,828
アイシン精機	1.8	1.3	4,088
マツダ	7.1	4.4	2,767
本田技研工業	18.3	13.3	39,387
スズキ	4.8	3.4	18,176
SUBARU	7.5	5.4	11,583
ヤマハ発動機	2.7	2.2	4,303
豊田合成	0.8	0.6	1,696
シマノ	0.9	0.6	14,028
テイ・エス テック	0.6	0.4	1,250
精密機器 (3.1%)			
テルモ	6.6	4.9	20,790
島津製作所	2.9	1.9	6,792
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	531
東京精密	0.3	0.3	1,308
ニコン	3.9	2	1,402
オリンパス	13.4	9.6	19,934
HOYA	4.7	3.4	42,449
朝日インテック	2.8	1.8	5,994
その他製品 (2.6%)			
バンダイナムコホールディングス	2.5	1.8	16,471
パイロットコーポレーション	0.3	0.2	605
タカラトミー	1.1	0.5	470
ヤマハ	1.5	1	5,740

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビジョン	1.5	1.1	5,164
任天堂	1.4	1	54,420
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	7.3	5	6,560
関西電力	9.2	6.8	6,764
東北電力	5.8	3.8	3,602
九州電力	4.1	3.7	3,548
電源開発	1.8	1.2	1,771
東京瓦斯	4.7	3.2	8,353
大阪瓦斯	4.9	3.5	7,714
陸運業 (3.9%)			
東武鉄道	2.6	1.7	5,941
相鉄ホールディングス	0.9	0.8	2,179
東急	6.1	4.1	5,748
小田急電鉄	3.6	2.5	7,925
京王電鉄	1.3	0.9	7,047
京成電鉄	1.5	1.3	4,901
東日本旅客鉄道	4.1	3	19,677
西日本旅客鉄道	2.1	1.6	8,179
東海旅客鉄道	2	1.4	20,531
近畿ホールディングス	3	2.2	2,580
近鉄グループホールディングス	2.3	1.6	7,712
阪急阪神ホールディングス	2.8	2.1	7,791
京阪ホールディングス	1.4	0.9	4,207
名古屋鉄道	2.5	1.9	5,880
日本通運	0.8	0.6	4,314
ヤマトホールディングス	3.5	2.7	7,119
山九	0.5	0.4	1,628
日立物流	0.2	0.2	656
空運業 (0.4%)			
日本航空	3.9	2.6	5,096
ANAホールディングス	4.2	3.1	7,948
情報・通信業 (8.9%)			
日鉄ソリューションズ	0.4	0.3	904
T I S	0.8	1.5	3,088
ネクソン	6.5	4.2	11,096
コロプラ	1	0.5	456
ティーガイア	0.3	0.1	179
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.6	0.5	1,260
GMOペイメントゲートウェイ	0.4	0.4	5,244
アカツキ	0.1	0.1	491
野村総合研究所	4	2.2	7,568
オービック	0.8	0.6	12,648
Zホールディングス	32.7	23.5	14,407
トレンドマイクロ	1	0.9	4,806
日本オラクル	0.5	0.3	3,462
伊藤忠テクノソリューションズ	1.2	0.8	2,936
大塚商会	1.2	0.8	3,912
デジタルガレージ	0.5	0.3	1,201

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ユニシス	0.8	0.4	1,434
日本テレビホールディングス	2.1	1	1,154
日本電信電話	11.7	16.8	41,773
KDDI	17	12.2	37,722
光通信	0.2	0.2	4,794
NTTドコモ	17	11.9	46,005
東宝	1.4	1	4,565
エヌ・ティ・ティ・データ	6.5	4.7	6,462
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.9	0.7	3,843
カブコン	1.1	0.8	4,272
SCSK	0.5	0.4	2,328
コナミホールディングス	0.9	0.6	3,126
ソフトバンクグループ	10.9	8	52,616
卸売業(4.6%)			
双日	12.2	7.2	1,677
アルフレッサ ホールディングス	2.3	1.9	4,005
神戸物産	0.8	1.2	3,822
ダイワボウホールディングス	0.2	0.1	608
TOKAIホールディングス	1.3	0.9	938
シップヘルスケアホールディングス	0.4	0.3	1,500
コマダホールディングス	0.6	0.1	180
第一興商	0.5	0.4	1,416
メディバルホールディングス	2.5	1.9	3,752
日本ライフライン	0.8	0.2	276
伊藤忠商事	16.2	11.8	32,532
丸紅	24.5	17.2	10,504
豊田通商	2.4	1.8	6,210
兼松	1	0.6	743
三井物産	20.3	14.5	27,223
日立ハイテク	0.8	—	—
住友商事	14.6	10.8	14,347
三菱商事	16.2	10.9	27,631
岩谷産業	0.4	0.4	2,076
PALTAC	0.4	0.3	1,740
日鉄物産	0.2	0.2	650
ミスミグループ本社	3	2.2	7,260
小売業(4.8%)			
ローソン	0.6	0.5	2,500
エービーシー・マート	0.4	0.3	1,782
日本マクドナルドホールディングス	1	0.7	3,710
セリア	0.7	0.5	1,920
ビックカメラ	1.3	1.3	1,493
Monotaro	1.6	1.2	6,792
J.フロント リテイリング	2.3	2.3	1,968
マツモトキヨシホールディングス	0.8	0.6	2,883
ZOZO	2.3	1.1	2,718
ウエルシアホールディングス	0.7	1.1	4,609
クリエイトSDホールディングス	0.3	0.3	1,102
すかいらーくホールディングス	2.8	2.1	3,309

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモス薬品	0.1	0.1	1,768
セブン&アイ・ホールディングス	9.1	6.5	21,742
ツルハホールディングス	0.5	0.4	6,148
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.2	1,782
ノジマ	0.5	0.1	291
良品計画	2.8	2.2	4,972
パル・パブリック・インターナショナルホールディングス	5.6	3.6	9,115
ゼンショーホールディングス	1.2	0.9	2,439
ワークマン	0.2	0.2	1,844
ユナイテッドアローズ	0.3	0.3	425
スギホールディングス	0.5	0.4	2,792
ファミリーマート	1.9	—	—
しまむら	0.3	0.2	2,254
丸井グループ	2.2	1.7	3,388
イオン	8.9	6.3	19,032
イズミ	0.5	0.3	1,074
ヤオコー	0.3	0.2	1,436
ケーズホールディングス	1.6	1.5	1,930
アインホールディングス	0.3	0.2	1,466
ニトリホールディングス	1	0.7	14,794
ファーストリテイリング	0.3	0.2	16,650
サンドラッグ	1	0.7	2,926
銀行業(4.3%)			
めぶきフィナンシャルグループ	12.4	10.2	2,346
コンソルディア・フィナンシャルグループ	14.1	9.9	3,801
新生銀行	1.7	0.9	1,190
あおぞら銀行	1.3	1.1	2,019
三菱UFJフィナンシャル・グループ	117.7	84.3	38,870
りそなホールディングス	23.9	17.5	6,702
三井住友トラスト・ホールディングス	4.5	3	9,540
三井住友フィナンシャルグループ	15.5	11.3	35,866
千葉銀行	8.2	5	3,045
セブン銀行	7	7	1,631
みずほフィナンシャルグループ	314.9	23	32,349
証券・商品先物取引業(0.9%)			
FPG	0.1	0.4	196
SBIホールディングス	2.8	2	5,242
大和証券グループ本社	18.5	12.4	5,809
野村ホールディングス	41.5	29.5	15,151
松井証券	1.3	1.3	1,127
保険業(2.6%)			
SOMPOホールディングス	4.5	3.2	13,280
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.2	4.4	14,581
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.6	—	—
第一生命ホールディングス	13.1	9.7	16,203
東京海上ホールディングス	8.3	5.9	33,004
T&Dホールディングス	7.1	4.6	5,832
その他金融業(1.1%)			
全国保証	0.7	0.5	2,397

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,272
東京センチュリー	0.5	0.3	1,968
イオンフィナンシャルサービス	1.5	1.1	1,284
オリエン特コーポレーション	7	3.5	406
オリックス	14.5	10.1	15,695
三菱UFJリース	5.7	4.8	2,289
日本取引所グループ	6.8	4.9	11,718
不動産業(2.3%)			
いちご	3.2	3.2	1,036
ヒューリック	4.2	3.7	3,836
野村不動産ホールディングス	1.4	1.2	2,346
プレサンスコーポレーション	0.5	0.1	178
オープンハウス	0.6	0.6	2,412
東急不動産ホールディングス	6.2	5.4	2,619
飯田グループホールディングス	2	1.2	2,548
パーク24	1.2	0.7	1,052
三井不動産	11.6	8.1	17,670
三菱地所	16.2	11.5	20,579
東京建物	2.1	1.8	2,390
住友不動産	5.4	3.8	12,806
スターツコーポレーション	0.4	0.1	271
イオンモール	1.3	1	1,700
日本空港ビルデング	0.8	0.5	2,900
サービス業(6.0%)			
ミクシイ	0.6	0.5	1,398
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	0.2	336
日本M&Aセンター	1.8	1.3	8,411
UTグループ	0.4	0.3	910
エス・エム・エス	0.7	0.5	1,700
パソールホールディングス	2.2	1.4	2,566
総合警備保障	0.9	0.7	3,801
カカクコム	1.6	1.1	3,128
ディップ	0.4	0.2	477
ベネフィット・ワン	0.9	0.6	1,869
エムスリー	5.1	3.6	29,300
アウトソーシング	1.4	1	1,364
ディー・エヌ・エー	1.3	0.8	1,469
博報堂DYホールディングス	2.7	2.4	3,518

銘柄	期首 (前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
電通グループ	2.3	1.9	6,222	
オリエンタルランド	2.4	1.7	29,869	
リゾートトラスト	1.1	0.8	1,339	
ユー・エス・エス	2.6	1.8	4,005	
サイバーエージェント	1.4	1	6,440	
楽天	9.7	7.3	7,949	
エン・ジャパン	0.3	0.3	1,038	
テクノプロ・ホールディングス	0.5	0.3	2,355	
リクルートホールディングス	15.9	11.6	51,898	
リログループ	1.1	0.9	2,483	
カナモト	0.3	0.3	679	
セコム	2.4	1.7	17,272	
メイテック	0.3	0.2	1,020	
合計	株数・金額	1,954	1,212	3,203,712
	銘柄数<比率>	400	395	<96.0%>

(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	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
JPX日経400	130	-

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2020年11月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	3,203,712	94.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	195,753	5.8
投 資 信 託 財 産 総 額	3,399,465	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

(2020年11月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,399,465,729円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	61,340,848
株 式(評価額)	3,203,712,690
未 収 入 金	100,640,390
未 収 配 当 金	31,298,801
差 入 委 託 証 拠 金	2,473,000
(B) 負 債	63,091,309
未 払 金	425,160
未 払 解 約 金	62,666,000
未 払 利 息	149
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,336,374,420
元 本	2,153,042,811
次 期 繰 越 損 益 金	1,183,331,609
(D) 受 益 権 総 口 数	2,153,042,811口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,496円

(注記事項)

期首元本額	3,011,939,744円
期中追加設定元本額	189,264,021円
期中一部解約元本額	1,048,160,954円

(当期末元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	2,153,042,811円
------------------	----------------

■損益の状況

当期 (自2019年11月20日 至2020年11月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	84,766,946円
受 取 配 当 金	84,777,266
そ の 他 収 益 金	47,627
支 払 利 息	△ 57,947
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	129,887,525
売 買 益	501,530,043
売 買 損	△ 371,642,518
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	12,291,840
取 引 益	38,079,260
取 引 損	△ 25,787,420
(D) そ の 他 費 用 等	△ 13,755
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	226,932,556
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	1,391,300,120
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	50,743,979
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 485,645,046
(I) 計 (E+F+G+H)	1,183,331,609
次 期 繰 越 損 益 金(I)	1,183,331,609

(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。