

PayPay投信AIプラス

●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／内外／株式
信託期間	無期限です。ただし、元本金額が10億円を下回った場合などはファンドを終了（繰上償還）させる場合があります。
運用方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要運用対象	主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ないます。
組入制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	①毎決算期に収益の分配を行なう方針です。ただし、基準価額の水準や市場動向等を勘案して収益の分配を行わない場合もあります。 ②分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ③信託財産に留保した収益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づき元本と同一の運用を行ないます。

運用報告書（全体版）

第11期

（2022年5月10日決算）

受益者のみなさまへ

平素は「PayPay投信AIプラス」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、このたび第11期決算を行ないましたので、期中の運用状況につきまして、ご報告申し上げます。

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。

PayPayアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区神田錦町一丁目1番地

サポートダイヤル

0120-580446

〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

<https://www.paypay-am.co.jp>

■最近10期の運用実績

決算期	基準価額			株式 組入比率	信用 取引比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	収益分配金 (課税前)	期中 騰落率				
2期(2017年11月10日)	円 12,123	円 0	% 17.1	% 95.0	% —	% 8.0	百万円 12,548
3期(2018年5月10日)	12,455	0	2.7	90.5	—	8.1	30,209
4期(2018年11月12日)	11,394	0	△8.5	86.1	—	13.5	31,870
5期(2019年5月10日)	10,331	0	△9.3	92.7	—	7.7	28,921
6期(2019年11月11日)	11,531	0	11.6	89.8	—	8.9	29,652
7期(2020年5月11日)	9,854	0	△14.5	91.1	—	9.4	22,608
8期(2020年11月10日)	11,171	0	13.4	100.8	—	8.2	23,173
9期(2021年5月10日)	13,234	0	18.5	92.4	—	8.0	16,506
10期(2021年11月10日)	13,536	0	2.3	94.8	—	4.8	13,884
11期(2022年5月10日)	12,873	0	△4.9	91.9	—	7.4	12,339

*基準価額の騰落率は収益分配金(課税前)込み。

*信用取引比率は、買建比率-売建比率。

*株式先物比率は、買建比率-売建比率。

*当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動することを運用の基本方針とはしていないため、該当するベンチマーク等はありません。

■当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		株式 組入比率	信用 取引比率	株式 先物比率
		騰落率			
(期首) 2021年11月10日	円 13,536	% —	% 94.8	% —	% 4.8
11月末	13,227	△2.3	93.1	—	6.7
12月末	13,695	1.2	95.8	—	3.7
2022年1月末	12,851	△5.1	92.9	—	7.5
2月末	12,744	△5.9	92.3	—	7.5
3月末	13,447	△0.7	91.4	—	7.3
4月末	13,124	△3.0	91.7	—	7.4
(期末) 2022年5月10日	12,873	△4.9	91.9	—	7.4

*期末基準価額は収益分配金(課税前)込み。騰落率は期首比。

*信用取引比率は、買建比率-売建比率。

*株式先物比率は、買建比率-売建比率。

■当期の運用実績

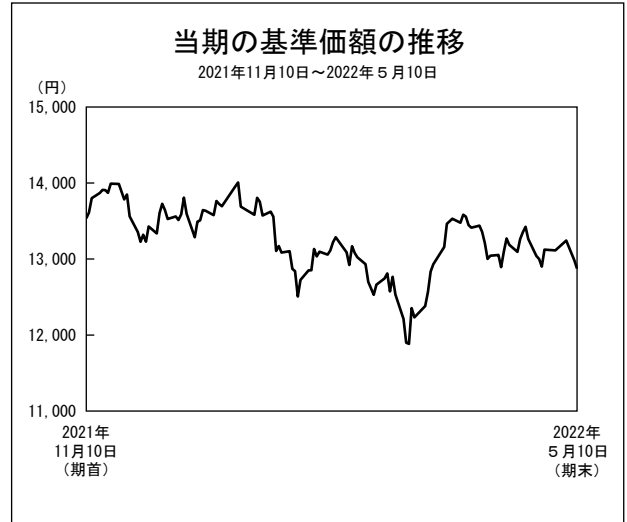
〈基準価額の動き〉

当期末の基準価額は、12,873円となり、前期末との比較では4.9%の下落となりました。

〈基準価額の主な変動要因〉

インフレへの警戒感やウクライナ情勢の緊迫化などを背景に国内株式市場が下落したことなどがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

※当期は外国の株式への投資は行ないませんでした。当ファンドは、国内外の株式を投資対象としていますので、今後、外国の株式への投資を行なう場合があります。



〈収益分配金〉

収益分配金（1万口当たり、課税前、以下同じ）については、基準価額の水準や分配原資の積み上がり状況等を勘案し、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利益につきましては、信託財産内に留保し元本部分と同一の運用を行ないます。

なお、分配原資の内訳は以下の通りです。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	第11期
	2021年11月11日 ～2022年5月10日
当期分配金(税込み)	－円
(対基準価額比率)	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	3,846円

* 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（評価益を含む）」から分配に充当した金額です。

また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

* 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

* 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

〈市況〉

当期の国内株式市場は軟調に推移しました。

米国でインフレへの警戒感が高まったことや新型コロナウイルスの変異株「オミクロン株」の出現などが重石となり、2022年1月にかけて下落基調で推移しました。その後も、ウクライナ情勢の緊迫化などからリスク回避の動きが強まり、一段安となりました。ウクライナとロシアの停戦交渉進展への期待感などから3月に反転する場面も見られましたが、新型コロナウイルス感染拡大に伴うロックダウン（都市封鎖）の継続を受けて中国の景気減速懸念が高まったことや主要国の金融引締め観測などを背景に期末にかけて上値の重い動きが続きました。

■当期の運用経過

当ファンドは、主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本としています。運用にあたっては、ヤフー株式会社が提供するビッグデータの解析等を通じて市場の歪み（マーケットアノマリー）を見出し、今後の株価の上昇（市場平均を上回る上昇を含みます。）が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なうことを基本としています。また、信用取引を活用した株式の売建てや株式に関連するデリバティブ取引（株価指数先物取引等を含みます。）等を行なう場合があります。

当期も運用の基本方針に則り、ビッグデータの解析等を通じて、株価の季節性により最適な投資タイミングと判断された銘柄の組入れなどを行ないました。また、市場全体の値動きに追随するため、TOPIX先物取引を活用しました。一方、当期は信用取引を活用した株式の売建てや外国の株式への投資は行ないませんでした。

■今後の運用方針

今後も主として国内外の金融商品取引所に上場している株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なってまいります。運用にあたっては、ヤフー株式会社が提供するビッグデータの解析等を通じて市場の歪み（マーケットアノマリー）を見出し、今後の株価の上昇（市場平均を上回る上昇を含みます。）が高い確度で予測される銘柄の組入れを行なう方針です。また、信用取引や株式に関連するデリバティブ取引（株価指数先物取引等を含みます。）等も活用してまいります。

今後も投資環境の変化には注意を払いながら運用にあたり、運用成果の向上に全力で取り組む所存ですので、引き続きご愛顧賜りますようよろしくお願い申し上げます。

※上記は作成日時点の見通しであり、今後予告なしに変更することがあります。また市場の変動等により方針通りの運用が行なわれない場合があります。

■ 1 万口 (元本10,000円) 当たりの費用の明細

項 目	第11期		項 目 の 概 要
	(2021. 11. 11～2022. 5. 10)		
	金 額	比 率	
信託報酬	66円	0.502%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率。期中の平均基準価額（月末値の平均値）は13,181円です。
（投信会社）	(30)	(0.229)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(32)	(0.245)	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）	(4)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	26	0.195	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。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
（株式）	(26)	(0.194)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
その他費用	3	0.020	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）	(1)	(0.011)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（法定開示に係る費用）	(1)	(0.009)	印刷会社等に支払う目論見書、運用報告書等の作成、印刷、交付等に係る費用
合 計	95	0.717	

* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

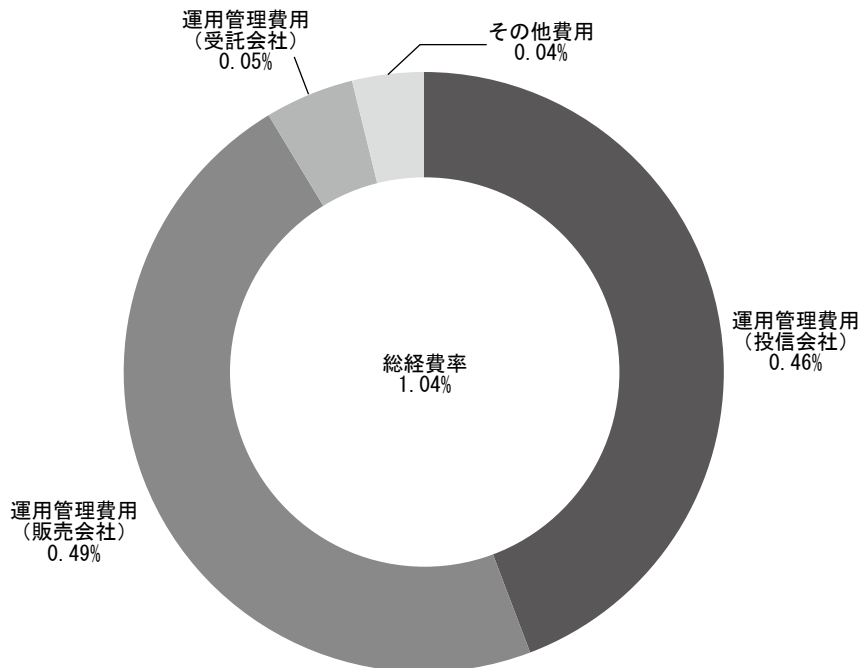
* 「金額」欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.04%です。



*費用は、1万口当たりの費用の明細において用いた簡便法により算出したものです。

*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。

*各比率は、年率換算した値です。

*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 (2021年11月11日から2022年5月10日まで)

(1) 株 式

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株	千円	千株	千円
上 場	12,778 (22)	30,888,734 (-)	11,860	32,005,102

*金額は受渡し代金。

*単位未満は切捨て。

* () 内は増資割当、株式転換・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。

* -印は該当なし。

(2) 先物取引の銘柄別取引状況

	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引 TOPIX	2,695	2,380	-	-

*単位未満は切捨て。

* -印は該当なし。

■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	62,893,837千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	11,925,428千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	5.27

*期中の株式売買金額は、受渡し代金。

*期中の平均組入株式時価総額は、各月末現在の組入株式時価総額の単純平均。

*単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄（自2021年11月11日 至2022年5月10日）

● 株 式

当 期				当 期			
買 付		売 付		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
東京海上ホールディングス	87	602,167	6,921	新光電気工業	200.6	1,069,553	5,331
トヨタ自動車	259.4	566,614	2,184	東京海上ホールディングス	127.9	847,846	6,628
新光電気工業	98.6	498,356	5,054	キーエンス	9.5	635,079	66,850
日本製鉄	236.8	489,806	2,068	レーザーテック	22.2	617,347	27,808
オリンパス	193.5	460,706	2,380	三井住友フィナンシャルグループ	136.3	551,015	4,042
商船三井	50.1	454,854	9,078	信越化学工業	27.8	537,412	19,331
三井住友フィナンシャルグループ	102.2	425,944	4,167	東京エレクトロン	9.1	537,217	59,034
ソフトバンクグループ	61.7	360,601	5,844	富士電機	89.1	515,434	5,784
クボタ	135.5	320,757	2,367	リクルートホールディングス	79.7	498,303	6,252
三井不動産	122.9	320,564	2,608	オリンパス	202.7	478,009	2,358

*金額は受渡し代金。
*単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況（自2021年11月11日 至2022年5月10日）

● 期中の利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	30,888	—	0.0	32,005	—	0.0
株 式 先 物 取 引	2,695	—	0.0	2,380	—	0.0

*金額は受渡し代金。単位未満は切捨て。

● 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株 式	681	892	288

*金額は受渡し代金。単位未満は切捨て。

● 期中の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)	25,050千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	—千円
(B) / (A)	0.0%

*金額は受渡し代金。単位未満は切捨て。

*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Zホールディングス株式会社、ソフトバンクグループ株式会社、ソフトバンク株式会社です。

■組入資産の明細 (2022年5月10日現在)

(1) 国内株式 (上場株式)

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
鉱業(0.4%)			
INPEX	—	31.9	46,924
建設業(2.9%)			
ショーボンドホールディングス	—	9.5	51,395
ミライト・ホールディングス	—	31.5	57,960
大成建設	—	13.8	48,576
戸田建設	—	48.7	36,184
大和ハウス工業	38.5	—	—
積水ハウス	22.3	—	—
きんでん	—	46.6	71,204
エクシオグループ	—	14.4	31,492
インフロンア・ホールディングス	—	31.4	30,301
食料品(3.8%)			
日清製粉グループ本社	—	19.9	34,427
森永乳業	—	10.9	54,336
ヤクルト本社	—	8.1	54,513
アサヒグループホールディングス	—	5.8	27,329
麒麟ホールディングス	—	14.7	28,179
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	—	30.6	45,104
キッコーマン	7.4	4.5	32,400
味の素	83.2	8.6	25,911
カゴメ	—	6.6	21,186
日清食品ホールディングス	—	4.8	42,864
日本たばこ産業	—	29.1	65,722
繊維製品(0.5%)			
東レ	358.9	79.9	51,199
パルプ・紙(0.3%)			
王子ホールディングス	—	51.5	31,157
化学(6.5%)			
旭化成	42.9	52.8	56,073
昭和電工	—	14.9	36,713
日産化学	—	2.5	17,500
信越化学工業	23	7.5	133,912
日本酸素ホールディングス	—	5.6	12,947
カネカ	—	12.9	44,892
JSR	—	13.6	50,660
三菱ケミカルホールディングス	—	43.2	35,026
ADEKA	—	13.4	31,798
花王	—	9.8	51,842
関西ペイント	—	22.4	40,096
DIC	—	1.9	4,774
富士フイルムホールディングス	12.4	4	28,392
資生堂	21.5	13	69,641
ライオン	—	17.9	24,988
デクセリアルズ	—	5.3	14,935
ニッポ	—	16.8	46,015
ユニ・チャーム	—	9.4	40,185

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(5.7%)			
武田薬品工業	—	30.2	113,974
アステラス製薬	62.6	27.5	53,680
塩野義製薬	—	8.4	59,547
中外製薬	—	18.5	68,764
エーザイ	—	3.9	21,808
小野薬品工業	—	13.3	45,193
ツムラ	—	11.4	37,107
第一三共	—	34	111,792
大塚ホールディングス	—	11.5	51,071
大正製薬ホールディングス	—	10.5	54,390
ペプチドリーム	—	15.8	29,988
石油・石炭製品(0.4%)			
出光興産	—	6.5	22,457
ENEOSホールディングス	—	45.2	21,239
ゴム製品(0.6%)			
ブリヂストン	—	15.3	72,491
ガラス・土石製品(0.8%)			
AGC	—	8.5	41,692
日本特殊陶業	—	22.4	51,542
鉄鋼(0.4%)			
日本製鉄	10.5	16.9	32,760
ジェイエフイーホールディングス	—	7.7	11,619
非鉄金属(1.3%)			
三菱マテリアル	—	14	27,888
住友金属鉱山	7.4	3.2	16,704
DOWAホールディングス	—	4	20,800
住友電気工業	20.8	32	45,584
アサヒホールディングス	—	17.2	35,776
機械(4.7%)			
ディスコ	—	1.3	40,560
SMC	—	1.1	67,705
小松製作所	44.9	27.1	83,955
クボタ	58.9	17.1	39,116
荏原製作所	—	6.4	37,312
ダイキン工業	11.6	5.1	100,087
ダイフク	—	6.3	47,376
ホシザキ	—	5.7	45,828
マキタ	9.5	—	—
三菱重工	—	16.7	73,880
電気機器(18.0%)			
イビデン	—	6.8	31,076
ブラザー工業	—	20.2	46,601
ミネベアミツミ	—	14.4	35,452
日立製作所	35.5	26	167,648
東芝	—	7.1	37,949
三菱電機	—	22.7	30,667

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
富士電機	49.6	—	—
マブチモーター	—	9.2	31,924
日本電産	20.8	13.4	111,421
オムロン	17.1	8.8	62,348
日本電気	11	6.9	36,915
富士通	—	3.7	72,039
ルネサスエレクトロニクス	130.7	34.5	46,713
パナソニック ホールディングス	—	56.7	65,516
アンリツ	—	18.1	26,914
ソニーグループ	40.5	29	304,500
TDK	—	6.4	26,016
横河電機	—	13.1	26,291
堀場製作所	—	5.4	33,696
アドバンテスト	13.9	4.6	38,548
キーエンス	10.3	3.9	196,560
シスメックス	12.7	4.3	32,813
レーザークレック	16.3	2.7	46,251
スタンレー電気	—	24.3	55,476
ファナック	6	3.7	72,002
ローム	—	1.5	13,935
新光電気工業	102	—	—
京セラ	—	5.4	37,373
村田製作所	21.7	12.7	104,775
キャノン	—	27.3	85,449
東京エレクトロン	7.4	3	160,350
輸送用機器(8.5%)			
豊田自動織機	—	8	66,080
デンソー	—	5.8	43,436
日産自動車	—	94	47,667
トヨタ自動車	98	242.3	527,850
アイシン	—	6.7	25,326
本田技研工業	58.2	22.5	75,352
スズキ	—	14.4	56,520
SUBARU	—	19	37,221
ヤマハ発動機	—	16.4	45,592
シマノ	7.2	1.5	33,517
精密機器(2.3%)			
テルモ	56.6	16.9	62,986
オリンパス	36.9	27.7	61,341
HOYA	18	8.9	111,339
メニコン	—	10.9	28,503
その他製品(2.3%)			
バンダイナムコホールディングス	5	5.1	42,018
パイロットコーポレーション	—	8.8	45,056
凸版印刷	—	15	32,730
任天堂	—	2.5	140,900
電気・ガス業(1.4%)			
東京電力ホールディングス	—	59.1	30,672
中部電力	17.3	—	—
関西電力	22	15.2	19,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
東北電力	—	60.7	47,042
電源開発	—	9.9	18,117
東京瓦斯	10.8	15.1	38,459
陸運業(3.0%)			
東日本旅客鉄道	12.1	11.6	76,676
西日本旅客鉄道	28.4	3.7	17,649
東海旅客鉄道	3	5.7	92,112
近鉄グループホールディングス	—	4.7	17,578
阪急阪神ホールディングス	—	3.6	12,348
南海電気鉄道	—	29.2	71,919
S Gホールディングス	—	23.2	54,032
海運業(0.7%)			
日本郵船	—	1.9	17,613
商船三井	—	19.4	61,110
空運業(0.6%)			
日本航空	—	14.8	31,583
A N Aホールディングス	53.5	17.2	41,323
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
上組	—	12.5	27,825
情報・通信業(8.3%)			
ネクソン	—	6.5	19,136
野村総合研究所	—	8.9	29,637
オービック	—	2.1	38,304
Zホールディングス	375.3	101.2	44,163
トレンドマイクロ	—	7.3	52,560
伊藤忠テクノソリューションズ	—	18.5	55,592
日本電信電話	78	39.3	151,344
KDD I	58.2	32	138,976
ソフトバンク	149.6	69.1	104,479
光通信	—	3.3	49,401
GMOインターネット	—	12.2	29,389
エヌ・ティ・ティ・データ	—	9.1	20,611
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	4.9	25,872
コナミホールディングス	—	5.3	40,121
ソフトバンクグループ	18.5	28.6	140,140
卸売業(6.3%)			
双日	—	39.6	78,210
神戸物産	—	5.9	17,169
アズワン	—	5.5	35,200
伊藤忠商事	70.6	30.5	112,636
丸紅	133.1	64.7	83,139
長瀬産業	—	43.9	82,575
三井物産	57.7	30.5	96,014
住友商事	43.5	21	39,228
三菱商事	98.2	33.6	138,667
ミスミグループ本社	—	11.9	33,879
小売業(3.7%)			
マツキョココカラ&カンパニー	—	12.6	53,676
セブン&アイ・ホールディングス	14.7	16.4	93,562
FOOD & LIFE COMPANIE	—	11.3	35,934

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ゼンショーホールディングス	—	28	82,264
イオン	26.1	30.7	73,280
ヤマダホールディングス	—	66.8	32,064
ニトリホールディングス	—	2.5	31,762
ファーストリテイリング	0.3	0.3	17,406
銀行業(5.5%)			
めぶきフィナンシャルグループ	—	163.8	43,734
ゆうちょ銀行	—	66	64,746
コンソルディア・フィナンシャルグループ	—	106.8	51,050
三菱UFJフィナンシャル・グループ	404.3	270.2	202,704
りそなホールディングス	—	34.8	18,997
三井住友フィナンシャルグループ	69.6	35.5	139,231
八十二銀行	—	178.8	81,354
みずほフィナンシャルグループ	—	16.3	25,835
証券、商品先物取引業(1.3%)			
SBIホールディングス	—	12.8	36,595
大和証券グループ本社	—	96.4	60,211
野村ホールディングス	66.1	98.7	47,770
保険業(2.3%)			
SOMPOホールディングス	11.4	8.5	44,446
MS&ADインシュアランスグループホール	15.9	6	23,568
第一生命ホールディングス	34.4	25.5	66,223
東京海上ホールディングス	52.5	11.6	80,283
T&Dホールディングス	—	26.3	44,078

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
その他金融業(1.0%)			
全国保証	—	5.2	23,634
オリックス	71.8	40.7	93,772
日本取引所グループ	17.2	—	—
不動産業(2.1%)			
ヒューリック	—	44.3	46,072
三井不動産	37.2	21.2	56,890
三菱地所	46.1	29.8	54,340
東京建物	—	18	32,040
住友不動産	32	14.9	49,691
サービス業(4.2%)			
日本M&Aセンターホールディングス	—	23.5	32,900
エムスリー	—	11.5	44,114
電通グループ	—	7.4	34,521
オリエンタルランド	7	5.3	91,160
リゾートトラスト	—	24	49,872
楽天グループ	—	38.4	32,793
リクルートホールディングス	71.4	35.3	154,190
日本郵政	—	12.5	11,398
セコム	—	2.3	21,408
合 計			
	株数、金額	3,819	4,760
	銘柄数(比率)	73	200
			11,344,498
			(91.9%)

*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。

*合計欄の()内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切捨て。

*-印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末		
		買 建 額	売 建 額	評 価 損 益
国内		百万円	百万円	百万円
株式先物取引	TOPIX	914	—	61

*単位未満は切捨て。

*-印は組入れなし。

■投資信託財産の構成 (2022年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	11,344,498	91.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,087,731	8.7
投 資 信 託 財 産 総 額	12,432,229	100.0

*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

(2022年5月10日)現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	12,432,229,380
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	865,780,732
株 式 (評 価 額)	11,344,498,190
未 収 入 金	61,958,050
未 収 配 当 金	182,777,408
差 入 委 託 証 拠 金	△22,785,000
(B)負 債	93,137,513
未 払 解 約 金	25,518,106
未 払 信 託 報 酬	64,996,365
未 払 利 息	1,659
そ の 他 未 払 費 用	2,621,383
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	12,339,091,867
元 本	9,585,281,745
次 期 繰 越 損 益 金	2,753,810,122
(D)受 益 権 総 口 数	9,585,281,745口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,873円

■損益の状況

(自2021年11月11日 至2022年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	196,556,238
受 取 配 当 金	196,591,976
取 得 利 息	30
そ の 他 収 益 金	254,472
支 払 利 息	△290,240
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△686,108,840
売 買 益	1,198,905,946
売 買 損	△1,885,014,786
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△59,972,503
取 引 益	70,914,437
取 引 損	△130,886,940
(D)信 託 報 酬 等	△67,617,748
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△617,142,853
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,683,070,048
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	1,687,882,927
(配 当 等 相 当 額)	(1,875,144,867)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△187,261,940)
(H)計 (E + F + G)	2,753,810,122
(I)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (H + I)	2,753,810,122
追 加 信 託 差 損 益 金	1,687,882,927
(配 当 等 相 当 額)	(1,875,144,867)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△187,261,940)
分 配 準 備 積 立 金	1,812,008,538
繰 越 損 益 金	△746,081,343

* 損益の状況の中で(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。

* 損益の状況の中で(D)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。

* 損益の状況の中で(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。

(注記事項)

- ・ 期首元本額 10,257,323,645円
- ・ 期中追加設定元本額 562,056,043円
- ・ 期中一部解約元本額 1,234,097,943円

■収益分配金のお知らせ

当期の収益分配は、見送らせていただきました。