

りそな日経225インデックス

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2022年5月25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。
「りそな日経225インデックス」は、2022年5月25日に第1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。
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8月3日から無期限です。
運用方針	日経平均株価（日経225）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	RM日経225マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③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			日経平均株価 (日経225)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配	み 期騰落 中率	(ベンチマーク)	騰落 中率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2021年8月3日	10,000	—	—	27,781.02	—	—	—	1
1期(2022年5月25日)	9,728	0	△2.7	26,677.80	△4.0	90.2	9.7	10,308

(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) 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) 日経平均株価（日経225）は、日本経済新聞社が開発した、東証プライム市場上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として算出した指数で、対象銘柄の株価により算出を行う平均株価型の指数です。なお、日経平均株価（日経平均）に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。本商品について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

○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 (日経225)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(設定日)	円	%		%	%	%
2021年8月3日	10,000	—	27,781.02	—	—	—
8月末	10,130	1.3	28,089.54	1.1	64.4	35.5
9月末	10,659	6.6	29,452.66	6.0	80.7	19.2
10月末	10,453	4.5	28,892.69	4.0	89.2	10.7
11月末	10,050	0.5	27,821.76	0.1	82.6	17.2
12月末	10,439	4.4	28,791.71	3.6	90.4	9.4
2022年1月末	9,769	△2.3	27,001.98	△2.8	93.4	6.6
2月末	9,598	△4.0	26,526.82	△4.5	92.8	7.1
3月末	10,146	1.5	27,821.43	0.1	95.9	4.0
4月末	9,788	△2.1	26,847.90	△3.4	89.4	10.4
(期末)						
2022年5月25日	9,728	△2.7	26,677.80	△4.0	90.2	9.7

(注) 騰落率は設定日比です。

(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。

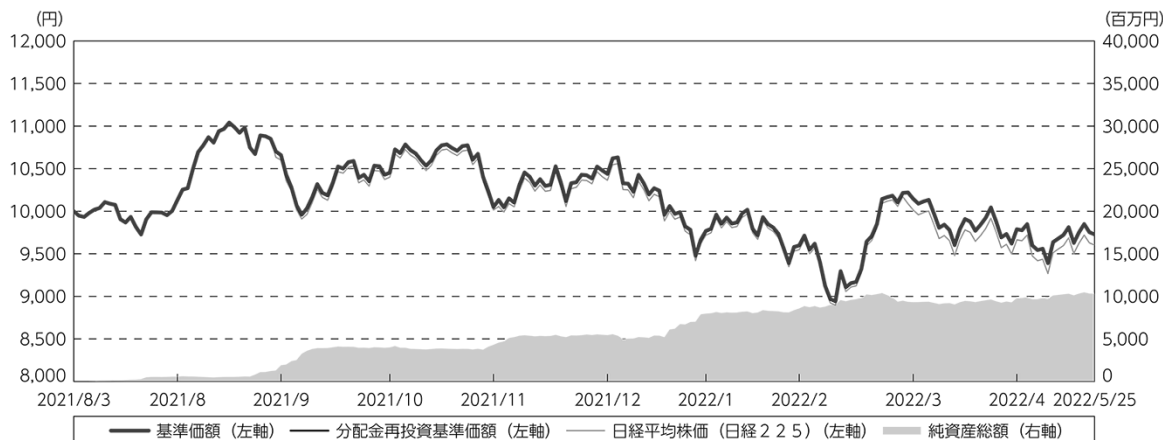
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 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8月3日～2022年5月25日)

期中の基準価額等の推移



設定時：10,000円

期 末：9,728円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 2.7% (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) 日経平均株価(日経225)は、設定時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) 日経平均株価(日経225)は当ファンドのベンチマークです。
- (注) 日経平均株価(日経225)は、日本経済新聞社が開発した、東証プライム市場上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として算出した指数で、対象銘柄の株価により算出を行う平均株価型の指数です。なお、日経平均株価(日経平均)に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。本商品について、日本経済新聞社は一切の責任を負う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。

○基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は設定時10,000円から当期末9,728円となり、272円の値下がりがりました。

国内株式の市況(日経平均株価(日経225))の下落により、基準価額は下落しました。

投資環境

国内株式市況

国内の株式市場は、設定時と比較して下落しました。期前半は、菅首相（当時）の次期自民党総裁選挙への不出馬表明等をきっかけに日経平均株価は一時3万円を超える場面が見られました。期後半には、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に伴い、上昇幅を縮小しました。期末にかけて、ウクライナ情勢の悪化に伴い、日経平均株価は一時2万5,000円を下回る場面も見られましたが、円安進行などを支えに反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM日経225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日経225マザーファンド

国内の株式を主要投資対象とし、日経平均株価（日経225）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。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

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-2.7%となり、ベンチマークの-4.0%を1.3%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

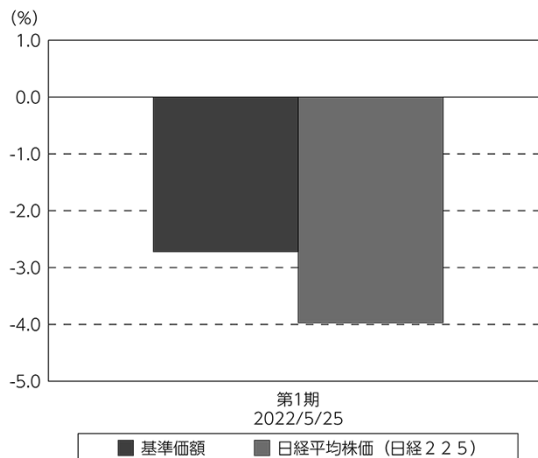
(プラス要因)

- ・保有株式の配当金の計上（ベンチマークである日経平均株価（日経225）に配当金は含まれない）が生じたこと

(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

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 1 期
	2021年8月3日～ 2022年5月25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	99

(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日経225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日経225マザーファンド

引き続き、主として日経平均株価（日経225）に採用されている国内の株式に投資し、日経平均株価（日経225）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8月3日～2022年5月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	40	0.397	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(7)	(0.067)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(32)	(0.312)	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)	(0.018)	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	1	0.008	(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 ）	(1)	(0.008)	
(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)	(0.007)	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	42	0.412	
期中の平均基準価額は、10,114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。

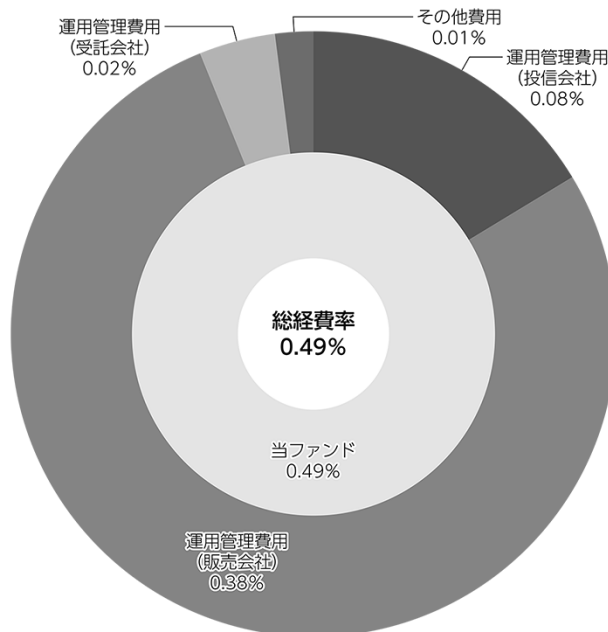
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.49%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

(2021年8月3日～2022年5月25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日経225マザーファンド	8,784,175 千口	13,542,184 千円	1,963,738 千口	3,133,598 千円

○株式売買比率

(2021年8月3日～2022年5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
	RM日経225マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,575,325千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,269,926千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.52

(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8月3日～2022年5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

<RM日経225マザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	0.706894 百万円	0.05465 百万円	0.80869 百万円

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8月3日～2022年5月25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

(2021年8月3日～2022年5月25日)

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	百万円 -	百万円 1	百万円 -	当初設定時における取得およびその処分

○組入資産の明細

(2022年5月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
RM日経225マザーファンド		千口 6,820,437	千円 10,300,224

○投資信託財産の構成

(2022年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM日経225マザーファンド	千円 10,300,224	% 99.3
コール・ローン等、その他	71,065	0.7
投資信託財産総額	10,371,289	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8月3日～2022年5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5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,371,289,468
コール・ローン等	33,382,620
RM日経225マザーファンド(評価額)	10,300,224,848
未収入金	37,682,000
(B) 負債	62,915,452
未払解約金	48,742,441
未払信託報酬	13,928,616
未払利息	90
その他未払費用	244,305
(C) 純資産総額(A-B)	10,308,374,016
元本	10,596,696,415
次期繰越損益金	△ 288,322,399
(D) 受益権総口数	10,596,696,415口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,728円

(注) 当ファンドの設定時元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は14,910,242,140円、期中一部解約元本額は4,314,545,725円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.9728円です。

(注) 2022年5月25日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は288,322,399円です。

○損益の状況 (2021年8月3日～2022年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 16,333
支払利息	△ 16,333
(B) 有価証券売買損益	△162,542,291
売買益	89,902,123
売買損	△252,444,414
(C) 信託報酬等	△ 22,550,009
(D) 当期損益金(A+B+C)	△185,108,633
(E) 追加信託差損益金	△103,213,766
(配当等相当額)	(△ 58,761)
(売買損益相当額)	(△103,155,005)
(F) 計(D+E)	△288,322,399
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△288,322,399
追加信託差損益金	△103,213,766
(配当等相当額)	(25,958,386)
(売買損益相当額)	(△129,172,152)
分配準備積立金	79,986,652
繰越損益金	△265,095,285

(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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(79,986,652円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、および信託約款に規定する収益調整金(25,958,386円)より分配対象収益は105,945,038円(1万口当たり99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

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

RM日経225マザーファンド

運用報告書

第5期（決算日 2022年5月25日）
（2021年5月26日～2022年5月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2017年8月29日から無期限です。
運用方針	①主として、日経平均株価（日経225）に採用されている株式に投資し、日経平均株価（日経225）の動きに連動する投資成果を目指します。なお、日経平均株価（日経225）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（指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・日経平均株価（日経225）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		日経平均株価 (日経225)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	中率	(ベンチマーク)	騰落中率			
(設定日) 2017年8月29日	円 10,000	% —	19,449.90	% —	% —	% —	百万円 599
1期(2018年5月25日)	11,782	17.8	22,450.79	15.4	72.3	27.4	836
2期(2019年5月27日)	11,351	△3.7	21,182.58	△5.6	68.0	31.9	1,287
3期(2020年5月25日)	11,371	0.2	20,741.65	△2.1	70.9	29.1	1,624
4期(2021年5月25日)	15,893	39.8	28,553.98	37.7	72.3	27.7	2,757
5期(2022年5月25日)	15,102	△5.0	26,677.80	△6.6	90.2	9.7	14,299

(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) 日経平均株価(日経225)は、日本経済新聞社が開発した、東証プライム市場上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として算出した指数で、対象銘柄の株価により算出を行う平均株価型の指数です。なお、日経平均株価(日経平均)に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延又は中断に関して責任を負いません。本商品について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

○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 (日経225)		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2021年5月25日	円 15,893	% —	28,553.98	% —	% 72.3	% 27.7
5月末	16,072	1.1	28,860.08	1.1	72.5	27.5
6月末	16,032	0.9	28,791.53	0.8	82.9	17.0
7月末	15,200	△4.4	27,283.59	△4.4	79.3	20.7
8月末	15,669	△1.4	28,089.54	△1.6	64.5	35.5
9月末	16,495	3.8	29,452.66	3.1	80.8	19.3
10月末	16,183	1.8	28,892.69	1.2	89.3	10.7
11月末	15,565	△2.1	27,821.76	△2.6	82.7	17.2
12月末	16,175	1.8	28,791.71	0.8	90.5	9.4
2022年1月末	15,143	△4.7	27,001.98	△5.4	93.4	6.6
2月末	14,883	△6.4	26,526.82	△7.1	92.9	7.1
3月末	15,740	△1.0	27,821.43	△2.6	96.0	4.0
4月末	15,190	△4.4	26,847.90	△6.0	89.5	10.4
(期末) 2022年5月25日	15,102	△5.0	26,677.80	△6.6	90.2	9.7

(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5月26日～2022年5月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末15,893円から当期末15,102円となり、791円の値下がりとなりました。

国内株式の市況（日経平均株価（日経225））の下落により、基準価額は下落しました。



投資環境

国内株式市況

国内の株式市場は、前期末と比較して下落しました。期前半は、菅首相（当時）の次期自民党総裁選挙への不出馬表明等をきっかけに日経平均株価は一時3万円を超える場面が見られました。期後半には、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に伴い、上昇幅を縮小しました。期末にかけて、ウクライナ情勢の悪化に伴い、日経平均株価は一時2万5,000円を下回る場面も見られましたが、円安進行などを支えに反発しました。

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、日経平均株価（日経225）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。先物を含めた実質株式組入率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

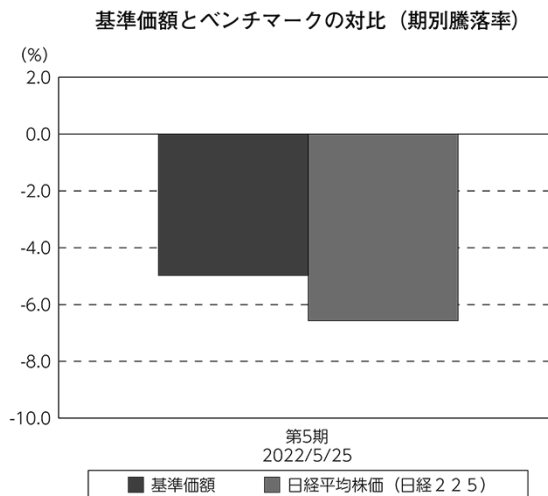
当期の基準価額の騰落率は-5.0%となり、ベンチマークの-6.6%を1.6%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(プラス要因)

- ・保有株式の配当金の計上（ベンチマークである日経平均株価（日経225）に配当金は含まれない）が生じたこと

(マイナス要因)

- ・コスト負担（株式等に係る取引費用）が生じたこと



○今後の運用方針

引き続き、主として日経平均株価（日経225）に採用されている国内の株式に投資し、日経平均株価（日経225）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5月26日～2022年5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 2 (0) (2)	% 0.010 (0.000) (0.010)	(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	2	0.010	
期中の平均基準価額は、15,695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5月26日～2022年5月25日)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		2,907	12,153,677	196	811,331
		(26)	(-)		

(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。

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	18,137	31,506	-	-

○株式売買比率

(2021年5月26日～2022年5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	12,965,008千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,759,537千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.91

(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5月26日～2022年5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
	百万円	百万円	百万円
株式	0.706894	0.05465	0.80869

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5月26日～2022年5月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年5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 (0.1%)			
日本水産	2.5	17	8,857
マルハニチロ	0.3	1.7	3,768
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	1	6.8	10,329
建設業 (1.7%)			
コムシスホールディングス	2.5	17	41,514
大成建設	0.5	3.4	13,141
大林組	2.5	17	15,402
清水建設	2.5	17	11,611
長谷工コーポレーション	0.5	3.4	5,198
鹿島建設	1.3	8.5	11,679
大和ハウス工業	2.5	17	54,706
積水ハウス	2.5	17	38,156
日揮ホールディングス	2.5	17	29,121
食料品 (3.4%)			
日清製粉グループ本社	2.5	17	25,789
明治ホールディングス	0.5	3.4	22,100
日本ハム	1.3	8.5	33,277
サッポロホールディングス	0.5	3.4	9,132
アサヒグループホールディングス	2.5	17	71,111
キリンホールディングス	2.5	17	33,371
宝ホールディングス	2.5	17	15,759
キッコーマン	2.5	17	113,730
味の素	2.5	17	54,621
ニチレイ	1.3	8.5	19,465
日本たばこ産業	2.5	17	39,559
繊維製品 (0.1%)			
東洋紡	0.3	1.7	1,711
ユニチカ	0.3	1.7	372
帝人	0.5	3.4	4,532
東レ	2.5	17	11,218
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	2.5	17	9,503

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本製紙	0.3	1.7	1,594
化学 (7.5%)			
クラレ	2.5	17	18,343
旭化成	2.5	17	17,527
昭和電工	0.3	1.7	3,903
住友化学	2.5	17	8,823
日産化学	2.5	17	123,250
東ソー	1.3	8.5	15,759
トクヤマ	0.5	3.4	5,593
デンカ	0.5	3.4	10,965
信越化学工業	2.5	17	301,325
三井化学	0.5	3.4	10,285
三菱ケミカルホールディングス	1.3	8.5	6,504
UBE	0.3	1.7	3,350
花王	2.5	17	85,680
D I C	0.3	1.7	4,158
富士フイルムホールディングス	2.5	17	115,991
資生堂	2.5	17	87,278
日東電工	2.5	17	154,360
医薬品 (7.3%)			
協和キリン	2.5	17	46,325
武田薬品工業	2.5	17	64,379
アステラス製薬	12.5	85	170,170
住友ファーマ	2.5	17	17,867
塩野義製薬	2.5	17	115,396
中外製薬	7.5	51	178,857
エーザイ	2.5	17	90,508
第一三共	7.5	51	177,225
大塚ホールディングス	2.5	17	75,259
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	1	6.8	23,460
E N E O Sホールディングス	2.5	17	8,787
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	1.3	8.5	13,727

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	2.5	17	84,728
ガラス・土石製品 (0.9%)			
AGC	0.5	3.4	16,082
日本板硝子	0.3	1.7	652
日本電気硝子	0.8	5.1	13,576
住友大阪セメント	0.3	1.7	5,508
太平洋セメント	0.3	1.7	3,179
東海カーボン	2.5	17	17,000
TOTO	1.3	8.5	35,615
日本碍子	2.5	17	30,940
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	0.3	1.7	3,570
神戸製鋼所	0.3	1.7	1,135
ジェイ エフ イー ホールディングス	0.3	1.7	2,602
大太平洋金属	0.3	1.7	4,975
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	0.3	1.7	2,667
三井金属鉱業	0.3	1.7	5,890
東邦亜鉛	0.3	1.7	4,134
三菱マテリアル	0.3	1.7	3,366
住友金属鉱山	1.3	8.5	46,155
DOWAホールディングス	0.5	3.4	16,150
古河電気工業	0.3	1.7	3,585
住友電気工業	2.5	17	24,055
フジクラ	2.5	17	12,937
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	0.3	1.7	3,394
東洋製織グループホールディングス	2.5	—	—
機械 (4.6%)			
日本製鋼所	0.5	3.4	10,829
オークマ	0.5	3.4	17,748
アマダ	2.5	17	17,629
小松製作所	2.5	17	53,839
住友重機械工業	0.5	3.4	10,087
日立建機	2.5	17	49,640
クボタ	2.5	17	38,666
荏原製作所	0.5	3.4	18,054
ダイキン工業	2.5	17	330,565

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	2.5	17	12,495
NTN	2.5	17	4,454
ジェイテクト	2.5	17	16,558
三井E&Sホールディングス	—	1.7	596
日立造船	0.5	3.4	2,628
三菱重工業	0.3	1.7	8,352
I H I	0.3	1.7	6,069
電気機器 (25.3%)			
日清紡ホールディングス	2.5	—	—
コニカミノルタ	2.5	17	7,157
ミネベアミツミ	2.5	17	38,505
日立製作所	0.5	3.4	22,525
三菱電機	2.5	17	24,182
富士電機	0.5	3.4	19,890
安川電機	2.5	17	72,165
オムロン	2.5	17	121,771
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.5	3.4	7,027
日本電気	0.3	1.7	8,738
富士通	0.3	1.7	32,801
沖電気工業	0.3	1.7	1,220
セイコーエプソン	5	34	72,318
パナソニック ホールディングス	2.5	17	19,439
シャープ	2.5	17	17,850
ソニーグループ	2.5	17	190,485
TDK	2.5	51	218,535
アルプスアルパイン	2.5	17	23,477
横河電機	2.5	17	38,199
アドバンテスト	5	34	290,020
キーエンス	—	1.7	83,912
カシオ計算機	2.5	17	19,482
ファナック	2.5	17	354,025
京セラ	5	34	244,800
太陽誘電	2.5	17	86,700
村田製作所	—	13.6	109,548
S C R E E Nホールディングス	0.5	3.4	38,896
キャノン	3.8	25.5	81,268
リコー	2.5	17	17,289
東京エレクトロン	2.5	17	997,560

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (4.5%)			
デンソー	2.5	17	126,038
三井E&Sホールディングス	0.3	—	—
川崎重工業	0.3	1.7	4,204
日産自動車	2.5	17	8,306
いすゞ自動車	1.3	8.5	12,869
トヨタ自動車	2.5	85	173,697
日野自動車	2.5	17	11,441
三菱自動車工業	0.3	1.7	647
マツダ	0.5	3.4	3,763
本田技研工業	5	34	105,604
スズキ	2.5	17	62,985
SUBARU	2.5	17	35,334
ヤマハ発動機	2.5	17	42,160
精密機器 (3.9%)			
テルモ	10	68	282,540
ニコン	2.5	17	25,126
オリンパス	10	68	182,852
シチズン時計	2.5	17	9,384
その他製品 (3.0%)			
バンダイナムコホールディングス	2.5	17	161,585
凸版印刷	1.3	8.5	20,000
大日本印刷	1.3	8.5	24,794
ヤマハ	2.5	17	86,870
任天堂	—	1.7	97,240
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	0.3	1.7	863
中部電力	0.3	1.7	2,247
関西電力	0.3	1.7	2,215
東京瓦斯	0.5	3.4	8,897
大阪瓦斯	0.5	3.4	8,408
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	0.5	3.4	9,778
東急	1.3	8.5	12,563
小田急電鉄	1.3	8.5	14,161
京王電鉄	0.5	3.4	13,821
京成電鉄	1.3	8.5	28,730
東日本旅客鉄道	0.3	1.7	11,162

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	0.3	1.7	8,061
東海旅客鉄道	0.3	1.7	28,016
日本通運	0.3	—	—
ヤマトホールディングス	2.5	17	38,250
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	1.7	12,648
海運業 (0.4%)			
日本郵船	0.3	1.7	18,088
商船三井	0.3	5.1	18,360
川崎汽船	0.3	1.7	16,711
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	0.3	1.7	4,253
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	1.3	8.5	25,925
情報・通信業 (12.4%)			
ネクソン	5	34	107,440
Zホールディングス	1	6.8	2,822
トレンドマイクロ	2.5	17	126,650
スカパーJ SATホールディングス	0.3	—	—
日本電信電話	1	6.8	26,948
KDDI	15	102	463,896
ソフトバンク	2.5	17	25,466
東宝	0.3	1.7	8,330
エヌ・ティ・ティ・データ	12.5	85	169,320
コナミホールディングス	2.5	17	149,260
ソフトバンクグループ	15	102	520,404
卸売業 (2.6%)			
双日	0.3	1.7	3,464
伊藤忠商事	2.5	17	63,308
丸紅	2.5	17	23,290
豊田通商	2.5	17	78,115
三井物産	2.5	17	53,958
住友商事	2.5	17	31,586
三菱商事	2.5	17	76,364
小売業 (9.4%)			
J. フロント リテイリング	1.3	8.5	8,398
三越伊勢丹ホールディングス	2.5	17	17,561
セブン&アイ・ホールディングス	2.5	17	88,791
高島屋	1.3	8.5	10,591

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸井グループ	2.5	17	40,494
イオン	2.5	17	39,559
ファーストリテイリング	2.5	17	1,012,860
銀行業 (0.6%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2.5	17	7,361
新生銀行	0.3	—	—
あおぞら銀行	0.3	1.7	4,491
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.5	17	12,467
りそなホールディングス	0.3	1.7	808
三井住友トラスト・ホールディングス	0.3	1.7	6,565
三井住友フィナンシャルグループ	0.3	1.7	6,675
千葉銀行	2.5	17	11,356
ふくおかフィナンシャルグループ	0.5	3.4	7,582
静岡銀行	2.5	17	12,886
みずほフィナンシャルグループ	0.3	1.7	2,588
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	2.5	17	10,490
野村ホールディングス	2.5	17	8,331
松井証券	2.5	17	13,753
保険業 (0.8%)			
SOMPOホールディングス	0.6	3.4	18,513
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.8	5.1	20,048
第一生命ホールディングス	0.3	1.7	4,367
東京海上ホールディングス	1.3	8.5	59,976
T&Dホールディングス	0.5	3.4	4,896

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 (0.8%)				
クレディセゾン	2.5	17	25,466	
オリックス	—	17	40,341	
日本取引所グループ	2.5	17	33,388	
不動産業 (1.3%)				
東急不動産ホールディングス	2.5	17	11,475	
三井不動産	2.5	17	47,268	
三菱地所	2.5	17	33,243	
東京建物	1.3	8.5	15,181	
住友不動産	2.5	17	57,766	
サービス業 (5.1%)				
エムスリー	6	40.8	154,876	
ディー・エヌ・エー	0.8	5.1	10,128	
電通グループ	2.5	17	70,975	
サイバーエージェント	2	13.6	18,604	
楽天グループ	2.5	17	12,053	
リクルートホールディングス	7.5	51	227,307	
日本郵政	2.5	17	16,036	
セコム	2.5	17	142,953	
計	株数・金額	458	3,196	12,904,987
	銘柄数<比率>	225	225	<90.2%>

(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	百万円	
		日経225	1,334	—
		日経225mini	50	—

○投資信託財産の構成

(2022年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	12,904,987	89.8
コール・ローン等、その他	1,472,625	10.2
投資信託財産総額	14,377,612	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5月26日～2022年5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5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,376,064,362
コール・ローン等	1,289,175,748
株式(評価額)	12,904,987,640
未収入金	16,428,410
未収配当金	116,536,564
差入委託証拠金	48,936,000
(B) 負債	76,110,524
未払解約金	76,092,000
未払利息	3,496
その他未払費用	15,028
(C) 純資産総額(A-B)	14,299,953,838
元本	9,468,681,091
次期繰越損益金	4,831,272,747
(D) 受益権総口数	9,468,681,091口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,102円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,735,326,703円、期中追加設定元本額は10,053,161,951円、期中一部解約元本額は2,319,807,563円です。

(注) 2022年5月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。
・りそな日経225インデックス 6,820,437,590円
・Smart-i 日経225インデックス 2,648,243,501円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.5102円です。

○損益の状況 (2021年5月26日～2022年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	159,555,280
受取配当金	160,433,894
その他収益金	1,268
支払利息	△ 879,882
(B) 有価証券売買損益	△ 430,213,595
売買益	697,935,439
売買損	△1,128,149,034
(C) 先物取引等取引損益	△ 13,576,810
取引益	321,419,750
取引損	△ 334,996,560
(D) 保管費用等	△ 38,491
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 284,273,616
(F) 前期繰越損益金	1,022,654,751
(G) 追加信託差損益金	5,468,652,049
(H) 解約差損益金	△1,375,760,437
(I) 計(E+F+G+H)	4,831,272,747
次期繰越損益金(I)	4,831,272,747

(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。