

国内株式 ESG インデックス・オープン

運用報告書（全体版）

第2期（決算日 2023年9月15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。
「国内株式 ESG インデックス・オープン」は、2023年9月15日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
当ファンドにおけるESGを主要な要素として選定した投資銘柄の組入比率はマンスリーレポートに記載しています。下記URLをご覧ください。
<https://www.resona-am.co.jp/fund/120023/mokuromi.html>
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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	2021年9月17日から無期限です。	
運用方針	MSC I ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主要投資対象	国内株式 ESG インデックス・オープン	・ RM国内株式 ESG マザーファンドの受益証券
	RM国内株式 ESG マザーファンド	・ 国内の金融商品取引所上場株式のうち、MSC I ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式
主な投資制限	国内株式 ESG インデックス・オープン	・ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
	RM国内株式 ESG 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。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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があります。	

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ： <https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	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				
(設定日) 2021年9月17日	円 10,000	円 —	% —	3,382.07	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2022年9月15日)	9,480	0	△ 5.2	3,218.12	△ 4.8	92.3	5.9	1.5	104
2期(2023年9月15日)	12,005	0	26.6	4,095.14	27.3	96.4	2.1	1.2	98

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)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」は実質比率を記載しております。

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

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

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(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) MSCI Inc. が開発したMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc. に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
(期首) 2022年9月15日	円 9,480	% —	3,218.12	% —	% 92.3	% 5.9	% 1.5
9月末	8,971	△ 5.4	3,043.96	△ 5.4	91.1	7.1	1.5
10月末	9,412	△ 0.7	3,195.53	△ 0.7	89.9	8.4	1.4
11月末	9,694	2.3	3,293.17	2.3	95.3	3.0	1.5
12月末	9,238	△ 2.6	3,139.00	△ 2.5	90.1	8.3	1.4
2023年1月末	9,599	1.3	3,262.13	1.4	89.3	9.3	1.3
2月末	9,669	2.0	3,287.05	2.1	93.1	2.1	1.3
3月末	9,808	3.5	3,335.25	3.6	95.9	2.6	1.3
4月末	10,121	6.8	3,444.38	7.0	95.4	3.0	1.3
5月末	10,523	11.0	3,583.93	11.4	93.7	5.1	1.3
6月末	11,316	19.4	3,855.66	19.8	93.1	5.6	1.2
7月末	11,470	21.0	3,909.60	21.5	90.7	7.9	1.2
8月末	11,503	21.3	3,922.56	21.9	94.6	4.0	1.2
(期末) 2023年9月15日	12,005	26.6	4,095.14	27.3	96.4	2.1	1.2

(注) 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」は実質比率を記載しております。

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

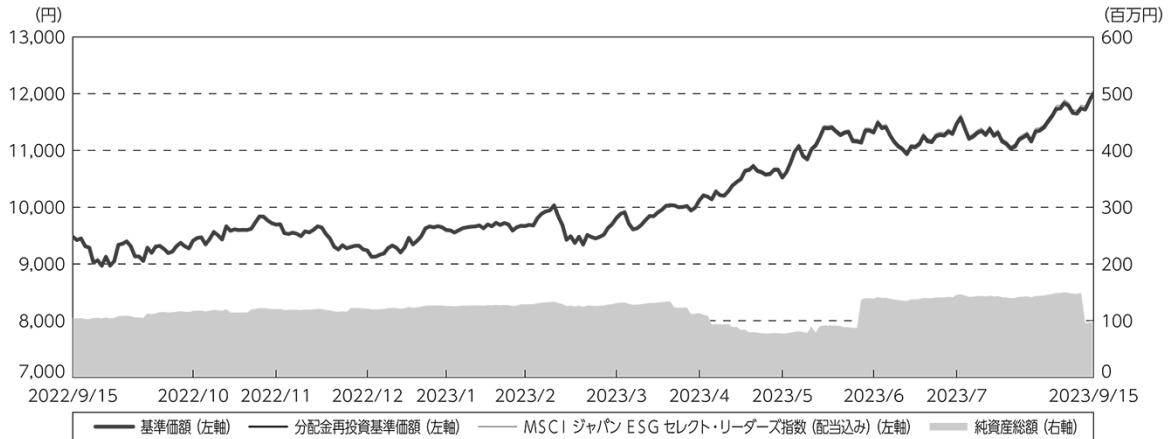
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(2022年9月16日～2023年9月15日)

期中の基準価額等の推移



期 首：9,480円

期 末：12,005円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：26.6% (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) 分配金再投資基準価額およびMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)は、期首(2022年9月15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) MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)は当ファンドのベンチマークです。
- (注) MSCI Inc.が開発したMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。
- (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

ベンチマークであるMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市況

国内の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。前半は、国内経済の正常化進展への期待や円安進行などが支援材料となり緩やかに上昇しました。後半は、米欧を中心とする金融システム不安に対する警戒感から相場の変動率が高まる場面もみられましたが、国内企業の資本効率改善への期待感や他国対比で緩やかな金融環境が続いたことなどが相場の下支えとなり、国内株式市場は上昇基調を維持しました。東証株価指数（TOPIX）や日経平均株価（日経225）は1990年以来の高値まで上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM国内株式ESGマザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

RM国内株式ESGマザーファンド

国内の株式を主要投資対象とし、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

当期末における、ESGを主要な要素として選定した投資銘柄の純資産総額に占める組入比率は97.7%です。なお、保有全銘柄に占める当該投資銘柄の比率は100%です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+26.6%となり、ベンチマークの+27.3%を0.6%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

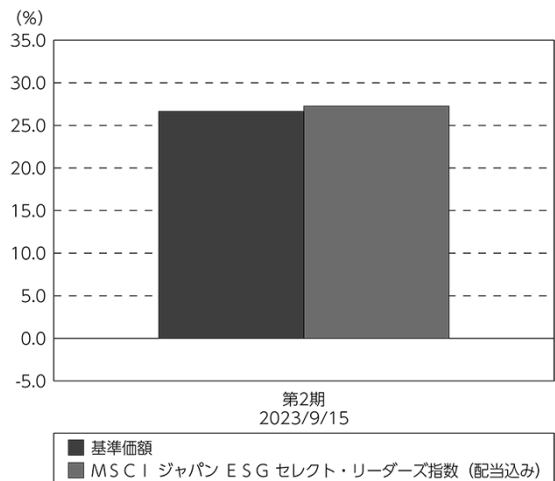
(マイナス要因)

- ・信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・コスト負担（株式等に係る取引費用）が生じたこと

(その他の要因)

- ・株式の取引価格と評価に用いる価格が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（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を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 2 期
	2022年 9 月 16 日～ 2023年 9 月 15 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	2,005

(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

当ファンド

引き続き、RM国内株式 ESG マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RM国内株式 ESG マザーファンド

引き続き、主としてMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する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

(2022年9月16日～2023年9月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(11)	(0.107)	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販 売 会 社)	(39)	(0.385)	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)	(2)	(0.022)	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	0	0.004	(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 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)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.004)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.007	(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)	(1)	(0.006)	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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	53	0.525	
期中の平均基準価額は、10,110円です。			

(注) 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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

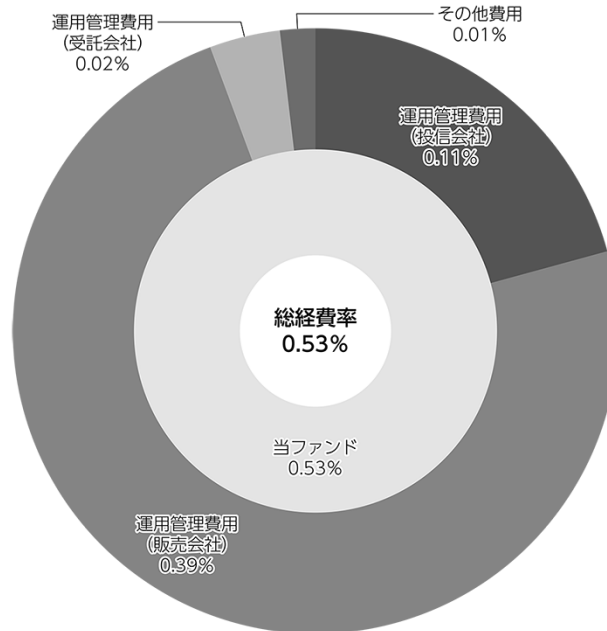
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.53%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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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

(2022年9月16日～2023年9月15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
RM国内株式ESGマザーファンド	千口 70,730	千円 99,993	千口 92,521	千円 133,997

○株式売買比率

(2022年9月16日～2023年9月15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	
	RM国内株式ESGマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	2,782,607千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,734,113千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.01	

(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

(2022年9月16日～2023年9月15日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<RM国内株式ESG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 5	百万円 4	百万円 19

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株式会社りそなホールディングスです。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2022年9月16日～2023年9月15日）

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2022年9月16日～2023年9月15日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2023年9月15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	評 価 額
RM国内株式ESGマザーファンド		千口 82,923	千口 61,132		千円 98,300

○投資信託財産の構成

（2023年9月15日現在）

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
RM国内株式ESGマザーファンド	千円 98,300		% 65.0
コール・ローン等、その他	53,002		35.0
投資信託財産総額	151,302		100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

（2022年9月16日～2023年9月15日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	151,302,762
コール・ローン等	432,532
RM国内株式ESGマザーファンド(評価額)	98,300,630
未収入金	52,569,600
(B) 負債	52,930,018
未払解約金	52,612,709
未払信託報酬	313,301
未払利息	1
その他未払費用	4,007
(C) 純資産総額(A-B)	98,372,744
元本	81,941,401
次期繰越損益金	16,431,343
(D) 受益権総口数	81,941,401口
1万円当たり基準価額(C/D)	12,005円

(注) 当ファンドの期首元本額は110,624,718円、期中追加設定元本額は94,890,255円、期中一部解約元本額は123,573,572円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.2005円です。

○損益の状況 (2022年9月16日～2023年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 64
支払利息	△ 64
(B) 有価証券売買損益	14,577,905
売買益	24,438,919
売買損	△ 9,861,014
(C) 信託報酬等	△ 624,927
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,952,914
(E) 前期繰越損益金	△ 308,128
(F) 追加信託差損益金	2,786,557
(配当等相当額)	(340,499)
(売買損益相当額)	(2,446,058)
(G) 計(D+E+F)	16,431,343
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	16,431,343
追加信託差損益金	2,786,557
(配当等相当額)	(469,798)
(売買損益相当額)	(2,316,759)
分配準備積立金	13,644,786

(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(2,013,930円)、費用控除後の有価証券等損益額(11,508,091円)、信託約款に規定する収益調整金(2,786,557円)および分配準備積立金(122,765円)より分配対象収益は16,431,343円(1万円当たり2,005円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

RM国内株式ESGマザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2022年11月25日）
（2021年11月26日～2022年11月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2019年10月30日から無期限です。
運用方針	①主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式
主な投資制限	・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。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
(設定日) 2019年10月30日	円 10,000	% -	2,545.19	% -	% -	% -	% -	百万円 299
1期(2020年11月25日)	11,062	10.6	2,824.18	11.0	86.8	12.0	1.0	886
2期(2021年11月25日)	13,086	18.3	3,341.63	18.3	94.2	4.3	1.7	2,435
3期(2022年11月25日)	13,112	0.2	3,339.26	△0.1	90.5	8.0	1.4	2,857

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(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) MSCI Inc.が開発したMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2021年11月25日	円 13,086	% -	3,341.63	% -	% 94.2	% 4.3	% 1.7
11月末	12,472	△4.7	3,186.60	△4.6	95.3	3.0	1.7
12月末	12,949	△1.0	3,307.38	△1.0	92.3	6.0	1.6
2022年1月末	12,335	△5.7	3,149.39	△5.8	90.2	8.2	1.5
2月末	12,139	△7.2	3,095.56	△7.4	92.7	5.6	1.5
3月末	12,714	△2.8	3,244.52	△2.9	90.2	8.2	1.5
4月末	12,431	△5.0	3,172.34	△5.1	90.9	7.4	1.6
5月末	12,514	△4.4	3,194.80	△4.4	89.4	9.0	1.5
6月末	12,194	△6.8	3,110.64	△6.9	89.5	8.8	1.5
7月末	12,675	△3.1	3,233.54	△3.2	88.9	9.4	1.5
8月末	12,716	△2.8	3,241.11	△3.0	93.3	5.0	1.5
9月末	11,951	△8.7	3,043.96	△8.9	91.3	7.1	1.5
10月末	12,545	△4.1	3,195.53	△4.4	90.1	8.4	1.4
(期末) 2022年11月25日	円 13,112	% 0.2	3,339.26	% △0.1	% 90.5	% 8.0	% 1.4

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(2021年11月26日～2022年11月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の変動要因

基準価額は前期末13,086円から当期末13,112円となり、26円の値上がりとなりました。

ベンチマークは下落しましたが、投資する株価指数先物取引が上昇したため、基準価額は値上がりしました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内株式市況

国内の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、FRB（米連邦準備制度理事会）をはじめとする主要国中央銀行の金融政策正常化の加速や、ロシアのウクライナ侵攻に対する各国の経済制裁による影響が懸念され、一時売り圧力が強まりました。その後、中国による大規模な都市封鎖措置などから企業業績見通しの先行き不透明感が意識される場面も見られましたが、円安進行が相場の下支えとなり買い戻しが進みました。期末にかけて、金融市場ではFRBの先行きの利上げペース減速観測が強まり、国内の株式市場は上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の株式を主要投資対象とし、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

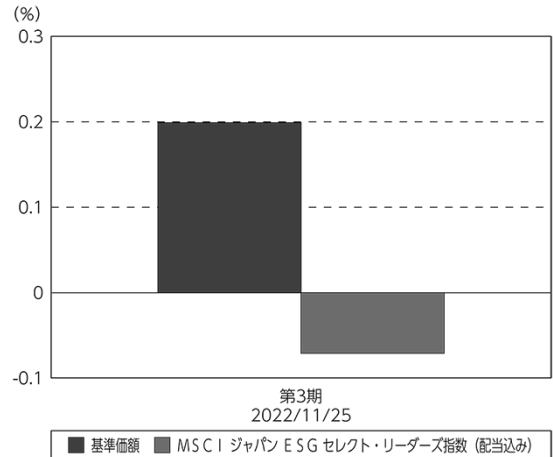
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+0.2%となり、ベンチマークの-0.1%を0.3%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・投資する株価指数先物取引がプラスのリターンとなったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてMSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する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

(2021年11月26日～2022年11月25日)

項 目	当 期		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)	円 1 (0) (1)	% 0.005 (0.000) (0.005)	(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 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、12,469円です。			

(注) 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) 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

(2021年11月26日～2022年11月25日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
内		千株	千円	千株	千円
		688	1,754,072	453	1,460,502
		(12)	(-)		

(注) 金額は受け渡し代金。

(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。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	森ヒルズリート投資法人	14	2,162	—	—
	産業ファンド投資法人	5	896	20	3,700
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2	647	7	2,323
	日本プロロジスリート投資法人	11	3,764	7	2,390
	ヒューリックリート投資法人	7	1,132	5	808
	積水ハウス・リート投資法人	40	3,291	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	11	1,791	45	7,437
	日本ビルファンド投資法人	7	4,807	5	3,240
	ジャパンリアルエステイト投資法人	12	7,673	—	—
	日本都市ファンド投資法人	18	1,824	73	7,630
	オリックス不動産投資法人	6	1,049	27	4,881
	日本プライムリアルティ投資法人	4	1,620	2	751
	ユナイテッド・アーバン投資法人	28	4,098	—	—
	ジャパンエクセレント投資法人	6	765	5	639
合 計	171	35,523	196	33,802	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

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 1,132	百万円 1,502	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2021年11月26日～2022年11月25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	3,214,574千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,027,810千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.58

(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

(2021年11月26日～2022年11月25日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

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 5	百万円 4	百万円 13

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株式会社りそなホールディングスです。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年11月26日～2022年11月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年11月25日現在)

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 (1.0%)			
マルハニチロ	0.3	—	—
鉱業 (0.6%)			
I N P E X	8.1	9.8	15,327
建設業 (1.9%)			
コムシスホールディングス	0.9	—	—
大成建設	1.5	—	—
大林組	5.1	6.1	6,362
清水建設	4.4	5.2	3,884
鹿島建設	3.6	—	—
戸田建設	1.8	—	—
住友林業	1	1.3	3,125
大和ハウス工業	4.5	5.6	18,172
積水ハウス	4.9	5.8	14,993
エクシオグループ	0.8	—	—
三機工業	—	0.4	638
高砂熱学工業	0.4	0.4	738
大気社	—	0.2	722
千代田化工建設	—	1.5	577
食料品 (3.9%)			
明治ホールディングス	—	1	6,850
サッポロホールディングス	0.5	0.6	2,154
アサヒグループホールディングス	3.6	4.3	19,139
麒麟ホールディングス	6.5	7.7	17,036
サントリー食品インターナショナル	1.1	1.3	6,116
伊藤園	—	0.5	2,735
不二製油グループ本社	0.4	0.4	866
キッコーマン	1.2	1.4	11,074
味の素	3.7	4.3	18,533
キューピー	0.8	0.9	2,277
ハウス食品グループ本社	0.5	0.6	1,679
カゴメ	—	0.7	2,177
ニチレイ	0.9	1	2,843
日清食品ホールディングス	0.5	0.6	6,318

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	—	0.1	194
東洋紡	—	0.8	852
帝人	1.4	1.7	2,255
東レ	11	13	9,704
パルプ・紙 (1.0%)			
日本製紙	0.8	—	—
レンゴー	1.4	—	—
化学 (6.5%)			
クラレ	2.4	3	3,294
旭化成	9.9	11.8	12,095
昭和電工	1.4	—	—
住友化学	11.8	14	7,014
東ソー	—	2.4	3,981
デンカ	—	0.7	2,362
信越化学工業	2.8	—	—
カネカ	0.4	0.4	1,408
三井化学	1.5	1.7	5,329
J S R	—	1.7	4,907
東京応化工業	0.2	0.3	2,091
三菱ケミカルグループ	10.1	12	8,833
ダイセル	2	2.4	2,431
積水化学工業	3	3.5	6,814
UBE	0.8	—	—
日本化薬	1.1	—	—
花王	3.8	4.5	25,218
日本ペイントホールディングス	—	7.8	8,619
関西ペイント	1.4	1.7	3,279
D I C	0.6	0.7	1,774
東洋インキ S C ホールディングス	0.3	—	—
富士フイルムホールディングス	2.9	3.4	25,313
資生堂	3.2	—	—
ライオン	—	2.2	3,311
小林製薬	—	0.5	4,445

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デクセリアルズ	—	0.5	1,655
日東電工	1.1	1.3	11,297
信越ポリマー	—	0.4	526
ニフコ	0.6	0.8	2,984
ユニ・チャーム	3.2	3.8	19,805
医薬品 (7.0%)			
協和キリン	2.1	—	—
アステラス製薬	14.7	17.3	37,108
住友ファーマ	1.4	—	—
塩野義製薬	2.1	2.5	17,822
中外製薬	5.3	6.3	22,875
エーザイ	1.9	2.4	22,723
小野薬品工業	2.9	—	—
持田製薬	0.2	—	—
参天製薬	2.9	3.4	3,930
キッセイ薬品工業	0.2	—	—
第一三共	13.9	16.5	75,784
大塚ホールディングス	3.1	—	—
石油・石炭製品 (0.5%)			
ENEOSホールディングス	24.3	28.8	13,541
ゴム製品 (1.1%)			
ブリヂストン	—	5.4	28,252
住友理工	—	0.3	187
ガラス・土石製品 (0.6%)			
太平洋セメント	—	1.1	2,395
TOTO	1.1	1.3	6,168
日本碍子	2	2.2	3,944
日本特殊陶業	1.2	1.4	3,738
ニチアス	0.5	—	—
鉄鋼 (1.0%)			
日本製鉄	—	7.6	17,164
神戸製鋼所	—	3.2	2,019
JFEホールディングス	—	4.6	7,120
大同特殊鋼	0.2	—	—
日立金属	1.7	—	—
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	0.4	0.5	782
三菱マテリアル	0.9	1.1	2,415

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友金属鉱山	2	2.3	10,678
DOWAホールディングス	—	0.5	2,265
UACJ	—	0.3	684
機械 (5.1%)			
三浦工業	0.7	0.8	2,648
タクマ	0.5	—	—
ナブテスコ	0.9	1	3,455
サトーホールディングス	0.2	—	—
小松製作所	6.9	8.7	27,535
日立建機	0.9	1	3,175
クボタ	8.1	9.6	20,294
荏原製作所	0.8	0.9	4,770
ダイキン工業	2	2.3	52,474
栗田工業	0.8	1	6,400
ダイフク	0.8	1	7,110
グローリー	0.4	0.4	948
セガサミーホールディングス	1.4	1.5	2,820
ホシザキ	0.4	—	—
NTN	3.2	—	—
日立造船	1.3	1.5	1,378
三菱重工業	2.5	—	—
電気機器 (20.8%)			
日清紡ホールディングス	1.1	1.2	1,221
イビデン	0.8	1.1	6,226
コニカミノルタ	3.6	4.3	2,446
日立製作所	—	9.1	67,503
三菱電機	14.4	—	—
安川電機	1.9	2.3	10,281
明電舎	—	0.3	619
東芝テック	0.2	—	—
オムロン	1.5	1.7	12,170
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.5	—	—
日本電気	1.9	—	—
富士通	1.6	1.8	33,885
セイコーエプソン	—	2.6	5,488
アルパック	0.4	—	—
パナソニック ホールディングス	17.5	20.8	26,748
アンリツ	1.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソニーグループ	10	11.9	138,040
TDK	3.1	3.7	18,333
アルプスアルパイン	—	1.9	2,578
ヒロセ電機	0.3	—	—
日本航空電子工業	0.4	0.4	984
横河電機	1.8	2.1	5,340
アズビル	1	1.1	4,774
日本光電工業	0.6	—	—
キーエンス	1.5	—	—
シスメックス	1.3	1.6	13,934
スタンレー電気	1	1.2	3,469
ウシオ電機	0.8	—	—
ファナック	—	1.8	36,864
ローム	—	0.8	8,912
京セラ	—	3	21,234
太陽誘電	—	1.1	4,983
村田製作所	4.5	5.4	41,482
リコー	—	5.4	5,826
東京エレクトロン	1.2	1.4	64,428
輸送用機器 (8.5%)			
デンソー	3.4	—	—
川崎重工業	1.1	—	—
トヨタ自動車	83.9	99.7	204,833
日野自動車	2.3	—	—
マツダ	—	5.3	5,814
ヤマハ発動機	2.4	2.8	9,408
精密機器 (3.4%)			
テルモ	—	6.1	24,595
島津製作所	1.9	2.2	9,416
ニコン	2.4	2.8	3,763
HOYA	—	3.4	49,997
シチズン時計	2.1	—	—
その他製品 (3.1%)			
前田工繊	—	0.2	676
大建工業	—	0.1	217
大日本印刷	1.8	2.1	5,940
アシックス	1.2	1.5	4,545
ヤマハ	1.1	1.3	6,916

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リンテック	0.3	0.4	916
任天堂	0.9	10	59,590
コクヨ	0.7	0.8	1,488
美津濃	—	0.2	598
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	5.1	—	—
中国電力	2.3	—	—
東北電力	—	4.3	2,945
四国電力	—	1.5	1,152
九州電力	3.2	3.8	2,884
電源開発	—	1.4	2,987
イーレックス	—	0.3	758
レノバ	0.3	0.3	855
東京瓦斯	3	3.7	9,631
大阪瓦斯	3	3.5	7,549
東邦瓦斯	0.6	0.7	1,955
陸運業 (2.9%)			
東武鉄道	1.5	—	—
相鉄ホールディングス	0.6	0.7	1,526
東急	4	5	8,545
小田急電鉄	2.3	2.8	5,000
京王電鉄	0.8	1	5,030
東日本旅客鉄道	2.4	—	—
西日本旅客鉄道	1.7	2.1	11,984
西武ホールディングス	1.8	2.1	2,793
西日本鉄道	0.5	0.6	1,684
近鉄グループホールディングス	1.4	—	—
阪急阪神ホールディングス	1.8	2.2	9,339
南海電気鉄道	0.8	1	3,010
京阪ホールディングス	—	0.9	3,136
名古屋鉄道	1.5	—	—
日本通運	0.6	—	—
山九	0.4	0.5	2,485
センコーグループホールディングス	0.8	1	1,024
福山通運	0.2	0.2	719
日立物流	0.3	0.4	3,560
九州旅客鉄道	1.1	1.3	3,913
SGホールディングス	2.5	2.7	5,769

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	—	0.7	5,677
海運業 (0.5%)			
日本郵船	1.3	4.5	13,263
倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
トランコム	—	0.1	795
三井倉庫ホールディングス	—	0.2	739
情報・通信業 (6.0%)			
T I S	—	2.1	8,284
オーブンドア	—	0.1	190
野村総合研究所	2.7	3.2	10,624
メルカリ	0.8	1	2,925
Zホールディングス	21.2	25	9,370
伊藤忠テクノソリューションズ	—	0.9	3,064
ネットワンシステムズ	0.7	—	—
B I P R O G Y	0.6	0.7	2,254
ビジョン	—	0.4	560
日本電信電話	10.2	—	—
KDD I	12.8	15.2	62,411
ソフトバンク	22.7	27	40,378
エス・ティ・ティ・データ	—	5.9	12,561
カブコン	1.4	—	—
S C S K	1.2	1.5	3,256
卸売業 (5.0%)			
あらた	—	0.1	417
アルフレッサ ホールディングス	1.5	—	—
TOKAIホールディングス	0.8	—	—
シップヘルスケアホールディングス	0.6	—	—
メディカルホールディングス	1.5	—	—
アズワン	0.1	0.3	1,971
日本ライフライン	0.5	—	—
伊藤忠商事	9.4	11.2	48,832
丸紅	—	14.5	22,946
三井物産	—	13.1	53,094
キヤノンマーケティングジャパン	0.4	0.4	1,278
サンゲツ	0.4	0.4	844
モスフードサービス	—	0.2	640
イエローハット	—	0.3	532
スズケン	0.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小売業 (3.4%)			
ローソン	0.4	0.4	2,016
ゲオホールディングス	—	0.2	363
ハローズ	—	0.1	306
DCMホールディングス	1	—	—
マツキヨココカラ&カンパニー	—	1	5,830
Z O Z O	—	1.2	3,894
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	—	0.5	574
ノジマ	—	0.6	828
イオン北海道	—	0.2	245
スギホールディングス	—	0.3	1,926
マックスバリュ東海	—	0.1	285
丸井グループ	1.5	1.7	3,989
イオン	5.2	6.1	17,406
平和堂	—	0.2	414
ヤオコー	—	0.2	1,382
ケーズホールディングス	1.3	1.5	1,740
Genky DrugStores	—	0.1	369
アインホールディングス	0.2	—	—
ヤマダホールディングス	5.4	7.1	3,400
ファーストリテイリング	0.5	0.5	39,945
サンドラッグ	—	0.7	2,639
銀行業 (4.5%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	4.2	4,162
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	112.3	85,202
りそなホールディングス	16.9	20.3	13,627
三井住友トラスト・ホールディングス	2.7	3.2	14,428
三井住友フィナンシャルグループ	10.3	—	—
千葉銀行	4.2	—	—
静岡銀行	3.5	—	—
山口フィナンシャルグループ	1.6	—	—
証券・商品先物取引業 (0.9%)			
大和証券グループ本社	—	12.5	7,787
野村ホールディングス	24.3	27.3	13,718
マネックスグループ	—	1.6	728
保険業 (2.2%)			
S O M P Oホールディングス	2.5	2.9	17,255
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.5	4.2	17,430

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一生命ホールディングス	8.1	9.2	22,931
東京海上ホールディングス	5	—	—
T&Dホールディングス	4.3	—	—
その他金融業 (1.0%)			
芙蓉総合リース	0.1	—	—
東京センチュリー	0.3	0.3	1,485
イオンフィナンシャルサービス	0.9	—	—
オリエン特コーポレーション	4.1	—	—
オリックス	9.7	11.2	25,200
日本取引所グループ	4	—	—
不動産業 (2.7%)			
ヒューリック	3	3.6	4,219
野村不動産ホールディングス	0.9	1.1	3,586
東急不動産ホールディングス	4.8	—	—
三井不動産	7.3	8.5	23,634
三菱地所	9.4	11.1	21,722
平和不動産	—	0.3	1,243
東京建物	—	1.8	3,517
住友不動産	—	2.9	10,950

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サービス業 (4.4%)				
総合警備保障	0.6	0.7	2,677	
ディップ	—	0.3	1,206	
エスプール	—	0.6	567	
H. U. グループホールディングス	0.4	0.5	1,422	
オリエンタルランド	1.6	1.9	38,000	
ダスキン	0.3	0.4	1,214	
テクノプロ・ホールディングス	0.9	1	3,895	
リクルートホールディングス	10.7	13.5	59,724	
エラン	—	0.3	309	
インソース	—	0.2	647	
カープスホールディングス	—	0.5	483	
L I T A L I C O	—	0.2	486	
乃村工藝社	0.6	0.7	739	
セコム	1.7	—	—	
メイテック	0.2	—	—	
ベネッセホールディングス	0.5	0.7	1,402	
合 計	株 数・金 額	732	980	2,587,549
	銘柄数<比率>	218	228	<90.5%>

(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。

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
森ヒルズリート投資法人	—	14	2,283	0.1
産業ファンド投資法人	15	—	—	—
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5	—	—	—
日本プロロジスリート投資法人	16	20	6,820	0.2
ヒューリックリート投資法人	10	12	2,041	0.1
積水ハウス・リート投資法人	—	40	3,200	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人	34	—	—	—
日本ビルファンド投資法人	12	14	8,876	0.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	—	12	7,260	0.3
日本都市ファンド投資法人	55	—	—	—
オリックス不動産投資法人	21	—	—	—
日本プライムリアルティ投資法人	6	8	3,080	0.1
ユナイテッド・アーバン投資法人	—	28	4,345	0.2
ジャパンエクセレント投資法人	10	11	1,490	0.1
合 計	口 数 ・ 金 額	184	39,396	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	< 1.4% >	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

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	TOPIX	百万円 161	百万円 —
		ミニTOPIX	66	—

○投資信託財産の構成

(2022年11月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	2,587,549	89.7
投資証券	39,396	1.4
コール・ローン等、その他	258,385	8.9
投資信託財産総額	2,885,330	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2021年11月26日～2022年11月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,885,330,591
コール・ローン等	224,131,385
株式(評価額)	2,587,549,310
投資証券(評価額)	39,396,700
未収入金	13,370,400
未収配当金	24,283,046
差入委託証拠金	△ 3,400,250
(B) 負債	27,390,607
未払解約金	27,390,000
未払利息	607
(C) 純資産総額(A-B)	2,857,939,984
元本	2,179,688,266
次期繰越損益金	678,251,718
(D) 受益権総口数	2,179,688,266口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,112円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,860,914,186円、期中追加設定元本額は1,348,672,319円、期中一部解約元本額は1,029,898,239円です。

(注) 2022年11月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	998,454,474円
・Smart-i 国内株式ESGインデックス	605,010,070円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	311,152,374円
・九州SDGs・グローバルバランス	156,441,847円
・国内株式ESGインデックス・オープン	93,054,038円
・ラップ型ファンド・プラスESG(成長型)	8,251,921円
・ラップ型ファンド・プラスESG(安定成長型)	6,840,351円
・ラップ型ファンド・プラスESG(安定型)	483,191円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3112円です。

○損益の状況 (2021年11月26日～2022年11月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	50,032,479
受取配当金	50,199,082
その他収益金	305
支払利息	△ 166,908
(B) 有価証券売買損益	△ 2,954,881
売買益	204,447,340
売買損	△207,402,221
(C) 先物取引等取引損益	12,393,100
取引益	32,855,370
取引損	△ 20,462,270
(D) 保管費用等	△ 8,217
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	59,462,481
(F) 前期繰越損益金	574,327,017
(G) 追加信託差損益金	315,665,581
(H) 解約差損益金	△271,203,361
(I) 計(E+F+G+H)	678,251,718
次期繰越損益金(I)	678,251,718

(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(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) 損益の状況の中で(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。

○お知らせ

該当事項はございません。