

■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	1999年7月23日から無期限です。	
運用方針	アムンディ・日経225オープンマザーファンドの受益証券への投資を通じて、日経平均株価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・日経225オープン	アムンディ・日経225オープンマザーファンドの受益証券
	アムンディ・日経225オープンマザーファンド	東京証券取引所プライム市場に上場されている株式
組入制限	りそな・日経225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・日経225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（年1回、原則毎年7月11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う方針です。分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準、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・日経225オープン

運用報告書（全体版）

第24期（決算日 2023年7月11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、よろしくお願ひ申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

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/>

< 3010986・3038415 >

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		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	%	円	%	%	%	百万円
20期(2019年7月11日)	14,002	0	0.4	21,643.53	△ 1.3	99.0	0.9	41,097
21期(2020年7月13日)	14,946	0	6.7	22,784.74	5.3	97.8	2.1	32,344
22期(2021年7月12日)	18,875	0	26.3	28,569.02	25.4	97.5	2.4	31,828
23期(2022年7月11日)	17,904	0	△ 5.1	26,812.30	△ 6.1	96.7	3.2	29,872
24期(2023年7月11日)	21,816	0	21.8	32,203.57	20.1	97.6	2.4	26,243

(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) ベンチマークは日経平均株価です。日経平均株価（日経225）に関する著作権、その他一切の知的財産権は日本経済新聞社に帰属します。また、日本経済新聞社は、日経平均株価の内容を変える権利、公表を停止する権利を有しています。以下同じ。

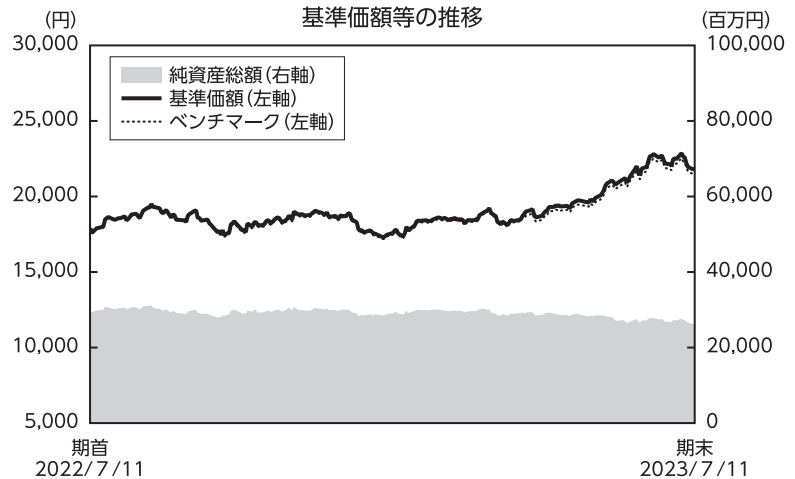
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		日経平均株価		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	%	円	%	%	%
2022年7月11日	17,904	—	26,812.30	—	96.7	3.2
7月末	18,560	3.7	27,801.64	3.7	98.2	1.8
8月末	18,749	4.7	28,091.53	4.8	98.7	1.3
9月末	17,448	△ 2.5	25,937.21	△ 3.3	97.1	2.8
10月末	18,541	3.6	27,587.46	2.9	97.3	2.6
11月末	18,789	4.9	27,968.99	4.3	98.5	1.5
12月末	17,546	△ 2.0	26,094.50	△ 2.7	97.0	2.8
2023年1月末	18,361	2.6	27,327.11	1.9	99.3	0.7
2月末	18,440	3.0	27,445.56	2.4	98.2	1.7
3月末	19,002	6.1	28,041.48	4.6	95.0	4.9
4月末	19,543	9.2	28,856.44	7.6	98.7	1.4
5月末	20,917	16.8	30,887.88	15.2	99.0	1.1
6月末	22,489	25.6	33,189.04	23.8	97.0	3.0
(期末)						
2023年7月11日	21,816	21.8	32,203.57	20.1	97.6	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第24期首	17,904円
第24期末	21,816円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	21.8%



(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、日経平均株価です。
(注2) ベンチマークは、2022年7月11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 米国のインフレ懸念の後退による金利低下が好感されたこと (2022年8月、10月)
- ② 日銀新総裁の金融緩和政策が確認されたことに加え、東京証券取引所による企業経営改革への期待から海外投資家から資金流入が継続したこと (2023年4月～期末)

下落要因

- ① 米国のインフレ懸念の高まりを背景とした金利先高観による金利上昇が嫌気されたこと (2022年9月)
- ② 日銀による金融政策の修正が発表されたことにより日本国内においても金融引き締め本格化への懸念が拡大したこと (2022年12月)

【投資環境】

投資環境につきましては、主要投資対象であるアムンディ・日経225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、日経平均株価に連動する投資成果を目標としております。運用に際しては、アムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象としております。当期においても、基本方針に基づきマザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

<アムンディ・日経225オープンマザーファンド>

マザーファンドのポートフォリオにつきましては、アムンディ・日経225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+21.8%と、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（+20.1%）を1.7%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：当ファンドが投資しているアムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券での保有株式の受取配当金など

マイナス要因：信託報酬などの費用負担

【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・日経225オープンマザーファンド受益証券の組入れを高位に維持することにより、日経平均株価に連動した投資成果を目指して運用を行います。

<アムンディ・日経225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・日経225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24期 (2022年7月12日 ～2023年7月11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)	157円 (63) (73) (21)	0.825% (0.330) (0.385) (0.110)	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)	0 (0) (0)	0.002 (0.000) (0.002)	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)	3 (1) (1) (1)	0.018 (0.008) (0.003) (0.008)	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	160	0.845	

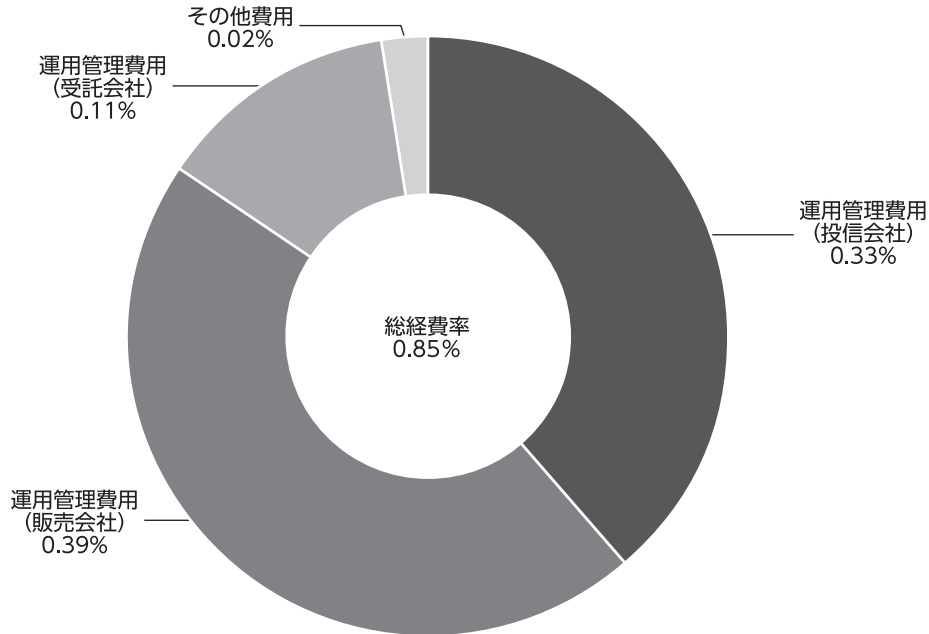
期中の平均基準価額は19,032円です。

- (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0.85%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（2022年7月12日から2023年7月11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・日経225オープンマザーファンド	1,993,106	4,375,892	5,924,660	14,127,049

(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・日経225オープンマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	23,069,306千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	42,691,508千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.54

(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（2022年7月12日から2023年7月11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（2023年7月11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・日経225オープンマザーファンド	13,790,412	9,858,857	26,239,350

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) アムンディ・日経225オープンマザーファンド全体の受益権口数は、当期末13,900,394千口です。

■投資信託財産の構成 (2023年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	26,239,350	98.8
コール・ローン等、その他	320,330	1.2
投資信託財産総額	26,559,680	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

(2023年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	26,559,680,369円
コール・ローン等	179,395,252
アムンディ・日経225オープンマザーファンド(評価額)	26,239,350,117
未 収 入 金	140,935,000
(B) 負 債	315,860,780
未 払 解 約 金	195,138,073
未 払 信 託 報 酬	117,106,627
そ の 他 未 払 費 用	3,616,080
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	26,243,819,589
元 本	12,029,645,896
次 期 繰 越 損 益 金	14,214,173,693
(D) 受 益 権 総 口 数	12,029,645,896口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,816円

(注記事項)

期首元本額	16,684,840,602円
期中追加設定元本額	3,594,947,553円
期中一部解約元本額	8,250,142,259円

■損益の状況

当期 (自2022年7月12日 至2023年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 47,357円
支 払 利 息	△ 47,357
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,769,385,775
売 買 損 益	5,993,280,733
売 買 損 益	△ 1,223,894,958
(C) 信 託 報 酬 等	△ 245,516,972
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	4,523,821,446
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,429,765,874
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,260,586,373
(配 当 等 相 当 額)	(10,598,084,869)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,337,498,496)
(G) 計 (D+E+F)	14,214,173,693
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	14,214,173,693
追 加 信 託 差 損 益 金	8,260,586,373
(配 当 等 相 当 額)	(10,614,244,862)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,353,658,489)
分 配 準 備 積 立 金	5,953,587,320

(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24期
	(2022年7月12日～2023年7月11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	13,772

(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・日経225オープンマザーファンド

運用報告書

《第24期》

決算日：2023年7月11日

(計算期間：2022年7月12日～2023年7月11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	当ファンドは、日経平均株価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	東京証券取引所プライム市場に上場されている株式
組入制限	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。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	期中 騰落率		期中 騰落率				
	円	%	円	%	%	%	百万円
20期 (2019年7月11日)	16,513	1.3	21,643.53	△ 1.3	99.1	0.9	58,312
21期 (2020年7月13日)	17,777	7.7	22,784.74	5.3	97.8	2.1	45,251
22期 (2021年7月12日)	22,641	27.4	28,569.02	25.4	97.5	2.4	43,935
23期 (2022年7月11日)	21,658	△ 4.3	26,812.30	△ 6.1	96.7	3.2	44,972
24期 (2023年7月11日)	26,615	22.9	32,203.57	20.1	97.6	2.4	36,995

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注2) ベンチマークは日経平均株価です。日経平均株価（日経225）に関する著作権、その他一切の知的財産権は日本経済新聞社に帰属します。また、日本経済新聞社は、日経平均株価の内容を変える権利、公表を停止する権利を有しています。以下同じ。

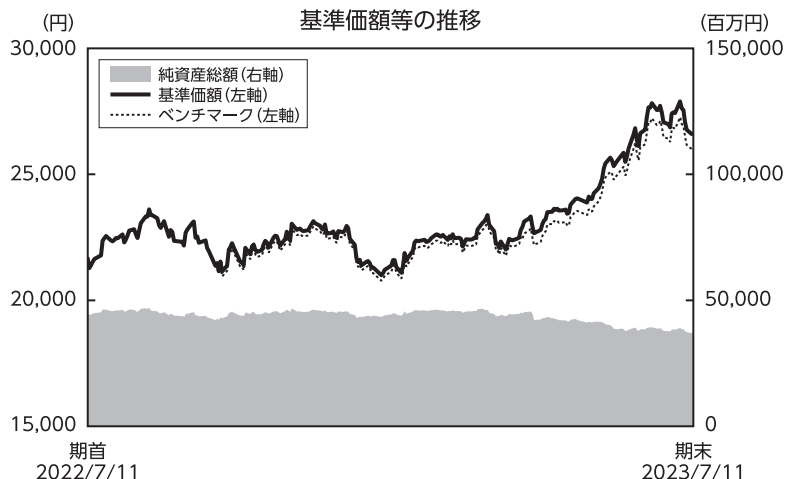
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率
	騰落率		騰落率			
(期首)	円	%	円	%	%	%
2022年7月11日	21,658	—	26,812.30	—	96.7	3.2
7月末	22,461	3.7	27,801.64	3.7	98.2	1.8
8月末	22,707	4.8	28,091.53	4.8	98.7	1.3
9月末	21,146	△ 2.4	25,937.21	△ 3.3	97.1	2.8
10月末	22,487	3.8	27,587.46	2.9	97.3	2.6
11月末	22,803	5.3	27,968.99	4.3	98.5	1.5
12月末	21,309	△ 1.6	26,094.50	△ 2.7	97.0	2.8
2023年1月末	22,316	3.0	27,327.11	1.9	99.3	0.7
2月末	22,426	3.5	27,445.56	2.4	98.3	1.7
3月末	23,127	6.8	28,041.48	4.6	95.0	4.9
4月末	23,801	9.9	28,856.44	7.6	98.7	1.4
5月末	25,494	17.7	30,887.88	15.2	99.0	1.1
6月末	27,429	26.6	33,189.04	23.8	97.0	3.0
(期末)						
2023年7月11日	26,615	22.9	32,203.57	20.1	97.6	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第24期首	21,658円
第24期末	26,615円
騰落率	22.9%



(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、日経平均株価です。

(注2) ベンチマークは、2022年7月11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 米国のインフレ懸念の後退による金利低下が好感されたこと（2022年8月、10月）
- ② 日銀新総裁の金融緩和政策が確認されたことに加え、東京証券取引所による企業経営改革への期待から海外投資家から資金流入が継続したこと（2023年4月～期末）

下落要因

- ① 米国のインフレ懸念の高まりを背景とした金利先高観による金利上昇が嫌気されたこと（2022年9月）
- ② 日銀による金融政策の修正が発表されたことにより日本国内においても金融引き締め本格化への懸念が拡大したこと（2022年12月）

【投資環境】**＜国内株式市場＞**

当期の国内株式市場は上昇しました。当期は期初より米国のインフレ見通しの変化を背景とした米国金利の変動が主な要因となり米国株式市場が上下に振れる展開となりました。国内株式市場もこの米国株式市場の動きに連動しながら上下に振れながら方向感の乏しい展開が12月半ばまで継続しました。しかし、年末になると日銀が金融政策の修正を発表し、国内においても金融引き締めが本格化すると懸念が広がり、株価は下落しました。2023年3月に入り米国の中堅銀行の破綻やクレディ・スイス・グループの経営不安のニュースを背景に金融システム不安が広がり株式市場は世界的に急落しました。しかし、米国中小銀行の預金保護の方針が表明されたことや、UBSによるクレディ・スイス・グループ買収合意が発表されると市場は落ち着きを取り戻し、反発しました。その後も日銀による金融緩和策の維持や米国のインフレ懸念の後退、さらには東京証券取引所の要請に応じた企業経営改革への期待から海外投資家の旺盛な買い増しにより日本株は力強い上昇を続け、日経平均株価は33年振りの高値を付けました。その後、高値警戒感や米国での追加利上げに対する懸念からやや値を下げて期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

当マザーファンドは、日経平均株価採用銘柄のうち、流動性、財務内容等を勘案し、原則として200銘柄以上に投資を行い、日経平均株価に連動した投資成果を目指します。

当期につきましては、引き続き225銘柄全てを組入れる完全法でポートフォリオを構築いたしました。期中の日経平均株価の構成銘柄の変更に対しても適切に銘柄の入替えや組入比率の調整を行いました。期中の設定・解約に際しましては、株式先物を利用するとともに立会外取引、イブニング・セッションなどを利用しコストの削減と連動性の維持を図りました。株式組入比率は、期初より日経平均株価との連動性を維持するため、株式先物を利用することにより出来る限り高位を保ちました。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+22.9%と、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（+20.1%）を2.8%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：保有株式の受取配当金など

マイナス要因：売買手数料など

【今後の運用方針】

運用の基本方針に基づき、引き続き、日経平均株価に連動した投資成果を目指して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第24期 (2022年7月12日 ～2023年7月11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)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)	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)	0.001 (0.001)	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	0	0.003	
期中の平均基準価額は23,125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 (2022年7月12日から2023年7月11日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 879 (1,262)	千円 3,955,078 ()	千株 4,577	千円 19,114,228

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引	26,442	27,301	907	908

■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	23,069,306千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	42,691,508千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.54

(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 (2022年7月12日から2023年7月11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
ニデック	46.4	404,439	8,716	ファーストリテイリング	60	2,072,115	34,535
HOYA	29	401,635	13,849	東京エレクトロン	56	1,109,830	19,818
SMC	5.8	338,297	58,327	ソフトバンクグループ	132	715,998	5,424
ファーストリテイリング	5	249,175	49,835	KDD I	132	561,984	4,257
オリエンタルランド	53	239,968	4,527	アドバンテスト	44	559,230	12,709
日本航空	53	136,868	2,582	ダイキン工業	22	559,060	25,411
東京エレクトロン	5	125,960	25,192	ファナック	90	520,665	5,785
ルネサスエレクトロニクス	53	101,401	1,913	信越化学工業	90	451,185	5,013
ソフトバンクグループ	18	99,642	5,535	テルモ	88	355,584	4,040
KDD I	18	72,366	4,020	TDK	66	326,733	4,950

(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 (2022年7月12日から2023年7月11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 (2023年7月11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%)			
ニッスイ	57	38	25,270
マルハニチロ	5.7	-	-
鉱業(0.1%)			
INPEX	22.8	15.2	24,715
建設業(1.6%)			
コムシホールディングス	57	38	104,671
大成建設	11.4	7.6	38,813
大林組	57	38	46,740
清水建設	57	38	33,991
長谷工コーポレーション	11.4	7.6	13,623
鹿島建設	28.5	19	40,327
大和ハウス工業	57	38	139,346
積水ハウス	57	38	108,053
日揮ホールディングス	57	38	68,571
食料品(3.4%)			
日清製粉グループ本社	57	38	64,676
明治ホールディングス	11.4	15.2	49,552
日本ハム	28.5	19	74,575
サッポロホールディングス	11.4	7.6	27,443
アサヒグループホールディングス	57	38	204,972
キリンホールディングス	57	38	78,299
宝ホールディングス	57	38	43,244
キッコーマン	57	38	298,528
味の素	57	38	207,480
ニチレイ	28.5	19	57,646
日本たばこ産業	57	38	115,444
繊維製品(0.1%)			
東洋紡	5.7	-	-
ユニチカ	5.7	-	-
帝人	11.4	7.6	11,073
東レ	57	38	29,955
パルプ・紙(0.1%)			
王子ホールディングス	57	38	19,950
日本製紙	5.7	3.8	4,491
化学(6.9%)			
クラレ	57	38	51,794
旭化成	57	38	36,784
レゾナック・ホールディングス	5.7	3.8	8,770
住友化学	57	38	16,549
日産化学	57	38	234,916
東ソー	28.5	19	32,879
トクヤマ	11.4	7.6	17,586
デンカ	11.4	7.6	20,577
信越化学工業	57	190	870,960

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	11.4	7.6	30,932
三菱ケミカルグループ	28.5	19	15,922
UBE	5.7	3.8	9,349
花王	57	38	204,820
DIC	5.7	3.8	9,942
富士フイルムホールディングス	57	38	312,246
資生堂	57	38	242,820
日東電工	57	38	378,594
医薬品(6.4%)			
協和キリン	57	38	98,420
武田薬品工業	57	38	167,618
アステラス製薬	285	190	389,405
住友ファーマ	57	38	25,327
塩野義製薬	57	38	218,044
中外製薬	171	114	435,708
エーザイ	57	38	336,300
第一三共	171	114	441,522
大塚ホールディングス	57	38	196,612
石油・石炭製品(0.2%)			
出光興産	22.8	15.2	44,171
ENEOSホールディングス	57	38	18,753
ゴム製品(0.8%)			
横浜ゴム	28.5	19	57,266
ブリヂストン	57	38	218,044
ガラス・土石製品(0.8%)			
AGC	11.4	7.6	37,217
日本板硝子	5.7	3.8	2,378
日本電気硝子	17.1	11.4	28,534
住友大阪セメント	5.7	3.8	13,813
太平洋セメント	5.7	3.8	10,318
東海カーボン	57	38	46,854
TOTO	28.5	19	80,123
日本碍子	57	38	64,239
鉄鋼(0.1%)			
日本製鉄	5.7	3.8	11,192
神戸製鋼所	5.7	3.8	5,025
JFEホールディングス	5.7	3.8	7,552
大平洋金属	5.7	3.8	5,920
非鉄金属(0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	5.7	-	-
三井金属鉱業	5.7	3.8	12,308
東邦亜鉛	5.7	-	-
三菱マテリアル	5.7	3.8	9,463
住友金属鉱山	28.5	19	89,300
DOWAホールディングス	11.4	7.6	34,177

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
古河電気工業	5.7	3.8	9,731
住友電気工業	57	38	64,296
フジクラ	57	38	44,289
金属製品(0.0%)			
SUMCO	5.7	3.8	7,873
機械(5.8%)			
日本製鋼所	11.4	7.6	22,522
オークマ	11.4	7.6	55,358
アマダ	57	38	52,174
SMC	—	3.8	291,194
小松製作所	—	38	139,764
住友重機械工業	11.4	7.6	25,277
日立建機	57	38	146,528
クボタ	57	38	77,672
荏原製作所	11.4	7.6	51,748
ダイキン工業	57	38	1,090,410
日本精工	57	38	33,778
NTN	57	38	11,445
ジェイテクト	57	38	48,697
三井E&S	5.7	3.8	1,930
日立造船	11.4	7.6	6,885
三菱重工業	5.7	3.8	24,513
IHI	5.7	3.8	14,280
電気機器(25.4%)			
コニカミノルタ	57	38	18,874
ミネベアミツミ	57	38	95,304
日立製作所	11.4	7.6	67,168
三菱電機	57	38	76,095
富士電機	11.4	7.6	45,265
安川電機	57	38	231,078
ニデック	—	30.4	227,179
オムロン	57	38	326,686
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11.4	7.6	21,382
日本電気	5.7	3.8	25,783
富士通	5.7	3.8	68,799
沖電気工業	5.7	—	—
ルネサスエレクトロニクス	—	38	101,175
セイコーエプソン	114	76	165,642
パナソニック ホールディングス	57	38	63,213
シャープ	57	38	29,959
ソニーグループ	57	38	481,650
TDK	171	114	602,946
アルプスアルパイン	57	38	46,189
横河電機	57	38	100,909
アドバンテスト	114	76	1,542,800
キーエンス	5.7	3.8	250,002
カシオ計算機	57	38	44,517
ファナック	57	190	905,920

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京セラ	114	76	573,952
太陽誘電	57	38	158,346
村田製作所	45.6	30.4	243,504
SCREENホールディングス	11.4	7.6	120,042
キヤノン	85.5	57	212,781
リコー	57	38	45,714
東京エレクトロン	57	114	2,293,110
輸送用機器(4.6%)			
デンソー	57	38	352,336
川崎重工業	5.7	3.8	13,493
日産自動車	57	38	21,656
いすゞ自動車	28.5	19	32,870
トヨタ自動車	285	190	420,090
日野自動車	57	38	22,667
三菱自動車工業	5.7	3.8	1,961
マツダ	11.4	7.6	9,918
本田技研工業	114	76	317,984
スズキ	57	38	204,668
SUBARU	57	38	96,273
ヤマハ発動機	57	38	151,658
精密機器(3.9%)			
テルモ	228	152	660,288
ニコン	57	38	69,502
オリンパス	228	152	335,844
HOYA	—	19	307,135
シチズン時計	57	38	33,288
その他製品(2.6%)			
バンダイナムコホールディングス	57	114	354,882
凸版印刷	28.5	19	57,931
大日本印刷	28.5	19	75,031
ヤマハ	57	38	200,184
任天堂	5.7	38	237,766
電気・ガス業(0.1%)			
東京電力ホールディングス	5.7	3.8	1,951
中部電力	5.7	3.8	6,399
関西電力	5.7	3.8	6,522
東京瓦斯	11.4	7.6	23,468
大阪瓦斯	11.4	7.6	16,036
陸運業(1.3%)			
東武鉄道	11.4	7.6	27,998
東急	28.5	19	32,214
小田急電鉄	28.5	19	35,843
京王電鉄	11.4	7.6	32,915
京成電鉄	28.5	19	111,606
東日本旅客鉄道	5.7	3.8	29,978
西日本旅客鉄道	5.7	3.8	22,173
東海旅客鉄道	5.7	3.8	66,500
ヤマトホールディングス	57	38	99,047

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
NIPPON EXPRESSホールディングス	5.7	3.8	30,802
海運業(0.3%)			
日本郵船	5.7	11.4	37,243
商船三井	17.1	11.4	40,219
川崎汽船	5.7	11.4	42,966
空運業(0.4%)			
日本航空	—	38	117,724
ANAホールディングス	5.7	3.8	12,752
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
三菱倉庫	28.5	19	65,284
情報・通信業(10.4%)			
ネクソン	114	76	201,476
Zホールディングス	22.8	15.2	5,578
トレンドマイクロ	57	38	258,970
日本電信電話	22.8	380	61,940
KDDI	342	228	967,176
ソフトバンク	57	38	57,874
東宝	5.7	3.8	20,687
N T Tデータグループ	285	190	364,895
コナミグループ	57	38	284,696
ソフトバンクグループ	342	228	1,539,228
卸売業(3.2%)			
双日	5.7	3.8	12,285
伊藤忠商事	57	38	209,304
丸紅	57	38	90,155
豊田通商	57	38	274,132
三井物産	57	38	196,916
住友商事	57	38	112,670
三菱商事	57	38	261,516
小売業(12.5%)			
J. フロント リテイリング	28.5	19	25,821
三越伊勢丹ホールディングス	57	38	55,138
セブン&アイ・ホールディングス	57	38	228,000
高島屋	28.5	19	37,515
丸井グループ	57	38	93,385
イオン	57	38	114,152
ファーストリテイリング	57	114	3,947,820
銀行業(0.6%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	38	40,166
コンコルディア・フィナンシャルグループ	57	38	22,127
あおぞら銀行	5.7	3.8	10,286
三菱UFJフィナンシャル・グループ	57	38	39,976
りそなホールディングス	5.7	3.8	2,696
三井住友トラスト・ホールディングス	5.7	3.8	19,695
三井住友フィナンシャルグループ	5.7	3.8	23,107
千葉銀行	57	38	34,466
ふくおかフィナンシャルグループ	11.4	7.6	23,560
静岡銀行	57	—	—
みずほフィナンシャルグループ	5.7	3.8	8,411

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
証券・商品先物取引業(0.2%)			
大和証券グループ本社	57	38	27,170
野村ホールディングス	57	38	20,455
松井証券	57	38	30,248
保険業(0.9%)			
SOMPOホールディングス	11.4	7.6	49,924
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	17.1	11.4	58,550
第一生命ホールディングス	5.7	3.8	10,733
東京海上ホールディングス	28.5	57	185,193
T&Dホールディングス	11.4	7.6	16,473
その他金融業(0.7%)			
クレディセゾン	57	38	84,740
オリックス	57	38	96,482
日本取引所グループ	57	38	88,806
不動産業(1.0%)			
東急不動産ホールディングス	57	38	31,030
三井不動産	57	38	106,742
三菱地所	57	38	65,113
東京建物	28.5	19	35,568
住友不動産	57	38	135,736
サービス業(4.6%)			
エムスリー	136.8	91.2	278,889
ディー・エヌ・エー	17.1	11.4	20,571
電通グループ	57	38	176,434
オリエンタルランド	—	38	211,584
サイバーエージェント	45.6	30.4	31,616
楽天グループ	57	38	20,398
リクルートホールディングス	171	114	510,948
日本郵政	57	38	39,463
セコム	57	38	356,174
合計	株数	金額	
	10,716	8,280	36,110,800
	銘柄数 < 比率 >	225	225 <97.6%>

(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
		百万円	百万円
国内	日経225	870	—
	日経225 mini	19	—

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2023年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	36,110,800	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,090,260	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	37,201,060	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

(2023年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	37,201,060,333円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	982,605,123
株 式(評価額)	36,110,800,740
未 収 入 金	5,670
未 収 配 当 金	40,676,800
差 入 委 託 証 拠 金	66,972,000
(B) 負 債	205,299,224
未 払 金	25,633,224
未 払 解 約 金	179,666,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	36,995,761,109
元 本	13,900,394,180
次 期 繰 越 損 益 金	23,095,366,929
(D) 受 益 権 総 口 数	13,900,394,180口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,615円

(注記事項)

期首元本額	20,764,917,587円
期中追加設定元本額	3,144,753,256円
期中一部解約元本額	10,009,276,663円

(当期末元本の内訳)

りそな・日経225オープン	9,858,857,831円
アムンディ・日経225インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	576,646,784円
アムンディ・日経平均オープン	3,457,918,460円
りそな・日経225オープンVA (適格機関投資家専用)	6,971,105円

■損益の状況

当期 (自2022年7月12日 至2023年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	962,945,889円
受 取 配 当 金	963,505,906
受 取 利 息	10
そ の 他 収 益 金	46,037
支 払 利 息	△ 606,064
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,782,141,622
売 買 益	8,859,377,027
売 買 損	△ 1,077,235,405
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	309,358,913
取 引 益	476,613,752
取 引 損	△ 167,254,839
(D) そ の 他 費 用 等	△ 304,836
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	9,054,141,588
(F) 前期繰越損益金	24,207,637,928
(G) 追加信託差損益金	3,743,621,744
(H) 解約差損益金	△13,910,034,331
(I) 計 (E+F+G+H)	23,095,366,929
次 期 繰 越 損 益 金(I)	23,095,366,929

(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。