

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 |
| 信託期間 | 2014年9月30日から2024年9月6日までです。 |
| 運用方針 | 株主資本の効率的な活用、株主利益の最大化等が期待される日本の成長企業の株式に投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 投資にあたっては、JPX日経インデックス400構成銘柄を中心に、企業の成長ポテンシャル、自己資本利益率（ROE）の水準・変化・方向性、配当利回り、配当政策等に着眼し、投資信託財産の成長を図ります。JPX日経インデックス400構成銘柄の投資比率は投資信託財産の純資産総額に対して概ね70%程度とします。 |
| 主要投資対象 | 日本の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）株式を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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。 |
| 分配方針 | 年4回、3月、6月、9月および12月の各月の7日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の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、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。 |

運用報告書（全体版）

JPX日経インデックス 400・コアプラス

第23期（決算日 2020年6月8日）

第24期（決算日 2020年9月7日）

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「JPX日経インデックス400・コアプラス」は、2020年9月7日に第24期決算を迎えましたので、過去6ヵ月間（第23期～第24期）の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社営業部 セールスサポートグループへ
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214（営業日の9:00～17:00）

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

○最近10期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | JPX日経インデックス400 | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|----------------|---------------|----------------|---------------|------------|------------|-------|
| | (分配落) | 税金 込配 み金 | 期 騰落 中率 | (参考指数) | 期 騰落 中率 | | | |
| | 円 | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 15期(2018年6月7日) | 10,950 | 300 | 4.6 | 15,821.95 | 5.0 | 95.1 | — | 4,004 |
| 16期(2018年9月7日) | 10,396 | 100 | △ 4.1 | 14,893.06 | △ 5.9 | 91.6 | — | 3,645 |
| 17期(2018年12月7日) | 9,742 | 0 | △ 6.3 | 14,336.16 | △ 3.7 | 90.3 | — | 3,172 |
| 18期(2019年3月7日) | 9,543 | 0 | △ 2.0 | 14,229.83 | △ 0.7 | 91.5 | — | 3,003 |
| 19期(2019年6月7日) | 8,993 | 0 | △ 5.8 | 13,627.38 | △ 4.2 | 93.1 | — | 2,647 |
| 20期(2019年9月9日) | 9,292 | 0 | 3.3 | 13,877.22 | 1.8 | 94.6 | — | 2,587 |
| 21期(2019年12月9日) | 10,303 | 0 | 10.9 | 15,376.11 | 10.8 | 94.4 | — | 2,678 |
| 22期(2020年3月9日) | 8,221 | 0 | △20.2 | 12,524.35 | △18.5 | 96.5 | — | 2,011 |
| 23期(2020年6月8日) | 9,666 | 0 | 17.6 | 14,694.12 | 17.3 | 91.9 | — | 2,300 |
| 24期(2020年9月7日) | 10,020 | 0 | 3.7 | 14,546.93 | △ 1.0 | 94.7 | — | 2,261 |

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) JPX日経インデックス400は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

(注) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

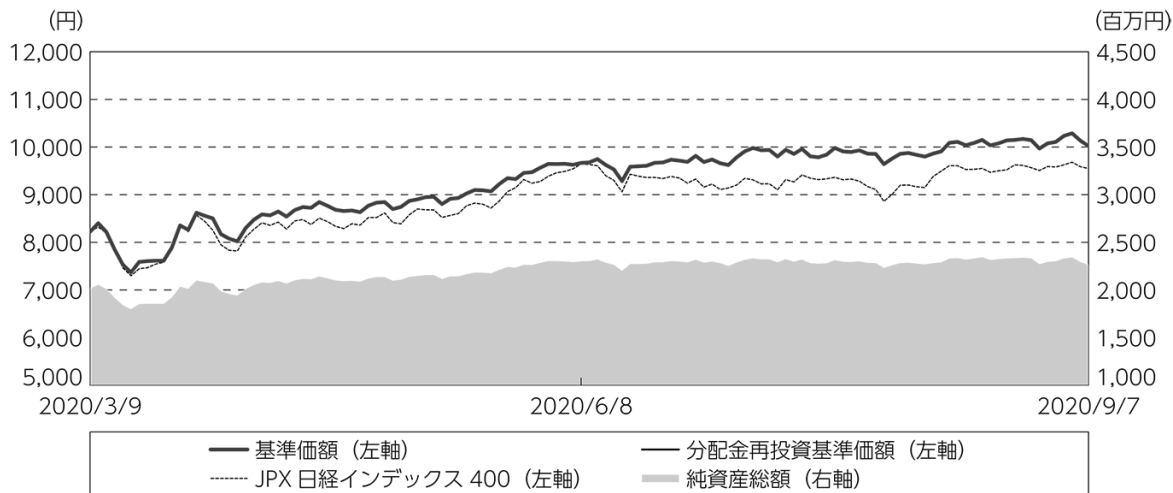
| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | | JPX日経インデックス400 | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 |
|------|-------------------|--------|--------|----------------|-------|------------|------------|
| | | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | | | |
| 第23期 | (期首) 2020年3月9日 | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| | 3月末 | 8,502 | 3.4 | 12,573.18 | 0.4 | 91.3 | — |
| | 4月末 | 8,845 | 7.6 | 13,127.34 | 4.8 | 88.8 | — |
| | 5月末 | 9,472 | 15.2 | 14,078.89 | 12.4 | 91.2 | — |
| | (期末) 2020年6月8日 | 9,666 | 17.6 | 14,694.12 | 17.3 | 91.9 | — |
| 第24期 | (期首) 2020年6月8日 | 9,666 | — | 14,694.12 | — | 91.9 | — |
| | 6月末 | 9,738 | 0.7 | 14,049.87 | △ 4.4 | 93.5 | — |
| | 7月末 | 9,641 | △ 0.3 | 13,498.21 | △ 8.1 | 94.2 | — |
| | 8月末 | 10,077 | 4.3 | 14,611.26 | △ 0.6 | 94.0 | — |
| | (期末) 2020年9月7日 | 10,020 | 3.7 | 14,546.93 | △ 1.0 | 94.7 | — |

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

作成期間中の基準価額等の推移

(2020年3月10日～2020年9月7日)



第23期首：8,221円

第24期末：10,020円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：21.9% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、JPX日経インデックス400です。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首(2020年3月9日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・業種配分では、情報・通信業、電気機器、化学などが基準価額にプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、ダイフク、NECネットエスアイ、東京エレクトロンなどが基準価額にプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・業種配分では、不動産業、その他金融業、保険業などが基準価額にマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、イオンモール、第一興商、ペプチドリームなどが基準価額にマイナスに影響しました。

投資環境

(2020年3月10日～2020年9月7日)

国内株式市場は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて株価が大きく動く展開となりました。作成期初から2020年3月下旬にかけて、世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場は急落しました。その後は、各国政府や中央銀行の強力な政策対応により株式市場は下げ止まり、日本政府の緊急事態宣言発令や外出の自粛効果により、新型コロナウイルスの新規感染者数が減少傾向に転じたことで、経済活動再開への期待が高まり、6月上旬にかけて株式市場は戻りを試す展開となりました。しかし、6月中旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大第2波への警戒感などから、上値の重い展開が続きました。

当ファンドのポートフォリオ

(2020年3月10日～2020年9月7日)

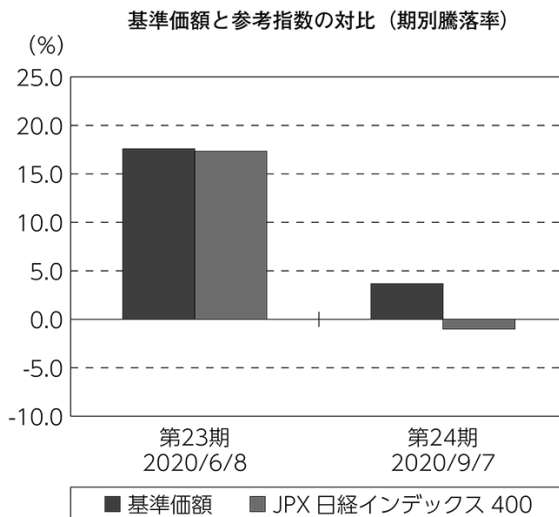
当ファンドの運用におきましては、JPX日経インデックス400構成銘柄を中心に、企業の成長ポテンシャル、自己資本利益率（ROE）の水準・変化・方向性、配当利回り、配当政策等に着眼し、投資魅力の高いと考えられた銘柄へ投資しました。

主な売買につきましては、投資事業の収益回復などで市場評価が高まると判断したソフトバンクグループや、コロナ禍で医療現場の効率化ニーズが高まることが業績の追い風になると考えたエムスリーなどを新規に買い付けました。一方、顧客の販売体制見直しにより成長期待が後退したと判断した明電舎や、生産面での課題により業績の先行き不透明感が強まったと判断した武田薬品工業などを売却しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2020年3月10日～2020年9月7日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としているJPX日経インデックス400の騰落率を5.7%上回りました。詳細につきましては前掲の「基準価額の主な変動要因」をご参照ください。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注) 参考指数は、JPX日経インデックス400です。

分配金

(2020年3月10日～2020年9月7日)

当ファンドは、年4回、3月、6月、9月および12月の各月の7日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、委託会社が基準価額水準、配当等収益等を勘案のうえ分配金額を決定します。

当作成期につきましては、第23期、第24期ともに収益分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった留保益については、運用の基本方針と同一の運用を行います。

(単位：円、1万口当たり・税引前)

| 項 目 | 第23期 | 第24期 |
|-----------|--------------------------|-------------------------|
| | 2020年3月10日～ 2020年6月8日 | 2020年6月9日～ 2020年9月7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 | 1,562 | 1,578 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税引前）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ります。

(注) 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。

今後の運用方針

国内株式市場は、緩慢な景気回復ペースの中、新型コロナウイルスの感染拡大第2波への警戒感から、方向感の乏しい不安定な相場展開が想定されます。ワクチンの開発動向や2020年11月の米大統領選挙へ向けた動き次第では相場が上下に大きく変動する可能性が考えられます。相場の調整局面では日銀の上場投資信託（ETF）買入れや待機資金の買いが支えとなるものの、当面は様子見ムードが強い中、上値の重い展開を予想します。

当ファンドの運用につきましては、株主資本の効率的な活用、株主利益の最大化等が期待される日本の成長企業の株式に投資を行います。投資にあたっては、JPX日経インデックス400構成銘柄を中心に、企業の成長ポテンシャル、ROEの水準・変化・方向性、配当利回り、配当政策等に着目し、投資信託財産の成長を図ります。

※文中の投資行動は、個別銘柄の売買等いかなる投資行動も推奨するものではありません。

○ 1万口当たりの費用明細

(2020年3月10日～2020年9月7日)

| 項 目 | 第23期～第24期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-----------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 80 | 0.850 | (a) 信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (39) | (0.411) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (39) | (0.411) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (3) | (0.027) | 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 | 18 | 0.192 | (b) 売買委託手数料＝作成期間中の売買委託手数料÷作成期間中の平均受益権口数 |
| （ 株 式 ） | (18) | (0.192) | 売買委託手数料は、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 | 1 | 0.006 | (c) その他費用＝作成期間中のその他費用÷作成期間中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (1) | (0.005) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | その他は、金銭信託支払手数料 |
| 合 計 | 99 | 1.048 | |
| 作成期間中の平均基準価額は、9,379円です。 | | | |

(注) 作成期間中の費用（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。

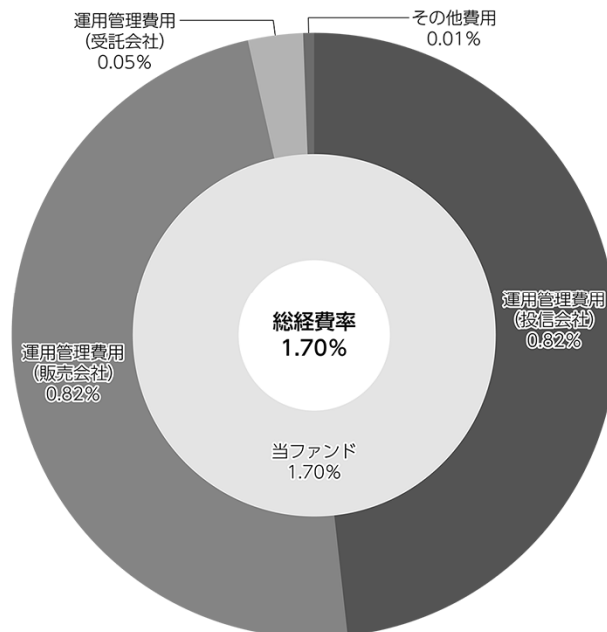
(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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）を作成期間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

作成期間中の運用・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。）を作成期間中の平均受益権口数に作成期間中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.70%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年3月10日～2020年9月7日)

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

株式

| | | 第23期～第24期 | | | |
|---|----|-----------|-----------|-----|-----------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | 上場 | 593 | 1,285,127 | 650 | 1,511,041 |
| | | (24) | (-) | | |

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ()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。

○株式売買比率

(2020年3月10日～2020年9月7日)

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 | 第23期～第24期 |
|----------------------|-------------|
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 2,796,169千円 |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 2,042,105千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.36 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月10日～2020年9月7日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 第23期～第24期 | | | | | |
|-----|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 1,285 | 百万円 183 | % 14.2 | 百万円 1,511 | 百万円 507 | % 33.6 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 第23期～第24期 |
|------------------|-----------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 4,247千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1,141千円 |
| (B) / (A) | 26.9% |

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは岡三証券です。

○組入資産の明細

(2020年9月7日現在)

国内株式

| 銘柄 | 第22期末 | | 第24期末 | |
|------------------------|-------|------|--------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 建設業 (6.8%) | | | | |
| ウエストホールディングス | — | 16.5 | 45,952 | |
| ショーボンドホールディングス | 10.5 | 10.5 | 53,340 | |
| 五洋建設 | 69 | 69 | 47,265 | |
| 食料品 (4.5%) | | | | |
| 江崎グリコ | — | 6.6 | 29,601 | |
| 寿スピリッツ | — | 7.5 | 35,550 | |
| キッコーマン | 5.5 | 5.5 | 31,570 | |
| 繊維製品 (1.8%) | | | | |
| ゴールドウイン | — | 4.9 | 38,171 | |
| 化学 (10.9%) | | | | |
| 信越化学工業 | 2.7 | 1.9 | 25,631 | |
| J S R | 40.2 | 28.5 | 68,428 | |
| 花王 | 7.7 | 5.2 | 40,872 | |
| ライオン | — | 13.8 | 30,291 | |
| ファンケル | 12.8 | 12.8 | 45,568 | |
| 小林製薬 | 3 | — | — | |
| ユニ・チャーム | 12.3 | 5 | 22,280 | |
| 医薬品 (1.3%) | | | | |
| 武田薬品工業 | 13.7 | — | — | |
| アステラス製薬 | 25.8 | 17.7 | 28,647 | |
| ベプチドリーム | 13.3 | — | — | |
| ガラス・土石製品 (1.2%) | | | | |
| MARUWA | 5.4 | 2.9 | 26,593 | |
| 機械 (5.2%) | | | | |
| ディスコ | — | 1.7 | 40,137 | |
| オプトラン | 12.8 | — | — | |
| ダイフク | 8.4 | 7.6 | 70,072 | |
| 電気機器 (11.1%) | | | | |
| 明電舎 | 38.2 | — | — | |
| 日本電産 | 1.7 | 4.4 | 39,142 | |
| MC J | 32.6 | — | — | |
| 富士通 | — | 3.1 | 41,819 | |
| 横河電機 | 20.3 | — | — | |

| 銘柄 | 第22期末 | | 第24期末 | |
|-----------------------|-------|------|--------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| キーエンス | 1.8 | 1.1 | 47,817 | |
| カシオ計算機 | — | 29.8 | 52,537 | |
| 太陽誘電 | 16.1 | — | — | |
| 村田製作所 | — | 5.5 | 35,788 | |
| 東京エレクトロン | 2.2 | 0.8 | 21,120 | |
| 輸送用機器 (3.3%) | | | | |
| トヨタ自動車 | 6.9 | 10 | 69,660 | |
| アイシン精機 | 7.1 | — | — | |
| 精密機器 (4.4%) | | | | |
| 島津製作所 | 32.7 | 15.5 | 51,150 | |
| HOYA | 2.9 | — | — | |
| 朝日インテック | 14.2 | 14.2 | 43,381 | |
| その他製品 (3.4%) | | | | |
| スノーピーク | — | 37.6 | 60,272 | |
| 大日本印刷 | 13.7 | — | — | |
| N I S S H A | 24.4 | — | — | |
| グローブライド | — | 4.1 | 13,161 | |
| 陸運業 (2.4%) | | | | |
| ヤマトホールディングス | — | 19 | 51,775 | |
| 情報・通信業 (15.8%) | | | | |
| NECネットエスアイ | 11.4 | — | — | |
| 日鉄ソリューションズ | 15.4 | — | — | |
| コーエーテクモホールディングス | 8.9 | 5.4 | 22,113 | |
| ブイキューブ | 39.8 | — | — | |
| 野村総合研究所 | — | 8 | 22,112 | |
| Zホールディングス | — | 99.7 | 65,602 | |
| 大塚商会 | 14 | 4.3 | 21,715 | |
| KDD I | 8 | — | — | |
| 光通信 | 3.1 | 3.1 | 76,105 | |
| カブコン | 9.2 | 9.2 | 48,116 | |
| ソフトバンクグループ | — | 14 | 82,334 | |
| 卸売業 (5.0%) | | | | |
| 神戸物産 | 7.9 | 6.1 | 35,258 | |
| 第一興商 | 9.9 | — | — | |

JPX日経インデックス400・コアプラス

| 銘柄 | 第22期末 | | 第24期末 | |
|-----------------------------|-------|------|-------|--------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| I DOM | — | 42.9 | — | 24,538 |
| 岩谷産業 | 7.1 | — | — | — |
| トラスコ中山 | 19.1 | 19.1 | — | 46,699 |
| 小売業 (7.6%) | | | | |
| セブン&アイ・ホールディングス | — | 11.6 | — | 38,662 |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 14.2 | 20.2 | — | 48,480 |
| ニトリホールディングス | — | 2 | — | 42,650 |
| ファーストリテイリング | 0.9 | 0.5 | — | 33,035 |
| 証券、商品先物取引業 (-%) | | | | |
| 野村ホールディングス | 54.6 | — | — | — |
| 保険業 (1.9%) | | | | |
| 東京海上ホールディングス | 8.4 | 8.4 | — | 40,462 |
| その他金融業 (-%) | | | | |
| オリックス | 22.4 | — | — | — |

| 銘柄 | 第22期末 | | 第24期末 | |
|----------------------|---------|------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 不動産業 (1.6%) | | | | |
| ティーケービー | — | 12.9 | — | 34,185 |
| イオンモール | 20.9 | — | — | — |
| サービス業 (11.8%) | | | | |
| 日本M&Aセンター | 7.7 | 7.7 | — | 40,040 |
| エムスリー | — | 10 | — | 63,400 |
| プレステージ・インターナショナル | 33.2 | 33.2 | — | 30,012 |
| I B J | — | 53.7 | — | 56,009 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 7.1 | — | — | — |
| リクルートホールディングス | 10.5 | 10.5 | — | 41,695 |
| トランス・コスモス | 14.1 | — | — | — |
| 乃村工藝社 | — | 27.2 | — | 21,270 |
| 合計 | 株数・金額 | 805 | 772 | 2,142,090 |
| | 銘柄数<比率> | 52 | 51 | <94.7%> |

(注) 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。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年9月7日現在)

| 項目 | 第24期末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 2,142,090 | 93.5 |
| コール・ローン等、その他 | 149,253 | 6.5 |
| 投資信託財産総額 | 2,291,343 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第23期末 | 第24期末 |
|-----------------|----------------|----------------|
| | 2020年6月8日現在 | 2020年9月7日現在 |
| | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,316,516,075 | 2,291,343,894 |
| コール・ローン等 | 188,554,645 | 146,186,122 |
| 株式(評価額) | 2,114,720,030 | 2,142,090,850 |
| 未収配当金 | 13,241,400 | 3,066,922 |
| (B) 負債 | 16,214,521 | 30,227,240 |
| 未払解約金 | 7,278,666 | 20,411,946 |
| 未払信託報酬 | 8,877,100 | 9,751,290 |
| 未払利息 | 316 | 221 |
| その他未払費用 | 58,439 | 63,783 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,300,301,554 | 2,261,116,654 |
| 元本 | 2,379,857,018 | 2,256,505,279 |
| 次期繰越損益金 | △ 79,555,464 | 4,611,375 |
| (D) 受益権総口数 | 2,379,857,018口 | 2,256,505,279口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,666円 | 10,020円 |

(注) 純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は第23期79,555,464円です。

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、第23期0.9666円、第24期1.0020円です。

(注) 当ファンドの第23期首元本額は2,446,623,926円、第23～24期中追加設定元本額は8,661,757円、第23～24期中一部解約元本額は198,780,404円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第23期 | 第24期 |
|------------------|--------------------------|-------------------------|
| | 2020年3月10日～ 2020年6月8日 | 2020年6月9日～ 2020年9月7日 |
| | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 17,154,901 | 4,064,745 |
| 受取配当金 | 17,173,023 | 4,080,072 |
| 受取利息 | 694 | 191 |
| その他収益金 | — | 135 |
| 支払利息 | △ 18,816 | △ 15,653 |
| (B) 有価証券売買損益 | 335,249,225 | 85,757,403 |
| 売買益 | 390,277,223 | 177,756,985 |
| 売買損 | △ 55,027,998 | △ 91,999,582 |
| (C) 信託報酬等 | △ 8,937,366 | △ 9,816,440 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 343,466,760 | 80,005,708 |
| (E) 前期繰越損益金 | △466,005,655 | △116,139,416 |
| (F) 追加信託差損益金 | 42,983,431 | 40,745,083 |
| (配当等相当額) | (182,422,852) | (173,042,011) |
| (売買損益相当額) | (△139,439,421) | (△132,296,928) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 79,555,464 | 4,611,375 |
| (H) 収益分配金 | 0 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 79,555,464 | 4,611,375 |
| 追加信託差損益金 | 42,983,431 | 40,745,083 |
| (配当等相当額) | (182,422,852) | (173,042,011) |
| (売買損益相当額) | (△139,439,421) | (△132,296,928) |
| 分配準備積立金 | 189,528,497 | 183,250,597 |
| 繰越損益金 | △312,067,392 | △219,384,305 |

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 収益分配金

| 決算期 | 第23期 | 第24期 |
|------------------------------|--------------|--------------|
| (a) 配当等収益(費用控除後) | 16,719,651円 | 3,620,060円 |
| (b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後) | 0円 | 0円 |
| (c) 信託約款に規定する収益調整金 | 182,422,852円 | 173,042,011円 |
| (d) 信託約款に規定する分配準備積立金 | 172,808,846円 | 179,630,537円 |
| 分配対象収益(a+b+c+d) | 371,951,349円 | 356,292,608円 |
| 分配対象収益(1万口当たり) | 1,562円 | 1,578円 |
| 分配金額 | 0円 | 0円 |
| 分配金額(1万口当たり) | 0円 | 0円 |

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|---------------------|---|
| 資産 | ファンドが保有する財産の合計です。 |
| コール・ローン等 | 金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。 |
| 各種有価証券等(評価額) | 組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。 |
| 未収入金 | 入金が予定されている有価証券の売却代金などです。 |
| 未収配当金 | 入金が予定されている株式の配当金等です。 |
| 未収利息 | 入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。 |
| 負債 | 支払いが予定されている金額の合計です。 |
| 未払収益分配金 | 期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。 |
| 未払解約金 | 支払いが予定されている解約金です。 |
| 未払信託報酬 | 支払いが予定されている信託報酬の額です。 |
| その他未払費用 | 支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。 |
| 純資産総額(資産－負債) | ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。 |
| 元本 | ファンド全体の元本残高です。 |
| 次期繰越損益金 | 純資産総額と元本の差額(翌期に繰り越す損益金の合計額)です。 |
| 受益権総口数 | 受益者が保有する受益権口数の合計です。 |
| 1(万)口当たり基準価額 | 1(万)口当たりのファンドの時価です。 |

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|-----------------|---|
| 配当等収益 | ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。 |
| 受取配当金 | 保有する株式等の配当金等です。 |
| 受取利息 | 債券、コール・ローン等の利息等です。 |
| 有価証券売買損益 | 有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。 |
| 売買益 | 売買益と期末評価益の合計です。 |
| 売買損 | 売買損と期末評価損の合計です。 |
| 信託報酬等 | 信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それに掛かる消費税等相当額です。 |
| 当期損益金 | 当期における収支合計です。 |
| 前期繰越損益金 | 前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。 |
| 追加信託差損益金 | 受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 計 | 収益分配前の期中の収支の総合計です。 |
| 収益分配金 | 期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。 |
| 次期繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の合計です。 |
| 追加信託差損益金 | 翌期に繰り越す追加信託差損益金です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 分配準備積立金 | 翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。 |
| 繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の額です。 |

〈お知らせ〉

該当事項はございません。

〈当ファンドの参考指数の著作権等について〉

- ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループ及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。）並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」及び「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体及び「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ています。
- ・「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、全て「JPXグループ」及び「日経」に帰属しています。
- ・当ファンドは、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」及び「日経」は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- ・「JPXグループ」及び「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、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
- ・「JPXグループ」及び「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及び公表を停止する権利を有しています。