

■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（2012年5月31日設定）	
運用方針	ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンドを主要投資対象とし、日経平均株価（225種）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。株式（株価指数先物取引等含む）の実質組入比率は高位を保ちます。運用の効率化を図るため、および当該株価指数への連動を目指すため、有価証券先物取引等を利用します。	
主要運用対象	ベビーファンド	ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均株価（225種）に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質的な投資は行いません。
	マザーファンド	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。
収益分配方針	<p>毎年2月10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。</p> <p>①分配対象収益の範囲 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。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。</p> <p>②分配対象収益についての分配方針 分配金額は、委託者が分配可能額、基準価額水準等を勧告のうえ決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わない場合があります。</p> <p>③留保益の運用方針 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。</p>	

ちゅうぎん日経225 インデックスファンド

第12期 運用報告書（全体版）

決算日 2024年2月13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、「ちゅうぎん日経225インデックスファンド」は、2024年2月13日に第12期の決算を行いました。当ファンドは、ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンドを主要投資対象とし、日経平均株価（225種）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。ここに期中の運用状況を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。

◆ 中銀アセットマネジメント

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

〈お問い合わせ先〉

サポートダイヤル：086-224-5310

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページ：<https://www.chugin-am.jp/>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価 (225種)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
8期 (2020年2月10日)	28,285	250	15.1	23,685.98	13.5	97.2	2.6	7,371
9期 (2021年2月10日)	35,505	250	26.4	29,562.93	24.8	95.7	4.2	7,130
10期 (2022年2月10日)	33,306	250	△ 5.5	27,696.08	△ 6.3	97.8	2.1	10,736
11期 (2023年2月10日)	33,492	300	1.5	27,670.98	△ 0.1	96.0	4.0	10,419
12期 (2024年2月13日)	46,235	400	39.2	37,963.97	37.2	98.0	1.9	9,646

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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－売建比率です。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

日経平均株価 (225種) とは

株式会社日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所プライム市場上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。

1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

(注) 「日経平均」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は「日経平均」自体及び「日経平均」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。

(注) 「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。

(注) 本件投資信託は、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、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

(注) 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」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。

(注) 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」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。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (225種) (ベンチマーク)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率 %	円	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年 2月10日	33,492	—	27,670.98	—	96.0	4.0
2月末	33,231	△ 0.8	27,445.56	△ 0.8	96.0	4.0
3月末	34,247	2.3	28,041.48	1.3	98.4	1.4
4月末	35,230	5.2	28,856.44	4.3	94.3	5.6
5月末	37,703	12.6	30,887.88	11.6	93.5	6.3
6月末	40,545	21.1	33,189.04	19.9	97.1	2.8
7月末	40,519	21.0	33,172.22	19.9	94.5	5.5
8月末	39,852	19.0	32,619.34	17.9	97.6	2.4
9月末	39,174	17.0	31,857.62	15.1	91.6	8.2
10月末	37,928	13.2	30,858.85	11.5	96.1	3.9
11月末	41,130	22.8	33,486.89	21.0	97.7	2.1
12月末	41,152	22.9	33,464.17	20.9	95.1	4.8
2024年 1月末	44,607	33.2	36,286.71	31.1	95.0	4.8
(期 末) 2024年 2月13日	46,635	39.2	37,963.97	37.2	98.0	1.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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－売建比率です。

運用経過

■ 基準価額等の推移について（2023年2月11日～2024年2月13日）



第12期首：33,492円

第12期末：46,235円（既払分配金400円）

騰落率：39.2%（分配金再投資ベース）

(注) ベンチマークは日経平均株価（225種）です。

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(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。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首時（2023年2月10日）の値が基準価額と同一になるように指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的にわが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資することにより、ベンチマーク（日経平均株価）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。

詳しくは後掲の「投資環境について」をご参照ください。

■投資環境について（2023年2月11日～2024年2月13日）

当期の国内株式市場は大きく上昇しました。

期首から3月にかけては、一部の米国の銀行が破綻したことをきっかけに金融システムへの不安が高まり、下落する場面もありましたが、日銀の次期総裁候補者が国会での所信聴取で金融緩和の継続方針を表明したことを背景に、底堅い推移となりました。

4月から6月にかけては、米国の労働市場が堅調に推移する中で景気後退懸念が和らいだことや、大手半導体企業の業績見通しが市場予想を大きく上回ったことを背景に、上昇基調で推移しました。

7月から9月にかけては、米国のインフレ鈍化を背景に、米国経済のソフトランディング（軟着陸）期待が高まったことに加え、円安・ドル高の進行を受けて、輸出関連企業を中心に国内企業の業績改善が見込まれたことから、底堅い動きが継続しました。

10月から12月にかけては、F R B（米連邦準備制度理事会）による利上げ局面が終了したとの見方が強まり、米国の長期金利が大幅に低下したことを好感して、特に11月は大きく上昇しました。

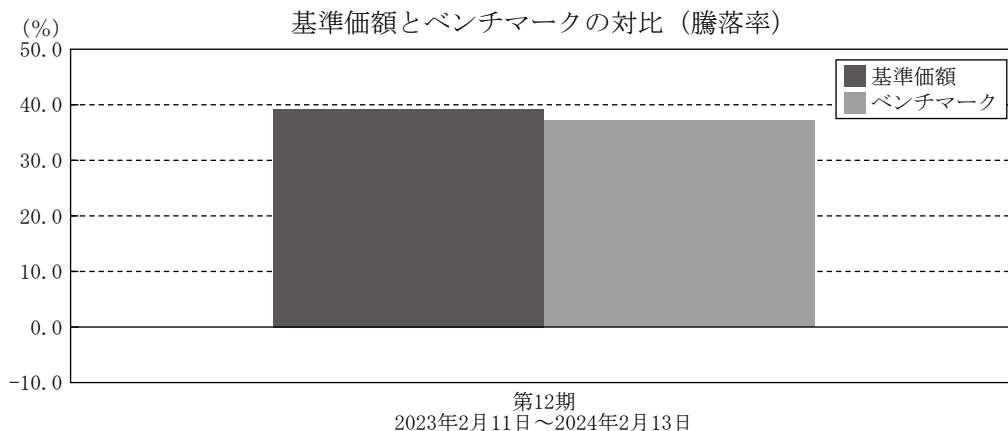
1月から期末にかけては、米国の早期利下げ観測が後退したことを受け、外国為替市場で円安・ドル高が進行したことから、輸出関連企業を中心にさらなる業績拡大が期待され、一段と上昇する展開となりました。

■当ファンドのポートフォリオについて（2023年2月11日～2024年2月13日）

マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドは日経平均株価（225種）をベンチマークとしています。以下のグラフは基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



(注) 基準価格の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) ベンチマークの詳細は1ページをご参照ください。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+39.2%となり、ベンチマーク騰落率+37.2%を上回りました。マザーファンドで株式の配当金を計上していることなどがプラスに働きましたが、おおむねベンチマークに連動しました。

■分配金について

当期につきましては、分配可能額、基準価額水準などを勘案し、1万口当たり400円とさ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きましては、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

【分配原資の内訳】

(1万口当たり・税込み)

項 目	第 12 期
	2023年2月11日～2024年2月13日
当期分配金	400円
(対基準価額比率)	0.858%
当期の収益	400円
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	36,234円

(注) 「当期の収益」は、費用控除後の配当等収益および費用控除後・繰越欠損補填後の有価証券売買等損益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。

(注) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は小数点以下切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(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、当ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針について

マザーファンド受益証券への投資を通じて、ベンチマーク（日経平均株価）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 2023年2月11日～2024年2月13日		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	194円	0.499%	(a) 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は38,776円です。
(投 信 会 社)	(86)	(0.222)	委託した資金の運用等の対価
(販 売 会 社)	(86)	(0.222)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理等の対価
(受 託 会 社)	(22)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	4	0.010	(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)	(1)	(0.003)	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
(先物・オプション)	(3)	(0.007)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.005	(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)	(2)	(0.005)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	200	0.514	

(注) 期中において発生した費用（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。なお、売買委託手数料及びその他費用は、当ファンドが組み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。

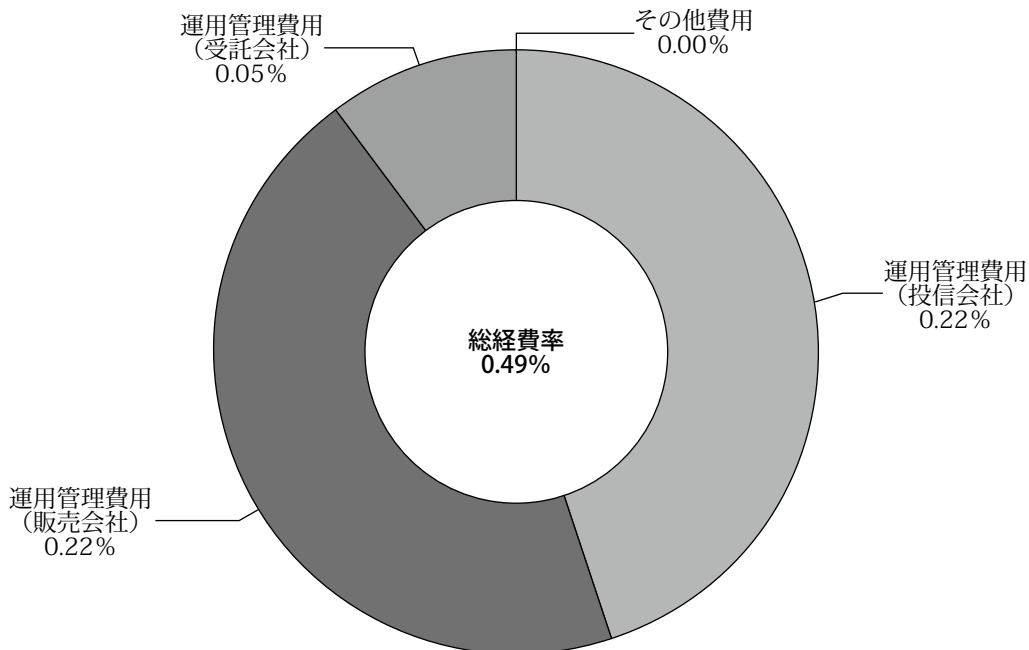
(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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、項目ごとに小数点第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、売買委託手数料及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0.49%です。



(注) 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、売買委託手数料及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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年2月11日から2024年2月13日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド	千口 3,368,006	千円 13,496,000	千口 4,392,594	千円 17,601,000

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 口数、金額の単位未満は切捨てております。

■親投資信託の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
	ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	15,296,718千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	19,289,377千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.79

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月11日から2024年2月13日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(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（2024年2月13日現在）

親投資信託残高

種 類	期 首（前期末）	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド	千口 3,025,511	千口 2,000,923	千円 9,646,453

(注) 口数、評価額の単位未満は切捨てております。

(注) ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド全体の受益権口数は期末4,586,431千口です。

■投資信託財産の構成

(2024年2月13日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド	千円 9,646,453 % 91.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	865,907 8.2
投 資 信 託 財 産 総 額	10,512,360 100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年2月13日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,512,360,672円
コール・ローン等	271,907,375
ちゅうぎん日経225インデックス マザーファンド(評価額)	9,646,453,297
未 収 入 金	594,000,000
(B) 負 債	865,402,605
未 払 収 益 分 配 金	83,460,521
未 払 解 約 金	756,702,972
未 払 信 託 報 酬	24,961,087
未 払 利 息	744
そ の 他 未 払 費 用	277,281
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	9,646,958,067
元 本	2,086,513,035
次 期 繰 越 損 益 金	7,560,445,032
(D) 受 益 権 総 口 数	2,086,513,035口
1万口当たり基準価額(C/D)	46,235円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,110,937,582円、期中追加設定元本額は5,363,898,195円、期中一部解約元本額は6,388,322,742円です。

(注) 1口当たり純資産額は4.6235円です。

■損益の状況

当期 (自2023年2月11日 至2024年2月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 27,707円
支 払 利 息	△ 27,707
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,462,380,541
売 買 益	2,458,604,665
売 買 損	△ 996,224,124
(C) 信 託 報 酬 等	△ 48,895,425
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,413,457,409
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,593,786
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,222,854,358
(配 当 等 相 当 額)	(2,500,788,575)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,722,065,783)
(G) 計 (D+E+F)	7,643,905,553
(H) 収 益 分 配 金	△ 83,460,521
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	7,560,445,032
追 加 信 託 差 損 益 金	6,222,854,358
(配 当 等 相 当 額)	(2,537,661,927)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,685,192,431)
分 配 準 備 積 立 金	1,337,590,674

(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、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(163,366,477円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,249,107,032円)、信託約款に規定する収益調整金(6,222,854,358円)および分配準備積立金(8,577,686円)より分配対象収益は7,643,905,553円(10,000口当たり36,634円)であり、うち83,460,521円(10,000口当たり400円)を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	400円
----------------	------

◆収益分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払い開始しております。

◆収益分配金を再投資される方の収益分配金は、税金を差し引いた後、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

■お知らせ

該当事項はございません。

ちゅうぎん日経225インデックスマザーファンド

運用報告書

《第12期》

決算日：2024年2月13日

(計算期間：2023年2月11日～2024年2月13日)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2012年2月28日から無期限です。
運用方針	この投資信託は、日経平均株価（225種）の動きに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	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均株価（225種）に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）を主要投資対象とします。
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。



中銀アセットマネジメント

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		日経平均株価 (225種)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落			
8 期 (2020年2月10日)	円	%	円	%	%	%	百万円
9 期 (2021年2月10日)	27,963	15.9	23,685.98	13.5	97.3	2.6	17,565
10期 (2022年2月10日)	35,546	27.1	29,562.93	24.8	95.7	4.2	18,013
11期 (2023年2月10日)	33,767	△ 5.0	27,696.08	△ 6.3	97.8	2.1	20,888
12期 (2024年2月13日)	34,433	2.0	27,670.98	△ 0.1	96.0	4.0	19,362
	48,210	40.0	37,963.97	37.2	98.0	1.9	22,111

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

(注) ベンチマークは日経平均株価 (225種) です。ベンチマークの詳細は1ページをご参照下さい。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (225種)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	騰 落	率	(ベンチマーク)	騰 落		
(期 首) 2023年 2月10日	円	%	円	%	%	%
	34,433	—	27,670.98	—	96.0	4.0
2月末	34,173	△ 0.8	27,445.56	△ 0.8	96.0	4.0
3月末	35,233	2.3	28,041.48	1.3	98.4	1.4
4月末	36,258	5.3	28,856.44	4.3	94.3	5.6
5月末	38,821	12.7	30,887.88	11.6	93.5	6.3
6月末	41,765	21.3	33,189.04	19.9	97.1	2.8
7月末	41,756	21.3	33,172.22	19.9	94.5	5.5
8月末	41,086	19.3	32,619.34	17.9	97.6	2.4
9月末	40,403	17.3	31,857.62	15.1	91.7	8.2
10月末	39,135	13.7	30,858.85	11.5	96.1	3.9
11月末	42,457	23.3	33,486.89	21.0	97.7	2.1
12月末	42,496	23.4	33,464.17	20.9	95.1	4.8
2024年 1月末	46,085	33.8	36,286.71	31.1	95.0	4.8
(期 末) 2024年 2月13日	48,210	40.0	37,963.97	37.2	98.0	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

■当期の運用概況と今後の運用方針（2023年2月11日から2024年2月13日まで）



(注) ベンチマークは日経平均株価（225種）で、期首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。ベンチマークの詳細は1ページをご参照下さい。

◆基準価額の主な変動要因

わが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資することにより、ベンチマーク（日経平均株価）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。

詳しくは後掲の「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

期首から3月にかけては、一部の米国の銀行が破綻したことをきっかけに金融システムへの不安が高まり、下落する場面もありましたが、日銀の次期総裁候補者が国会での所信聴取で金融緩和の継続方針を表明したことを背景に、底堅い推移となりました。

4月から6月にかけては、米国の労働市場が堅調に推移する中で景気後退懸念が和らいだことや、大手半導体企業の業績見通しが市場予想を大きく上回ったことを背景に、上昇基調で推移しました。

7月から9月にかけては、米国のインフレ鈍化を背景に、米国経済のソフトランディング（軟着陸）期待が高まったことに加え、円安・ドル高の進行を受けて、輸出関連企業を中心に国内企業の業績改善が見込まれたことから、底堅い動きが継続しました。

10月から12月にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ局面が終了したとの見方が強まり、米国の長期金利が大幅に低下したことを好感して、特に11月は大きく上昇しました。

1月から期末にかけては、米国の早期利下げ観測が後退したことを受け、外国為替市場で円安・ドル高が進行したことから、輸出関連企業を中心にさらなる業績拡大が期待され、一段と上昇する展開となりました。

◆当ファンドのポートフォリオについて

当期もわが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資し、ベンチマーク（日経平均株価）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

また資金の流出入などに対応するため、株価指数先物も一部活用しました。

◆今後の運用方針について

わが国の金融商品取引所に上場されている株式に投資し、ベンチマーク（日経平均株価）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

項 目	金 額	比 率
(a) 売 買 委 託 手 数 料	4円	0.010%
(株 式)	(1)	(0.003)
(先物・オプション)	(3)	(0.007)
合 計	4	0.010

(注) 1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の計算期間のものです。

(注) 項目の概要については、6ページの「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■期中の売買及び取引の状況（2023年2月11日から2024年2月13日まで）

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		1,398 (1,056)	6,065,326 ()	2,196	9,231,392

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 株数、金額の単位未満は切捨てております。

(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。

(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	百万円	百万円	百万円
		23,841	24,471	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

■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
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	15,296,718千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	19,289,377千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.79

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

■主要な売買銘柄（2023年2月11日から2024年2月13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
ファーストリテイリング		18	590,499	32,805	ファーストリテイリング		30	994,896	33,163
東京エレクトロン		16	343,018	21,438	東京エレクトロン		28	580,609	20,736
ソフトバンクグループ		36	216,822	6,022	ソフトバンクグループ		60	347,849	5,797
レーザーテック		8.8	205,416	23,342	アドバンテスト		38	309,077	8,133
アドバンテスト		24	196,506	8,187	KDD I		60	263,112	4,385
KDD I		36	156,576	4,349	ダイキン工業		10	247,133	24,713
ダイキン工業		6	148,577	24,762	信越化学工業		46	228,480	4,966
信越化学工業		26	132,799	5,107	ファナック		46	224,489	4,880
ファナック		26	131,635	5,062	テルモ		40	166,164	4,154
オリエンタルランド		28	130,771	4,670	TDK		30	163,068	5,435

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 金額、平均単価の単位未満は切捨てております。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月11日から2024年2月13日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(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 (2024年2月13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
水産・農林業 (0.1%)			
ニッスイ	23	19	17,645
鉱業 (0.1%)			
INPEX	9.2	7.6	15,302
建設業 (1.5%)			
コムシスホールディングス	23	19	60,743
大成建設	4.6	3.8	18,528
大林組	23	19	26,514
清水建設	23	19	17,003
長谷工コーポレーション	4.6	3.8	7,001
鹿島建設	11.5	9.5	26,419
大和ハウス工業	23	19	82,878
積水ハウス	23	19	62,073
日揮ホールディングス	23	19	27,046
食料品 (3.3%)			
日清製粉グループ本社	23	19	39,358
明治ホールディングス	4.6	7.6	25,992
日本ハム	11.5	9.5	49,827
サッポロホールディングス	4.6	3.8	26,125
アサヒグループホールディングス	23	19	107,046
キリンホールディングス	23	19	41,743
宝ホールディングス	23	19	23,921
キッコーマン	23	19	177,061
味の素	23	19	111,587
ニチレイ	11.5	9.5	35,093
日本たばこ産業	23	19	76,532
繊維製品 (0.1%)			
東洋紡	2.3	—	—
帝人	4.6	3.8	4,763
東レ	23	19	13,153
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	23	19	10,896
日本製紙	2.3	1.9	2,262
化学 (6.6%)			
クラレ	23	19	30,276
旭化成	23	19	19,997
レゾナック・ホールディングス	2.3	1.9	5,646
住友化学	23	19	5,757
日産化学	23	19	117,838
東ソー	11.5	9.5	18,230
トクヤマ	4.6	3.8	8,943
デンカ	4.6	3.8	9,545
信越化学工業	23	95	569,050

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井化学	4.6	3.8	15,283
三菱ケミカルグループ	11.5	9.5	8,128
UBE	2.3	1.9	4,876
花王	23	19	107,882
DIC	2.3	1.9	5,480
富士フイルムホールディングス	23	19	176,453
資生堂	23	19	81,168
日東電工	23	19	250,705
医薬品 (5.8%)			
協和キリン	23	19	53,665
武田薬品工業	23	19	82,650
アステラス製薬	115	95	157,225
住友ファーマ	23	19	6,973
塩野義製薬	23	19	137,294
中外製薬	69	57	326,154
エーザイ	23	19	127,034
第一三共	69	57	268,299
大塚ホールディングス	23	19	101,821
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	9.2	38	31,578
ENEOSホールディングス	23	19	11,880
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	11.5	9.5	34,532
ブリヂストン	23	19	123,253
ガラス・土石製品 (0.7%)			
AGC	4.6	3.8	20,147
日本板硝子	2.3	—	—
日本電気硝子	6.9	5.7	20,987
住友大阪セメント	2.3	1.9	6,878
太平洋セメント	2.3	1.9	6,030
東海カーボン	23	19	19,864
TOTO	11.5	9.5	35,473
日本碍子	23	19	36,337
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	2.3	1.9	6,798
神戸製鋼所	2.3	1.9	3,756
JFEホールディングス	2.3	1.9	4,362
大平洋金属	2.3	1.9	2,633
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	2.3	—	—
三井金属鉱業	2.3	1.9	8,567
東邦亜鉛	2.3	—	—
三菱マテリアル	2.3	1.9	4,996

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
		千株		千円
住友金属鉱山	11.5	9.5		38,741
DOWAホールディングス	4.6	3.8		20,957
古河電気工業	2.3	1.9		5,573
住友電気工業	23	19		40,318
フジクラ	23	19		32,433
金属製品 (0.0%)				
SUMCO	2.3	1.9		4,388
機械 (4.4%)				
日本製鋼所	4.6	3.8		9,083
オークマ	4.6	3.8		26,725
アマダ	23	19		30,219
SMC	2.3	1.9		158,118
小松製作所	23	19		82,232
住友重機械工業	4.6	3.8		15,188
日立建機	23	19		79,591
クボタ	23	19		41,524
荏原製作所	4.6	3.8		36,195
ダイキン工業	23	19		407,455
日本精工	23	19		15,200
NTN	23	19		5,437
ジェイテクト	23	19		26,486
三井E&S	2.3	—		—
日立造船	4.6	3.8		4,100
三菱重工業	2.3	1.9		20,045
IHI	2.3	1.9		5,766
電気機器 (28.4%)				
コニカミノルタ	23	19		9,087
ミネベアミツミ	23	19		58,007
日立製作所	4.6	3.8		46,949
三菱電機	23	19		41,239
富士電機	4.6	3.8		32,794
安川電機	23	19		104,766
ニデック	18.4	15.2		84,192
オムロン	23	19		104,462
ジェス・ユアサ コーポレーション	4.6	3.8		9,946
日本電気	2.3	1.9		18,361
富士通	2.3	1.9		43,842
ルネサスエレクトロニクス	—	19		50,397
セイコーエプソン	46	38		91,941
パナソニック ホールディングス	23	19		27,312
シャープ	23	19		16,068
ソニーグループ	23	19		279,965
TDK	69	57		453,492
アルプスアルパイン	23	19		20,786
横河電機	23	19		60,458
アドバンテスト	46	152		1,022,352
キーエンス	2.3	1.9		127,205

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
		千株		千円
レーザーテック	—	7.6		306,660
カシオ計算機	23	19		22,135
ファナック	23	95		381,520
京セラ	46	152		330,980
太陽誘電	23	19		66,443
村田製作所	18.4	45.6		137,940
SCREENホールディングス	4.6	7.6		134,824
キヤノン	34.5	28.5		117,277
リコー	23	19		24,215
東京エレクトロン	23	57		1,922,040
輸送用機器 (4.8%)				
デンソー	23	76		198,474
川崎重工業	2.3	1.9		6,931
日産自動車	23	19		10,632
いすゞ自動車	11.5	9.5		19,294
トヨタ自動車	115	95		328,320
日野自動車	23	19		8,797
三菱自動車工業	2.3	1.9		852
マツダ	4.6	3.8		6,748
本田技研工業	46	114		195,966
スズキ	23	19		126,673
SUBARU	23	19		63,612
ヤマハ発動機	23	57		83,790
精密機器 (3.7%)				
テルモ	92	76		412,300
ニコン	23	19		28,386
オリンパス	92	76		162,108
HOYA	11.5	9.5		175,750
シチズン時計	23	19		18,810
その他製品 (2.3%)				
バンダイナムコホールディングス	23	57		178,125
TOPPANホールディングス	11.5	9.5		38,722
大日本印刷	11.5	9.5		43,709
ヤマハ	23	19		66,842
任天堂	23	19		165,490
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	2.3	1.9		1,465
中部電力	2.3	1.9		3,599
関西電力	2.3	1.9		3,653
東京瓦斯	4.6	3.8		12,133
大阪瓦斯	4.6	3.8		11,529
陸運業 (1.2%)				
東武鉄道	4.6	3.8		14,854
東急	11.5	9.5		16,439
小田急電鉄	11.5	9.5		20,187
京王電鉄	4.6	3.8		16,252
京成電鉄	11.5	9.5		68,172

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
東日本旅客鉄道	2.3	1.9	17,212	千円
西日本旅客鉄道	2.3	1.9	11,981	
東海旅客鉄道	2.3	9.5	35,653	
ヤマトホールディングス	23	19	46,227	
NIPPON EXPRESSホールディングス	2.3	1.9	16,195	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	6.9	5.7	26,784	
商船三井	6.9	5.7	29,064	
川崎汽船	6.9	5.7	38,155	
空運業 (0.3%)				
日本航空	—	19	53,428	
ANAホールディングス	2.3	1.9	6,211	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	11.5	9.5	43,424	
情報・通信業 (10.5%)				
ネクソン	46	38	96,976	
メルカリ	—	19	46,274	
LINEヤフー	9.2	7.6	3,372	
トレンドマイクロ	23	19	164,540	
日本電信電話	9.2	190	34,390	
KDDI	138	114	518,358	
ソフトバンク	23	19	37,202	
東宝	2.3	1.9	8,924	
NTTデータグループ	115	95	212,467	
コナミグループ	23	19	180,709	
ソフトバンクグループ	138	114	968,088	
卸売業 (3.2%)				
双日	2.3	1.9	7,090	
伊藤忠商事	23	19	126,692	
丸紅	23	19	45,657	
豊田通商	23	19	177,916	
三井物産	23	19	116,242	
住友商事	23	19	65,246	
三菱商事	23	57	164,701	
小売業 (12.6%)				
J.フロント リテイリング	11.5	9.5	14,620	
三越伊勢丹ホールディングス	23	19	38,674	
セブン&アイ・ホールディングス	23	19	118,370	
高島屋	11.5	9.5	21,090	
丸井グループ	23	19	47,101	
イオン	23	19	68,875	
ニトリホールディングス	—	5.7	121,296	
ファーストリテイリング	23	57	2,289,120	
銀行業 (0.6%)				
しずおかフィナンシャルグループ	23	19	26,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	23	19	13,315	
あおぞら銀行	2.3	1.9	4,096	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	千株	株 数	評 価 額
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23	19	26,799	千円
りそなホールディングス	2.3	1.9	1,548	
三井住友トラスト・ホールディングス	2.3	3.8	11,166	
三井住友フィナンシャルグループ	2.3	1.9	14,595	
千葉銀行	23	19	20,976	
ふくおかフィナンシャルグループ	4.6	3.8	14,250	
みずほフィナンシャルグループ	2.3	1.9	5,140	
証券・商品先物取引業 (0.2%)				
大和証券グループ本社	23	19	19,931	
野村ホールディングス	23	19	15,515	
松井証券	23	—	—	
保険業 (1.0%)				
SOMPOホールディングス	4.6	3.8	31,270	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.9	5.7	37,711	
第一生命ホールディングス	2.3	1.9	6,068	
東京海上ホールディングス	34.5	28.5	121,894	
T&Dホールディングス	4.6	3.8	9,273	
その他金融業 (0.8%)				
クレディセゾン	23	19	52,848	
オリックス	23	19	57,513	
日本取引所グループ	23	19	70,205	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	23	19	18,834	
三井不動産	23	19	75,449	
三菱地所	23	19	39,662	
東京建物	11.5	9.5	21,199	
住友不動産	23	19	86,925	
サービス業 (4.1%)				
エムスリー	55.2	45.6	93,457	
ディー・エヌ・エー	6.9	5.7	7,310	
電通グループ	23	19	79,021	
オリエンタルランド	—	19	99,693	
サイバーエージェント	18.4	15.2	15,777	
楽天グループ	23	19	12,192	
リクルートホールディングス	69	57	358,017	
日本郵政	23	19	27,217	
セコム	23	19	203,775	
合 計	株 数・金 額	4,402	4,660	21,660,614
	銘柄数<比率>	225	225	<98.0%>

(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です。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注) 株数、評価額の単位未満は切捨てております。ただし株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

(注) 一印は組み入れなしです。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	日経225	419	—
			百万円	百万円

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

(注) —印は組み入れなしです。

■投資信託財産の構成

(2024年2月13日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
株式	21,660,614	95.4%
コール・ローン等、その他	1,045,105	4.6
投資信託財産総額	22,705,719	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年2月13日現在)

項目	当期末
(A) 資産	22,705,719,471円
コール・ローン等	974,887,593
株式(評価額)	21,660,614,650
未収入金	24,608,560
未収配当金	33,031,000
差入委託証拠金	12,577,668
(B) 負債	594,552,670
未払解約金	594,550,000
未払利息	2,670
(C) 純資産総額(A-B)	22,111,166,801
元本	4,586,431,317
次期繰越損益金	17,524,735,484
(D) 受益権総口数	4,586,431,317口
1万口当たり基準価額(C/D)	48,210円

(注) 当マザーファンドの期首元本額は5,623,314,352円、期中追加設定元本額は3,395,873,940円、期中一部解約元本額は4,432,756,975円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、下記の通りです。

元本の内訳

ちゅうぎん日経225インデックスファンド	2,000,923,729円
ちゅうぎん日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,923,896,288円
CHAM日経225インデックスファンド(適格機関投資家専用)	421,157,018円
つみたて日経225インデックスファンド	240,454,282円

(注) 1口当たり純資産額は4,8210円です。

■損益の状況

当期(自2023年2月11日 至2024年2月13日)

項目	当期
(A) 配当等収益	398,354,506円
受取配当金	399,174,872
受取利息	9
その他収益	47,688
支払利息	△868,063
(B) 有価証券売買損益	6,240,912,158
売買益	6,831,220,757
売買損	△590,308,599
(C) 先物取引等取引損益	274,739,200
取引益	430,398,320
取引損	△155,659,120
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,914,005,864
(E) 前期繰越損益金	13,739,496,585
(F) 追加信託差損益金	10,215,026,060
(G) 解約差損益金	△13,343,793,025
(H) 計(D+E+F+G)	17,524,735,484
次期繰越損益金(H)	17,524,735,484

(注) 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。

(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、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)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

該当事項はございません。