

りそな日経225インデックス

運用報告書（全体版）

第2期（決算日 2023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、2023年5月25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。
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	りそな日経225インデックス	・RM日経225マザーファンドの受益証券
	RM日経225マザーファンド	・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	りそな日経225インデックス	・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日経225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			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 金騰 落	中 率	(ベンチマーク) 騰 落			
(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
2期(2023年5月25日)	11,374	0	16.9	30,801.13	15.5	91.3	8.5	4,697

(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	(ベンチマーク) 騰 落	率		
(期首)	円	%		%	%	%
2022年5月25日	9,728	—	26,677.80	—	90.2	9.7
5月末	9,946	2.2	27,279.80	2.3	91.1	8.8
6月末	9,630	△ 1.0	26,393.04	△ 1.1	89.2	10.6
7月末	10,137	4.2	27,801.64	4.2	94.8	5.0
8月末	10,234	5.2	28,091.53	5.3	89.5	10.3
9月末	9,515	△ 2.2	25,937.21	△ 2.8	91.1	8.7
10月末	10,106	3.9	27,587.46	3.4	92.9	6.8
11月末	10,242	5.3	27,968.99	4.8	91.6	8.2
12月末	9,565	△ 1.7	26,094.50	△ 2.2	95.2	4.6
2023年1月末	10,011	2.9	27,327.11	2.4	94.6	5.2
2月末	10,056	3.4	27,445.56	2.9	95.7	4.0
3月末	10,360	6.5	28,041.48	5.1	91.3	8.4
4月末	10,653	9.5	28,856.44	8.2	89.4	10.4
(期末)						
2023年5月25日	11,374	16.9	30,801.13	15.5	91.3	8.5

(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) 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5月26日～2023年5月25日)

期中の基準価額等の推移



期首：9,728円

期末：11,374円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：16.9% (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日経平均株価(日経225)は、期首(2022年5月25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) 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。

○基準価額の変動要因

ベンチマークである日経平均株価(日経225)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、経済正常化進展への期待や円安進行が支援材料となり上昇しました。後半は、金融システム不安への警戒感から相場が不安定化する場面もみられましたが、企業の資本効率改善への期待感や日銀による緩和的な金融政策が下支えとなり、割安銘柄を中心に上昇しました。

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。

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+16.9%となり、ベンチマークの+15.5%を1.5%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

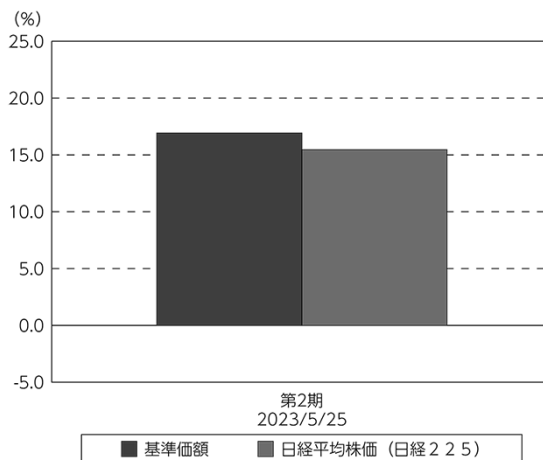
（マイナス要因）

- ・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

（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5月26日～ 2023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	1,666

(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

(2022年5月26日～2023年5月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	49	0.489	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(8)	(0.083)	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	1	0.014	(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)	(0.003)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.011)	
(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	51	0.510	
期中の平均基準価額は、10,037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。

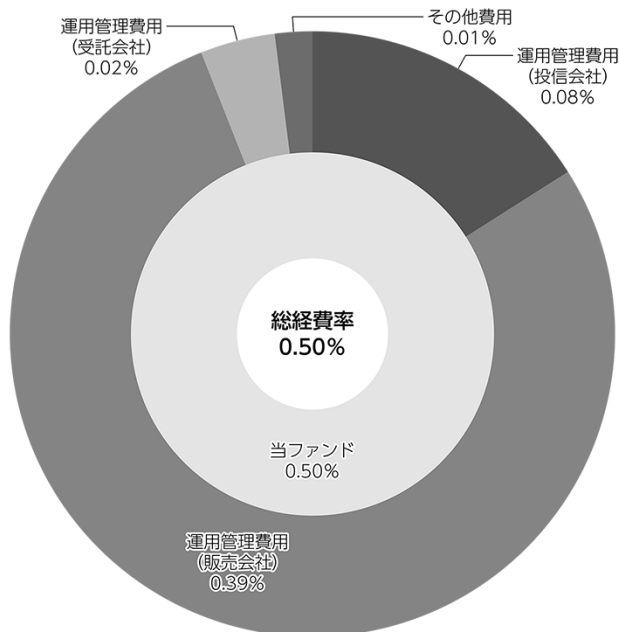
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.50%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5月26日～2023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	11,588,258 千口	17,606,268 千円	15,766,713 千口	25,552,324 千円

○株式売買比率

(2022年5月26日～2023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	32,740,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,685,088千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.22

(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5月26日～2023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	百万円 1	百万円 1	百万円 0.70565

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5月26日～2023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

(2022年5月26日～2023年5月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年5月25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
RM日経225マザーファンド		6,820,437	2,641,982	4,689,518

○投資信託財産の構成

(2023年5月25日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
RM日経225マザーファンド	4,689,518	88.4
コール・ローン等、その他	616,117	11.6
投資信託財産総額	5,305,635	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5月26日～2023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 (2023年5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,305,635,374
コール・ローン等	78,840,964
RM日経225マザーファンド(評価額)	4,689,518,410
未収入金	537,276,000
(B) 負債	607,877,101
未払解約金	580,356,523
未払信託報酬	27,147,365
未払利息	41
その他未払費用	373,172
(C) 純資産総額(A-B)	4,697,758,273
元本	4,130,131,171
次期繰越損益金	567,627,102
(D) 受益権総口数	4,130,131,171口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,374円

(注) 当ファンドの期首元本額は10,596,696,415円、期中追加設定元本額は20,893,872,622円、期中一部解約元本額は27,360,437,866円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.1374円です。

○損益の状況 (2022年5月26日～2023年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 17,838
支払利息	△ 17,838
(B) 有価証券売買損益	649,536,369
売買益	1,322,572,268
売買損	△ 673,035,899
(C) 信託報酬等	△ 52,058,875
(D) 当期損益金(A+B+C)	597,459,656
(E) 前期繰越損益金	△ 9,173,585
(F) 追加信託差損益金	△ 20,658,969
(配当等相当額)	(37,318,300)
(売買損益相当額)	(△ 57,977,269)
(G) 計(D+E+F)	567,627,102
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	567,627,102
追加信託差損益金	△ 20,658,969
(配当等相当額)	(100,026,337)
(売買損益相当額)	(△ 120,685,306)
分配準備積立金	588,286,071

(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(81,159,506円)、費用控除後の有価証券等損益額(503,162,598円)、信託約款に規定する収益調整金(100,026,337円)および分配準備積立金(3,963,967円)より分配対象収益は688,312,408円(1万口当たり1,666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6期（決算日 2023年5月25日）
（2022年5月26日～2023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を含みます。）の組入比率は、通常の状態では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。

○最近5期の運用実績

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
	期騰落	中率	(ベンチマーク)	期騰落中率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
6期(2023年5月25日)	17,750	17.5	30,801.13	15.5	91.4	8.5	10,935

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(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) 2022年5月25日	円	%		%	%	%
	15,102	—	26,677.80	—	90.2	9.7
5月末	15,442	2.3	27,279.80	2.3	91.1	8.8
6月末	14,958	△ 1.0	26,393.04	△ 1.1	89.3	10.6
7月末	15,752	4.3	27,801.64	4.2	94.9	5.0
8月末	15,910	5.4	28,091.53	5.3	89.6	10.3
9月末	14,797	△ 2.0	25,937.21	△ 2.8	91.2	8.7
10月末	15,724	4.1	27,587.46	3.4	93.1	6.8
11月末	15,943	5.6	27,968.99	4.8	91.7	8.2
12月末	14,894	△ 1.4	26,094.50	△ 2.2	95.3	4.6
2023年1月末	15,595	3.3	27,327.11	2.4	94.7	5.2
2月末	15,671	3.8	27,445.56	2.9	95.8	4.0
3月末	16,152	7.0	28,041.48	5.1	91.4	8.4
4月末	16,617	10.0	28,856.44	8.2	89.6	10.4
(期末) 2023年5月25日						
	17,750	17.5	30,801.13	15.5	91.4	8.5

(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

(2022年5月26日～2023年5月25日)

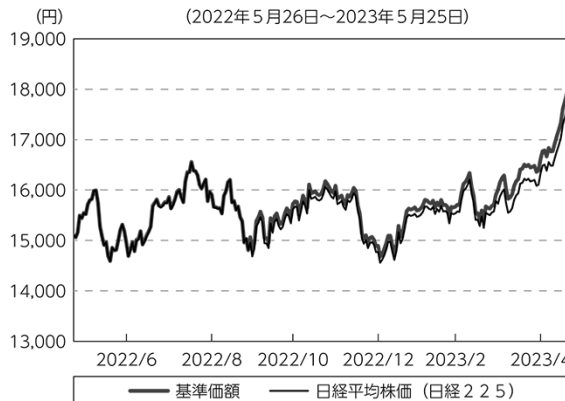
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

ベンチマークである日経平均株価（日経225）の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

基準価額等の推移

(2022年5月26日～2023年5月25日)



(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、経済正常化進展への期待や円安進行が支援材料となり上昇しました。期後半は、金融システム不安への警戒感から相場が不安定化する場面もみられましたが、企業の資本効率改善への期待感や日銀による緩和的な金融政策が下支えとなり、割安銘柄を中心に上昇しました。

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、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。

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+17.5%となり、ベンチマークの+15.5%を2.1%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

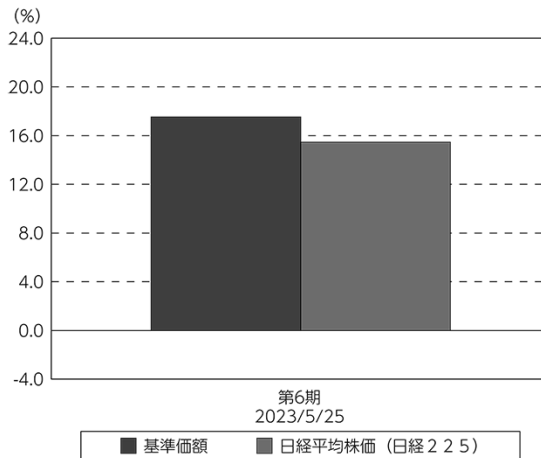
(マイナス要因)

- ・コスト負担（株式等に係る取引費用）が生じたこと

(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）



○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

(2022年5月26日～2023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 (1) (2)	% 0.015 (0.003) (0.011)	(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	0.015	
期中の平均基準価額は、15,621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

(2022年5月26日～2023年5月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,333 (314)	千円 13,521,310 ()	千株 4,552	千円 19,218,700

(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	株式先物取引	百万円 42,939	百万円 73,343	百万円 -	百万円 -

○株式売買比率

(2022年5月26日～2023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	32,740,010千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,685,088千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.22

(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5月26日～2023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	1	1	0.70565

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5月26日～2023年5月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023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%)			
ニッスイ	17	11	6,996
マルハニチロ	1.7	—	—
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	6.8	4.4	6,868
建設業 (1.7%)			
コムシスホールディングス	17	11	30,822
大成建設	3.4	2.2	10,329
大林組	17	11	12,859
清水建設	17	11	9,636
長谷工コーポレーション	3.4	2.2	3,597
鹿島建設	8.5	5.5	11,440
大和ハウス工業	17	11	39,556
積水ハウス	17	11	31,278
日揮ホールディングス	17	11	18,733
食料品 (3.6%)			
日清製粉グループ本社	17	11	19,569
明治ホールディングス	3.4	4.4	14,190
日本ハム	8.5	5.5	21,230
サッポロホールディングス	3.4	2.2	8,492
アサヒグループホールディングス	17	11	59,224
キリンホールディングス	17	11	23,452
宝ホールディングス	17	11	11,638
キッコーマン	17	11	90,200
味の素	17	11	59,158
ニチレイ	8.5	5.5	16,665
日本たばこ産業	17	11	33,880
繊維製品 (0.1%)			
東洋紡	1.7	—	—
ユニチカ	1.7	—	—
帝人	3.4	2.2	3,064
東レ	17	11	8,110
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	17	11	6,028

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	1.7	1.1	1,314
化学 (7.0%)			
クラレ	17	11	14,740
旭化成	17	11	10,600
レゾナック・ホールディングス	1.7	1.1	2,403
住友化学	17	11	4,730
日産化学	17	11	66,990
東ソー	8.5	5.5	9,234
トクヤマ	3.4	2.2	4,835
デンカ	3.4	2.2	5,880
信越化学工業	17	55	237,710
三井化学	3.4	2.2	7,821
三菱ケミカルグループ	8.5	5.5	4,513
UBE	1.7	1.1	2,456
花王	17	11	56,694
D I C	1.7	1.1	2,827
富士フィルムホールディングス	17	11	92,015
資生堂	17	11	70,884
日東電工	17	11	109,780
医薬品 (7.2%)			
協和キリン	17	11	29,821
武田薬品工業	17	11	50,116
アステラス製薬	85	55	128,755
住友ファーマ	17	11	7,755
塩野義製薬	17	11	68,145
中外製薬	51	33	124,080
エーザイ	17	11	97,625
第一三共	51	33	151,173
大塚ホールディングス	17	11	57,585
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	6.8	4.4	12,504
E N E O Sホールディングス	17	11	5,270
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	8.5	5.5	16,775

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	17	11	62,414
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	3.4	2.2	11,242
日本板硝子	1.7	1.1	667
日本電気硝子	5.1	3.3	8,820
住友大阪セメント	1.7	1.1	3,762
太平洋セメント	1.7	1.1	2,660
東海カーボン	17	11	13,497
TOTO	8.5	5.5	23,540
日本碍子	17	11	19,250
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	1.7	1.1	3,121
神戸製鋼所	1.7	1.1	1,191
JFEホールディングス	1.7	1.1	1,949
大太平洋金属	1.7	1.1	1,793
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	1.7	—	—
三井金属鉱業	1.7	1.1	3,470
東邦亜鉛	1.7	—	—
三菱マテリアル	1.7	1.1	2,618
住友金属鉱山	8.5	5.5	23,529
DOWAホールディングス	3.4	2.2	9,482
古河電気工業	1.7	1.1	2,667
住友電気工業	17	11	18,843
フジクラ	17	11	11,638
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	1.7	1.1	2,238
機械 (5.7%)			
日本製鋼所	3.4	2.2	6,212
オークマ	3.4	2.2	14,498
アマダ	17	11	15,048
SMC	—	1.1	81,598
小松製作所	17	11	37,444
住友重機械工業	3.4	2.2	7,084
日立建機	17	11	38,555
クボタ	17	11	22,242
荏原製作所	3.4	2.2	13,970
ダイキン工業	17	11	297,385

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	17	11	9,526
NTN	17	11	3,190
ジェイテクト	17	11	13,387
三井E&S	1.7	1.1	556
日立造船	3.4	2.2	1,852
三菱重工業	1.7	1.1	6,363
IHI	1.7	1.1	3,668
電気機器 (25.1%)			
コニカミノルタ	17	11	5,346
ミネベアミツミ	17	11	29,150
日立製作所	3.4	2.2	17,725
三菱電機	17	11	19,635
富士電機	3.4	2.2	13,508
安川電機	17	11	65,670
ニデック	—	8.8	63,500
オムロン	17	11	93,676
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3.4	2.2	5,541
日本電気	1.7	1.1	7,040
富士通	1.7	1.1	19,915
沖電気工業	1.7	—	—
ルネサスエレクトロニクス	—	11	23,655
セイコーエプソン	34	22	47,036
パナソニック ホールディングス	17	11	15,895
シャープ	17	11	9,185
ソニーグループ	17	11	145,970
TDK	51	33	172,260
アルプスアルパイン	17	11	13,728
横河電機	17	11	28,831
アドバンテスト	34	22	359,480
キーエンス	1.7	1.1	75,955
カシオ計算機	17	11	12,958
ファナック	17	55	262,130
京セラ	34	22	166,936
太陽誘電	17	11	45,540
村田製作所	13.6	8.8	71,341
SCREENホールディングス	3.4	2.2	30,008
キャノン	25.5	16.5	57,684
リコー	17	11	12,914

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン	17	33	620,400
輸送用機器 (4.3%)			
デンソー	17	11	95,381
川崎重工業	1.7	1.1	3,238
日産自動車	17	11	5,720
いすゞ自動車	8.5	5.5	9,273
トヨタ自動車	85	55	106,617
日野自動車	17	11	6,116
三菱自動車工業	1.7	1.1	514
マツダ	3.4	2.2	2,655
本田技研工業	34	22	87,890
スズキ	17	11	50,105
SUBARU	17	11	25,943
ヤマハ発動機	17	11	39,105
精密機器 (3.9%)			
テルモ	68	44	182,952
ニコン	17	11	17,204
オリンパス	68	44	94,622
HOYA	—	5.5	90,200
シチズン時計	17	11	8,833
その他製品 (2.7%)			
バンダイナムコホールディングス	17	33	108,339
凸版印刷	8.5	5.5	15,972
大日本印刷	8.5	5.5	21,835
ヤマハ	17	11	61,050
任天堂	1.7	11	64,636
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	1.7	1.1	534
中部電力	1.7	1.1	1,834
関西電力	1.7	1.1	1,780
東京瓦斯	3.4	2.2	6,677
大阪瓦斯	3.4	2.2	5,027
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	3.4	2.2	7,887
東急	8.5	5.5	10,213
小田急電鉄	8.5	5.5	11,192
京王電鉄	3.4	2.2	11,044
京成電鉄	8.5	5.5	28,380

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東日本旅客鉄道	1.7	1.1	8,473
西日本旅客鉄道	1.7	1.1	6,441
東海旅客鉄道	1.7	1.1	18,078
ヤマトホールディングス	17	11	27,984
NIPPON EXPRESSホールディングス	1.7	1.1	9,163
海運業 (0.3%)			
日本郵船	1.7	3.3	9,784
商船三井	5.1	3.3	10,461
川崎汽船	1.7	3.3	10,461
空運業 (0.3%)			
日本航空	—	11	28,875
ANAホールディングス	1.7	1.1	3,312
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	8.5	5.5	19,112
情報・通信業 (9.9%)			
ネクソン	34	22	65,208
Zホールディングス	6.8	4.4	1,536
トレンドマイクロ	17	11	72,380
日本電信電話	6.8	4.4	18,123
KDDI	102	66	287,034
ソフトバンク	17	11	16,423
東宝	1.7	1.1	6,039
エヌ・ティ・ティ・データ	85	55	109,395
コナミグループ	17	11	80,850
ソフトバンクグループ	102	66	334,290
卸売業 (2.9%)			
双日	1.7	1.1	3,132
伊藤忠商事	17	11	52,140
丸紅	17	11	21,532
豊田通商	17	11	68,640
三井物産	17	11	48,697
住友商事	17	11	29,128
三菱商事	17	11	62,029
小売業 (12.5%)			
J. フロント リテイリング	8.5	5.5	7,573
三越伊勢丹ホールディングス	17	11	15,400
セブン&アイ・ホールディングス	17	11	69,300
高島屋	8.5	5.5	10,428

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	17	11	26,191
イオン	17	11	31,102
ファーストリテイリング	17	33	1,094,280
銀行業 (0.6%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	11	11,319
コンソルディア・フィナンシャルグループ	17	11	6,017
あおぞら銀行	1.7	1.1	2,802
三菱UFJフィナンシャル・グループ	17	11	10,038
りそなホールディングス	1.7	1.1	705
三井住友トラスト・ホールディングス	1.7	1.1	5,566
三井住友フィナンシャルグループ	1.7	1.1	6,116
千葉銀行	17	11	9,680
ふくおかフィナンシャルグループ	3.4	2.2	5,764
静岡銀行	17	—	—
みずほフィナンシャルグループ	1.7	1.1	2,248
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	17	11	7,040
野村ホールディングス	17	11	5,503
松井証券	17	11	8,679
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	3.4	2.2	13,006
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	5.1	3.3	15,668
第一生命ホールディングス	1.7	1.1	2,671
東京海上ホールディングス	8.5	16.5	50,259
T&Dホールディングス	3.4	2.2	4,217

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 (0.7%)				
クレディセゾン	17	11	21,395	
オリックス	17	11	26,075	
日本取引所グループ	17	11	25,613	
不動産業 (1.0%)				
東急不動産ホールディングス	17	11	8,140	
三井不動産	17	11	29,711	
三菱地所	17	11	17,776	
東京建物	8.5	5.5	9,619	
住友不動産	17	11	34,947	
サービス業 (4.7%)				
エムスリー	40.8	26.4	80,968	
ディー・エヌ・エー	5.1	3.3	6,194	
電通グループ	17	11	50,325	
オリエンタルランド	—	11	57,574	
サイバーエージェント	13.6	8.8	8,835	
楽天グループ	17	11	6,468	
リクルートホールディングス	51	33	142,791	
日本郵政	17	11	10,996	
セコム	17	11	101,750	
合 計	株 数・金 額	3,196	2,291	9,997,899
	銘柄数<比率>	225	225	<91.4%>

(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	924	—
		日経225mini	6	—

○投資信託財産の構成

(2023年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	9,997,899	87.0
コール・ローン等、その他	1,500,165	13.0
投資信託財産総額	11,498,064	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5月26日～2023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 (2023年5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,497,835,142
コール・ローン等	1,291,093,756
株式(評価額)	9,997,899,890
未収入金	780
未収配当金	150,100,716
差入委託証拠金	58,740,000
(B) 負債	562,521,159
未払金	4,278,000
未払解約金	558,236,000
未払利息	673
その他未払費用	6,486
(C) 純資産総額(A-B)	10,935,313,983
元本	6,160,726,664
次期繰越損益金	4,774,587,319
(D) 受益権総口数	6,160,726,664口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,750円

(注) 当ファンドの期首元本額は9,468,681,091円、期中追加設定元本額は14,158,727,916円、期中一部解約元本額は17,466,682,343円です。

(注) 2023年5月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・Smart-i 日経225インデックス 3,518,744,461円
- ・りそな日経225インデックス 2,641,982,203円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.7750円です。

○損益の状況 (2022年5月26日～2023年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	325,435,285
受取配当金	326,768,056
その他収益金	7,413
支払利息	△ 1,340,184
(B) 有価証券売買損益	2,790,302,695
売買益	3,236,487,306
売買損	△ 446,184,611
(C) 先物取引等取引損益	184,186,810
取引益	624,697,820
取引損	△ 440,511,010
(D) 保管費用等	△ 58,645
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,299,866,145
(F) 前期繰越損益金	4,831,272,747
(G) 追加信託差損益金	7,418,160,084
(H) 解約差損益金	△10,774,711,657
(I) 計(E+F+G+H)	4,774,587,319
次期繰越損益金(I)	4,774,587,319

(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。