

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	無期限（2014年4月1日設定）	
運用方針	<p>J P X日経400インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みません。）に実質的な投資を行い、J P X日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	J P X日経400インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の金融商品取引所上場株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
分配方針	<p>経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p>	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
イーマックス

eMAXIS JPX日経400インデックス



第1期（決算日：2015年1月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「eMAXIS JPX日経400インデックス」は、去る1月26日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

 **三菱UFJ投信**
MUFG

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

URL: <http://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト URL: <http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

TEL. 0120-151034

お客様専用フリーダイヤル

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様の取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

eMAXIS JPX日経400インデックスのご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇運用経過	2
◇今後の運用方針	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	7
◇株式売買比率	8
◇利害関係人との取引状況等	8
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	9
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	9
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇お知らせ	11

マザーファンドのご報告

◇JPX日経400インデックスマザーファンド	12
------------------------	----

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			J P X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)	税込 分	み 期 騰 落	中 率	騰 落			
(設定日) 2014年4月1日	円 10,000	円 —	—	% —	10,901	% —	% —	百万円 1,000
1期(2015年1月26日)	11,773	0	17.7	12,733	16.8	96.2	3.8	4,867

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) J P X日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。「J P X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「J P Xグループ」といいます。)と株式会社日本経済新聞社(以下、「日本経済新聞社」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、J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X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。「J P X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J P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X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。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X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ています。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額			J P X日経インデックス400		株式組入比率	株式先物比率
	騰 落	騰 落	率	騰 落	率		
(設定日) 2014年4月1日	円 10,000	—	% —	10,901	% —	% —	% —
4月末	9,703	△ 3.0		10,588	△ 2.9	92.2	7.9
5月末	10,035	0.4		10,946	0.4	95.9	4.2
6月末	10,516	5.2		11,466	5.2	97.4	2.6
7月末	10,755	7.6		11,735	7.6	97.8	2.2
8月末	10,633	6.3		11,595	6.4	97.2	2.4
9月末	11,130	11.3		12,056	10.6	96.8	3.3
10月末	11,239	12.4		12,173	11.7	98.1	2.1
11月末	11,861	18.6		12,836	17.7	97.5	2.5
12月末	11,810	18.1		12,768	17.1	97.1	2.8
(期末) 2015年1月26日	11,773	17.7		12,733	16.8	96.2	3.8

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

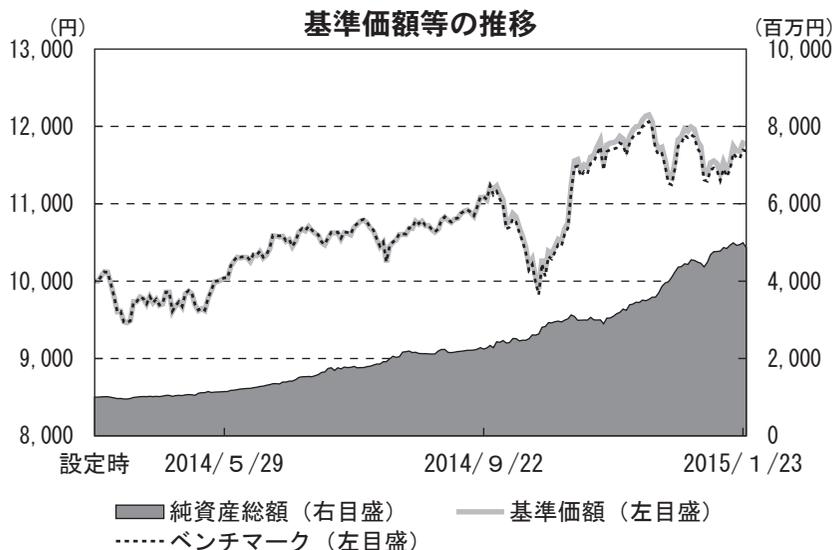
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第1期：2014/4/1～2015/1/26)

基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ17.7%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（16.8%）を0.9%上回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表などを受け、国内株式市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。
------	--

投資環境について

(第1期：2014/4/1～2015/1/26)

米国中心の海外景気の回復に加えて、政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表などを受けて国内株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて**< eMAXIS JPX日経400インデックス >**

当ファンドはJPX日経400インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）にほぼ100%投資しています。このため基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

< JPX日経400インデックスマザーファンド >

基準価額は設定時に比べ18.2%の上昇となりました。

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークであるJPX日経インデックス400の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

以上の運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の推移となりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜eMAXIS JPX日経400インデックス＞
ベンチマークとのカイ離は0.9%程度となりました。

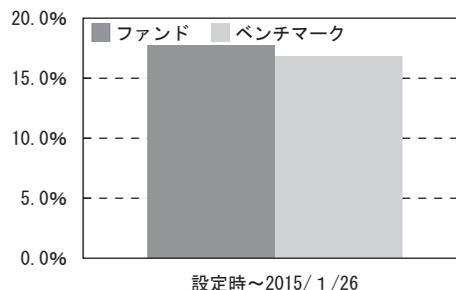
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.5%程度	1.4%程度	0.9%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

＜マザーファンド保有以外の要因＞
管理コスト等による影響は△0.5%程度でした。

＜マザーファンド保有による要因＞
マザーファンド保有による影響は1.4%程度でした。

基準価額（ペビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜JPX日経400インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは16.8%の上昇となったため、ベンチマークとのカイ離は1.4%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率要因	銘柄選択要因	その他の要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.0%程度	1.3%程度	1.4%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、3.4%程度となりました。

(注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.3%程度でした。配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

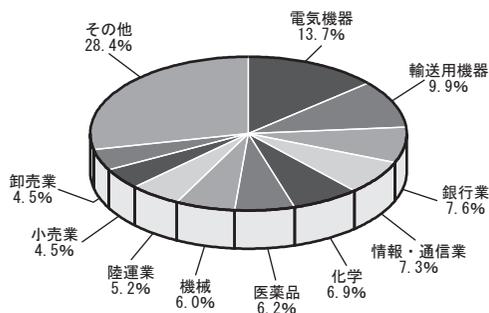
(その他の要因)

プラス要因	配当・利子収入等	計	1.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

(ご参考)

組入上位10業種

期末(2015年1月26日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第1期
	2014年4月1日～2015年1月26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	1,772

(注) 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

< eMAXIS JPY日経400インデックス >

運用の基本方針にしたがい、JPX日経400インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

< JPX日経400インデックスマザーファンド >

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2014年4月1日～2015年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 39	% 0.356	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(17)	(0.155)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(17)	(0.157)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.045)	投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	5	0.050	(b) 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
(株 式)	(0)	(0.002)	有価証券等を売買する際に発生する費用
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(5)	(0.048)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(c) 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 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	44	0.408	
期中の平均基準価額は、10,853円です。			

(注) 各期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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) 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）を各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

(2014年4月1日～2015年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
J P X 日 経 4 0 0 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ェ ン ド	千口 5,216,009	千円 5,656,921	千口 1,096,621	千円 1,224,727

○株式売買比率

(2014年4月1日～2015年1月26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	当 期	
	JPX日経400インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	6,193,308千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,259,949千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.74	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年4月1日～2015年1月26日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS JPX日経400インデックス>

該当事項はございません。

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

区 分	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	5,235	966	18.5	957	176	18.4
株式先物取引	5,362	1,563	29.1	5,183	1,567	30.2

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<eMAXIS JPX日経400インデックス>

該当事項はございません。

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 83	百万円 12	百万円 72

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<eMAXIS JPX日経400インデックス>

該当事項はございません。

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.604741

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	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1,134千円
うち利害関係人への支払額 (B)	218千円
(B) / (A)	19.3%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高 (元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高 (元本)	取引理由
百万円 1,000	百万円 -	百万円 -	百万円 1,000	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2015年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 4,119,388	千円 4,867,057

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J P X日経400インデックスマザーファンド	千円 4,867,057	% 97.2
コール・ローン等、その他	140,793	2.8
投資信託財産総額	5,007,850	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,007,850,480
コール・ローン等	22,399,660
JPX日経400インデックスマザーファンド(評価額)	4,867,057,786
未収入金	118,393,000
未収利息	34
(B) 負債	140,050,958
未払解約金	135,029,238
未払信託報酬	4,989,323
その他未払費用	32,397
(C) 純資産総額(A-B)	4,867,799,522
元本	4,134,801,825
次期繰越損益金	732,997,697
(D) 受益権総口数	4,134,801,825口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,773円

〈注記事項〉

①設定年月日	2014年4月1日
設定元本額	1,000,000,000円
期中追加設定元本額	6,528,215,545円
期中一部解約元本額	3,393,413,720円

○損益の状況 (2014年4月1日～2015年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	9,258
受取利息	9,258
(B) 有価証券売買損益	228,636,128
売買益	411,383,670
売買損	△182,747,542
(C) 信託報酬等	△ 8,395,734
(D) 当期損益金(A+B+C)	220,249,652
(E) 追加信託差損益金	512,748,045
(配当等相当額)	(11,022)
(売買損益相当額)	(512,737,023)
(F) 計(D+E)	732,997,697
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	732,997,697
追加信託差損益金	512,748,045
(配当等相当額)	(6,521,144)
(売買損益相当額)	(506,226,901)
分配準備積立金	220,249,652

(注) (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せん。

(注) (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) (E) 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。

②分配金の計算過程

		第1期
費用控除後の配当等収益額	A	22,992,853円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	197,256,799円
収益調整金額	C	512,748,045円
分配準備積立金額	D	—円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	732,997,697円
当ファンドの期末残存口数	F	4,134,801,825口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,772円
1万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金額	I=F*H/10,000	—円

*三菱UFJ投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

[お知らせ]

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑦2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

J P X日経400インデックスマザーファンド

《第1期》決算日2015年1月26日

[計算期間：2014年4月1日～2015年1月26日]

「J P X日経400インデックスマザーファンド」は、1月26日に第1期の決算を行いました。以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第1期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）を主要投資対象とし、J P X日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年4月1日	10,000	—	10,901	—	—	—	999
1期(2015年1月26日)	11,815	18.2	12,733	16.8	96.2	3.8	4,866

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) J P X日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。「J P X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「J P Xグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日本経済新聞社」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、J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X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。「J P X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J P Xグループと日本経済新聞社に帰属しています。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X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。J P Xグループと日本経済新聞社は、「J P X日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X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ています。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(設定日) 2014年4月1日	円 10,000	% —	10,901	% —	% —	% —
4月末	9,706	△ 2.9	10,588	△ 2.9	92.2	7.9
5月末	10,042	0.4	10,946	0.4	96.0	4.2
6月末	10,527	5.3	11,466	5.2	97.4	2.6
7月末	10,771	7.7	11,735	7.6	97.8	2.2
8月末	10,652	6.5	11,595	6.4	97.2	2.4
9月末	11,154	11.5	12,056	10.6	96.8	3.3
10月末	11,268	12.7	12,173	11.7	98.1	2.1
11月末	11,895	19.0	12,836	17.7	97.5	2.5
12月末	11,849	18.5	12,768	17.1	97.2	2.8
(期 末) 2015年1月26日	11,815	18.2	12,733	16.8	96.2	3.8

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ18.2%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは16.8%の上昇となったため、カイ離は1.4%程度となりました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは設定時の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

米国中心の海外景気の回復に加えて、政府の成長戦略に対する期待が高まったことや、日銀の追加金融緩和の発表などを受けて国内株式市場は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークであるJ P X日経インデックス400の個別銘柄構成

比率に合わせて構築しました。

以上の運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の推移となりました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは16.8%の上昇となったため、カイ離は1.4%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	組入比率 要因	銘柄選 択要因	その 他の 要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	△0.0%程度	1.3%程度	1.4%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・期中における先物組入比率の平均は、3.4%程度となりました。

(注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからのカイ離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は△0.0%程度でした。

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.3%程度でした。
配当金等の受取りにより、プラスカイ離となりました。

○今後の運用方針

・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

プラス要因	配当・利子収入等	計	1.3%程度
マイナス要因	売買コスト等	計	△0.0%程度

○1万口当たりの費用明細

(2014年4月1日～2015年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 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 有価証券等を売買する際に発生する費用
(株 式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(5)	(0.048)	
合 計	5	0.050	
期中の平均基準価額は、10,873円です。			

(注) 各金額は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)を各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

(2014年4月1日～2015年1月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 4,055 (△ 2)	千円 5,235,362 ()	千株 712	千円 957,946

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および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。

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 5,247	百万円 5,070	百万円 113	百万円 114

○ 株式売買比率

(2014年4月1日～2015年1月26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	当 期
(a) 期中の株式売買金額	6,193,308千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,259,949千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.74

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年4月1日～2015年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	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 5,235	百万円 966	% 18.5	百万円 957	百万円 176	% 18.4
株式先物取引	5,362	1,563	29.1	5,183	1,567	30.2

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 83	百万円 12	百万円 72

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.604741

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	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1,134千円
うち利害関係人への支払額 (B)	218千円
(B) / (A)	19.3%

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱UFJリース、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年1月26日現在)

国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
鉱業 (0.5%)		
国際石油開発帝石	18.5	24,438
建設業 (2.3%)		
安藤・間	2.3	1,752
コムシスホールディングス	1.6	2,547
ミサワホーム	0.4	408
大成建設	18	12,420
長谷工コーポレーション	4.4	4,153
鹿島建設	15	6,960
大東建託	1.3	17,823
N I P P O	1	1,918
住友林業	2.6	2,899
大和ハウス工業	10.3	22,484
積水ハウス	10.8	16,788
協和エクシオ	1.5	1,860
日揮	4	9,732
東芝ブラントシステム	0.6	1,106
千代田化工建設	3	2,844
食料品 (4.4%)		
日清製粉グループ本社	3.9	5,034
カルビー	1.3	5,674
ヤクルト本社	1.9	12,749
明治ホールディングス	1	12,400
日本ハム	3	8,694
アサヒグループホールディングス	7.1	26,940
キリンホールディングス	15	23,040
伊藤園	1	2,227
キッコーマン	3	9,480
味の素	8	19,136
キュービー	1.8	4,757
ニチレイ	4	2,360
東洋水産	1.8	7,038
日清食品ホールディングス	1.5	9,660
日本たばこ産業	16.8	55,927
繊維製品 (0.5%)		
東レ	25	24,700

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
パルプ・紙 (0.1%)		
王子ホールディングス	13	5,564
化学 (6.9%)		
クラレ	5.6	7,963
旭化成	20	22,950
昭和電工	22	3,146
日産化学工業	2.2	4,697
東ソー	8	5,112
東亜合成	4	1,876
電気化学工業	7	3,206
信越化学工業	5.9	46,686
エア・ウォーター	3	5,940
大陽日酸	4	5,432
日本パーカライジング	0.8	2,283
日本触媒	3	4,947
J S R	3.2	6,844
三菱ケミカルホールディングス	20.5	12,170
日本合成化学工業	1	710
ダイセル	4.6	6,596
積水化学工業	8	11,136
日本ゼオン	3	3,495
アイカ工業	1	2,626
宇部興産	17	3,026
日立化成	1.6	3,502
日本化薬	2	3,190
花王	9	45,900
日本ペイントホールディングス	2.8	10,066
関西ペイント	4	7,552
D I C	13	3,822
東洋インキ S C ホールディングス	3	1,662
富士フィルムホールディングス	7.5	28,353
資生堂	5.8	10,300
ドクターシーラボ	0.2	819
小林製薬	0.5	3,580
日東電工	2.5	17,882
エフピコ	0.4	1,682
ニフコ	0.7	2,947

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ユニ・チャーム	6.6	20,803
医薬品 (6.2%)		
協和発酵キリン	4	4,888
武田薬品工業	12.3	69,212
アステラス製薬	37.4	66,085
塩野義製薬	5.1	17,289
田辺三菱製薬	3.8	7,022
中外製薬	3.3	10,197
科研製薬	1	2,476
エーザイ	4.3	22,446
ロート製薬	1.5	2,280
小野薬品工業	1.5	18,180
久光製薬	0.9	3,393
持田製薬	0.2	1,266
参天製薬	1.2	8,472
ツムラ	1	2,651
沢井製薬	0.5	3,545
第一三共	11	18,012
キョーリン製薬ホールディングス	0.9	2,074
大塚ホールディングス	6.5	23,279
大正製薬ホールディングス	0.8	5,808
石油・石炭製品 (0.6%)		
昭和シェル石油	2.9	3,416
東燃ゼネラル石油	5	5,220
出光興産	1.6	3,136
J Xホールディングス	36.4	16,147
ゴム製品 (1.3%)		
横浜ゴム	4	4,572
東洋ゴム工業	1.5	3,987
ブリヂストン	10.3	48,064
住友ゴム工業	2.6	4,820
ガラス・土石製品 (0.8%)		
旭硝子	16	9,712
日本電気硝子	6	3,234
太平洋セメント	20	7,000
TOTO	5	6,645
日本特殊陶業	2.8	10,248
ニチアス	1	651
鉄鋼 (1.5%)		
新日鐵住金	139	39,990
ジェイ エフ イー ホールディングス	8.4	20,983

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
大同特殊鋼	5	2,280
日立金属	3	5,991
非鉄金属 (1.0%)		
三井金属鉱業	9	2,268
三菱マテリアル	20	7,460
住友金属鉱山	9	15,516
DOWAホールディングス	4	3,764
住友電気工業	12.4	18,786
アサヒホールディングス	0.5	892
金属製品 (0.4%)		
L I X I Lグループ	4.9	11,480
リンナイ	0.6	4,692
ジーテクト	0.3	350
日本発條	2.9	3,091
機械 (5.9%)		
日本製鋼所	5	2,145
オーエスジー	1.5	3,126
ディスコ	0.4	4,340
ニューフレアテクノロジー	0.1	434
ナブテスコ	2	6,150
SMC	1	31,490
小松製作所	16.3	42,836
住友重機械工業	9	5,805
日立建機	1.5	3,691
クボタ	16	28,520
荏原製作所	7	3,297
ダイキン工業	4.6	38,244
栗田工業	1.9	4,757
椿本チエイン	2	1,828
タダノ	2	2,916
平和	0.7	1,607
SANKYO	0.9	3,672
ユニバーサルエンターテインメント	0.3	594
セガサミーホールディングス	3.4	5,232
T P R	0.3	871
ホンザキ電機	0.9	5,400
日本精工	6	8,454
ジェイテクト	3.3	6,425
不二越	3	1,959
THK	2.1	6,016
マキタ	2	10,520

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
三菱重工業	53	34,206
I H I	23	13,984
電気機器 (13.7%)		
コニカミノルタ	7.5	9,622
ブラザー工業	4.1	8,368
ミネベア	5	9,170
日立製作所	75	68,827
東芝	66	31,363
三菱電機	31	42,904
富士電機	9	4,320
安川電機	3.7	5,809
日本電産	3.3	26,320
オムロン	3.5	17,535
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6	3,150
富士通	30	19,215
沖電気工業	11	2,673
セイコーエプソン	2.1	10,279
ワコム	2.5	1,270
パナソニック	38.2	50,767
アンリツ	2	1,692
富士通ゼネラル	1	1,194
T D K	1.9	13,889
ヒロセ電機	0.5	6,950
横河電機	3.1	3,868
日本光電工業	0.7	4,025
堀場製作所	0.6	2,355
キーエンス	0.7	38,668
シスメックス	2.4	12,408
スタンレー電気	2.3	6,219
カシオ計算機	3.1	5,927
ファナック	3.3	68,194
浜松ホトニクス	1.3	7,306
京セラ	5.1	26,698
村田製作所	3.3	42,256
小糸製作所	1.9	7,134
ミツバ	0.6	1,272
キャノン	18.2	70,697
リコー	9.4	11,063
輸送用機器 (9.9%)		
トヨタ紡織	1.1	1,744
鬼怒川ゴム工業	1	517

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ユニプレス	0.6	1,249
豊田自動織機	2.9	18,444
デンソー	7.7	41,341
三井造船	12	2,292
川崎重工業	23	12,696
名村造船所	0.6	706
日産自動車	44	45,320
いすゞ自動車	9.9	14,790
トヨタ自動車	10.1	78,022
日野自動車	4.5	7,636
三菱自動車工業	11.5	11,615
N O K	1.5	5,100
カヤバ工業	4	1,968
大同メタル工業	0.4	438
カルソニックカンセイ	2	1,274
アイシン精機	2.9	12,281
マツダ	9.3	22,840
ダイハツ工業	3.7	5,742
本田技研工業	17.6	63,976
スズキ	6.6	24,753
富士重工業	10.7	46,090
ヤマハ発動機	4.8	12,086
エクセディ	0.4	1,136
豊田合成	1	2,593
エフ・シー・シー	0.5	1,112
シマノ	1.4	21,966
テイ・エス テック	0.7	2,089
精密機器 (1.2%)		
テルモ	4.8	13,526
ニコン	5.9	8,956
HOYA	7.5	32,238
その他製品 (0.5%)		
バンダイナムコホールディングス	3.5	8,323
アシックス	3.1	8,791
ビジョン	0.6	4,404
電気・ガス業 (1.1%)		
電源開発	2.1	9,019
東京瓦斯	38	26,315
大阪瓦斯	32	14,912
陸運業 (5.2%)		
東武鉄道	17	9,333

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
相鉄ホールディングス	7	3,605
東京急行電鉄	17	13,192
小田急電鉄	10	11,150
京王電鉄	9	8,397
京成電鉄	5	7,780
東日本旅客鉄道	5.7	52,052
西日本旅客鉄道	3	17,907
東海旅客鉄道	2.8	54,334
西日本鉄道	5	2,505
近畿日本鉄道	32	13,120
阪急阪神ホールディングス	21	13,545
京阪電気鉄道	9	6,390
名古屋鉄道	15	6,765
日本通運	12	7,896
ヤマトホールディングス	5.5	13,640
山九	4	1,928
日立物流	0.7	1,016
空運業 (0.4%)		
ANAホールディングス	62	19,170
倉庫・運輸関連業 (0.1%)		
上組	4	4,564
近鉄エクスプレス	0.3	1,539
情報・通信業 (7.3%)		
グリー	1.9	1,282
ティーガイア	0.3	378
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	7.8	3,143
インターネットイニシアティブ	0.5	1,231
野村総合研究所	1.8	6,795
フジ・メディア・ホールディングス	3.2	4,764
オービック	1.1	4,147
ヤフー	22.2	9,190
トレンドマイクロ	1.6	5,120
日本オラクル	0.5	2,460
伊藤忠テクノソリューションズ	0.4	1,666
大塚商会	0.8	3,052
USEN	1.8	558
エイバックス・グループ・ホールディングス	0.6	1,155
日本テレビホールディングス	2.8	5,409
日本電信電話	9.8	65,885
KDDI	10.5	86,362
光通信	0.3	2,067

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
NTTドコモ	25.5	50,426
GMOインターネット	1	974
東宝	2.2	5,574
エヌ・ティ・ティ・データ	1.9	8,341
S C S K	0.7	2,018
コナミ	1.3	2,817
ソフトバンク	8.9	65,281
卸売業 (4.5%)		
双日	20.7	3,291
アルフレッサ ホールディングス	3.7	5,154
シップヘルスケアホールディングス	0.6	1,666
三菱食品	0.3	765
第一興商	0.7	2,257
メディパルホールディングス	3.1	4,175
伊藤忠商事	25.9	31,313
丸紅	27.1	18,189
豊田通商	3.4	9,336
兼松	6	1,002
三井物産	26.2	40,924
日立ハイテクノロジーズ	1.1	4,059
山善	1.2	975
住友商事	18.3	21,786
三菱商事	23.7	50,350
岩谷産業	3	2,307
東邦ホールディングス	1.1	1,849
サンリオ	0.9	2,688
日鉄住金物産	3	1,233
ミスミグループ本社	1.2	5,058
小売業 (4.5%)		
ローソン	1.2	9,264
エービーシー・マート	0.4	2,220
ゲオホールディングス	0.6	610
日本マクドナルドホールディングス	1.3	3,337
スターバックス コーヒー ジャパン	0.7	1,021
パル	0.2	627
セリア	0.4	1,400
MonotaRO	0.6	1,635
J. フロント リテイリング	3.9	5,577
マツモトキヨシホールディングス	0.7	2,558
スタートトゥデイ	1	2,423
三越伊勢丹ホールディングス	6.1	9,857

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ウエルシアホールディングス	0.4	1,682
コスモス薬品	0.2	3,806
セブン&アイ・ホールディングス	12.9	54,644
ツルハホールディングス	0.6	4,692
良品計画	0.4	5,300
ドンキホーテホールディングス	1.1	9,295
V Tホールディングス	1.3	591
ユナイテッドアローズ	0.4	1,274
スギホールディングス	0.6	3,240
ファミリーマート	1	4,950
AOKIホールディングス	0.7	842
コメリ	0.5	1,166
しまむら	0.4	3,972
高島屋	4	3,908
イオン	12.4	15,425
ユニグループ・ホールディングス	3	1,935
イズミ	0.7	2,866
ケーズホールディングス	0.7	2,194
アインファーマシーズ	0.3	1,087
ヤマダ電機	12.2	5,136
ニトリホールディングス	1.3	8,333
王将フードサービス	0.2	834
アークス	0.7	1,652
パロー	0.7	1,515
ファーストリテイリング	0.6	25,404
サンドラッグ	0.7	3,444
銀行業 (7.6%)		
新生銀行	29	5,713
あおぞら銀行	21	8,505
三菱UFJフィナンシャル・グループ	106	66,006
りそなホールディングス	36.2	21,061
三井住友トラスト・ホールディングス	68	28,308
三井住友フィナンシャルグループ	14.6	59,115
西日本シティ銀行	11	4,004
千葉銀行	12	9,252
横浜銀行	21	13,091
常陽銀行	11	6,369
群馬銀行	7	5,250
ふくおかフィナンシャルグループ	13	7,501
静岡銀行	9	9,450
十六銀行	5	1,920

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
スルガ銀行	3.3	7,062
八十二銀行	7	5,229
ほくほくフィナンシャルグループ	21	4,893
広島銀行	9	5,031
中国銀行	3	4,887
伊予銀行	4.4	5,790
セブン銀行	10.4	5,189
みずほフィナンシャルグループ	318.5	62,553
山口フィナンシャルグループ	4	4,660
北洋銀行	4.7	2,035
京葉銀行	3	1,890
証券、商品先物取引業 (1.5%)		
大和証券グループ本社	29	25,450
野村ホールディングス	63.2	39,563
岡三証券グループ	3	2,610
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3.5	2,838
松井証券	1.6	1,644
保険業 (2.2%)		
ソニーフィナンシャルホールディングス	3	4,989
第一生命保険	19.8	32,382
東京海上ホールディングス	12.7	50,742
T & Dホールディングス	11.3	15,153
その他金融業 (1.4%)		
クレディセゾン	2.5	4,925
芙蓉総合リース	0.3	1,162
興銀リース	0.6	1,335
東京センチュリーリース	0.7	1,990
Jトラスト	0.9	872
アイフル	5.2	1,908
リコーリース	0.2	614
イオンフィナンシャルサービス	2	4,326
アコム	6.2	1,934
日立キャピタル	0.6	1,467
オリックス	21.9	30,484
三菱UFJリース	7.8	4,134
日本取引所グループ	4.5	12,451
不動産業 (3.6%)		
ヒューリック	5.2	5,465
野村不動産ホールディングス	1.9	3,781
東急不動産ホールディングス	8.1	6,407
飯田グループホールディングス	2	2,914

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
パーク24	1.6	3,035
三井不動産	17	52,343
三菱地所	23	54,958
住友不動産	7	26,911
大京	5	875
レオパレス21	3.4	2,662
住友不動産販売	0.2	552
タカラレーベン	1.4	735
イオンモール	2	4,030
エヌ・ティ・ティ都市開発	1.9	2,196
サービス業 (2.9%)		
アコーディア・ゴルフ	1.2	1,452
テンブホールディングス	0.6	2,427
カカクコム	2.2	3,652
エムスリー	2.8	6,098
ディー・エヌ・エー	1.6	2,409
博報堂DYホールディングス	4.5	5,256

銘柄	当 期 末		
	株 数	評 価 額	
	千株	千円	
電通	3.6	17,154	
みらかホールディングス	0.9	4,860	
オリエンタルランド	0.9	26,532	
リゾートトラスト	1.2	3,316	
もしもしホットライン	0.6	762	
ユー・エス・エス	4	7,112	
サイバーエージェント	0.8	3,760	
楽天	14.2	22,350	
リロ・ホールディング	0.1	850	
エイチ・アイ・エス	0.5	1,970	
セコム	3.2	21,654	
ベネッセホールディングス	1.2	4,152	
イオンデイライト	0.3	762	
合 計	株数・金額	3,340	4,680,833
	銘柄数<比率>	400	<96.2%>

(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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円 185	百万円 -
	J P X日経400		

○投資信託財産の構成

(2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,680,833	93.8
コール・ローン等、その他	306,870	6.2
投資信託財産総額	4,987,703	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,985,361,017
コール・ローン等	87,519,395
株式(評価額)	4,680,833,170
未収入金	210,693,606
未収配当金	5,244,710
未収利息	136
差入委託証拠金	1,070,000
(B) 負債	118,393,000
未払解約金	118,393,000
(C) 純資産総額(A-B)	4,866,968,017
元本	4,119,388,732
次期繰越損益金	747,579,285
(D) 受益権総口数	4,119,388,732口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,815円

〈注記事項〉

- ① 設定元本額 999,900,000円
 期中追加設定元本額 4,216,109,751円
 期中一部解約元本額 1,096,621,019円

- ② 期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)
 e MAX I S J P X 日経 4 0 0 インデックス 4,119,388,732円

○損益の状況 (2014年4月1日～2015年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	23,860,110
受取配当金	23,776,891
受取利息	72,323
その他収益金	10,896
(B) 有価証券売買損益	403,416,255
売買益	464,164,397
売買損	△ 60,748,142
(C) 先物取引等取引損益	7,497,652
取引益	50,348,368
取引損	△ 42,850,716
(D) 当期損益金(A+B+C)	434,774,017
(E) 追加信託差損益金	440,911,249
(F) 解約差損益金	△ 128,105,981
(G) 計(D+E+F)	747,579,285
次期繰越損益金(G)	747,579,285

(注) (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) (E) 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) (F) 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。

[お 知 ら せ]

- ① 書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2014年12月1日)
- ② 併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2014年12月1日)
- ③ 買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2014年12月1日)
- ④ 新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
 (2014年12月1日)
- ⑤ デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
 (2014年12月1日)