

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 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。

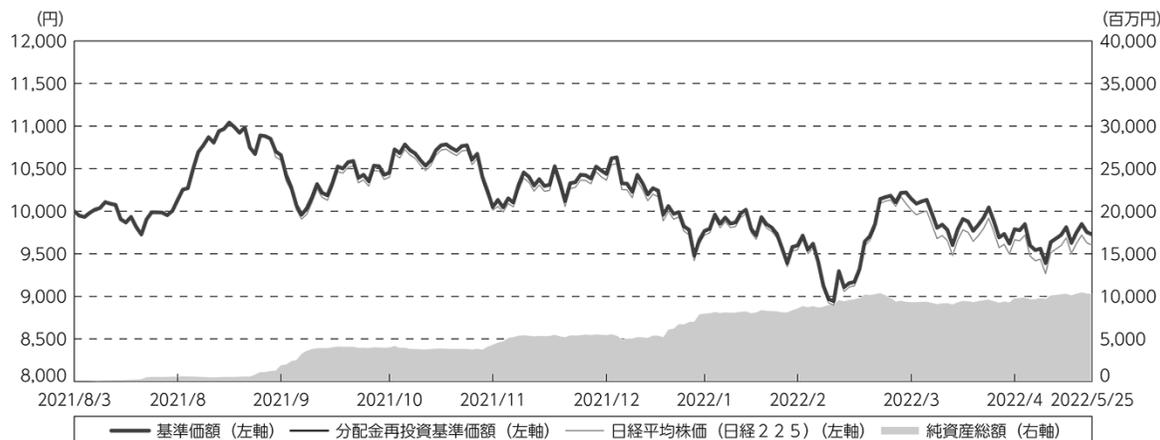
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(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。

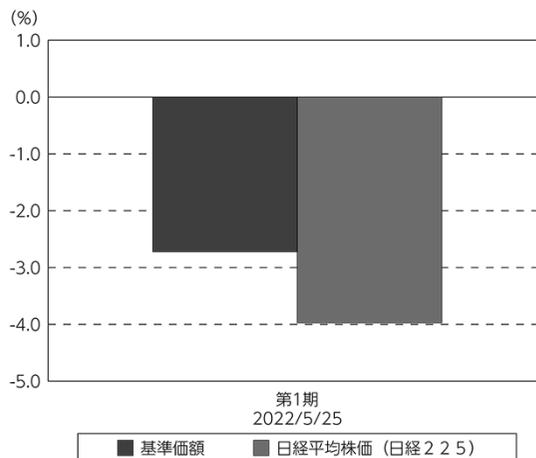
(プラス要因)

- ・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。

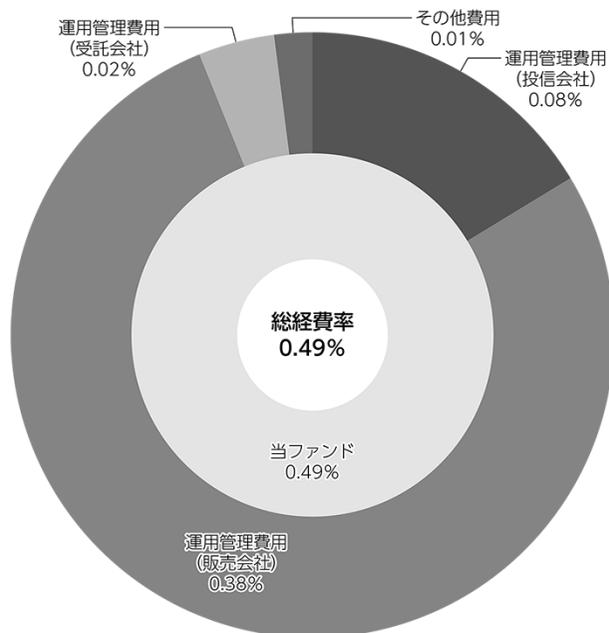
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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 | 円 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

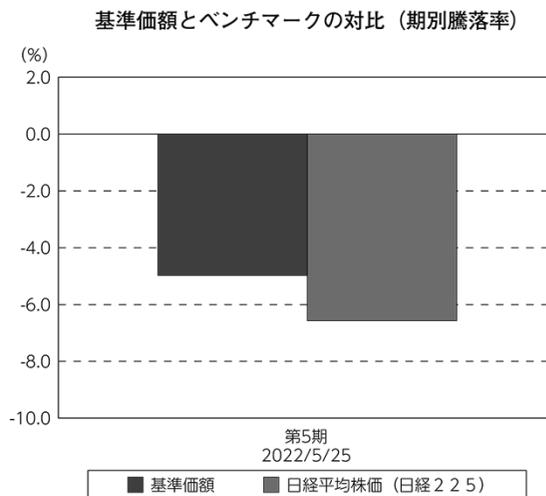
当期の基準価額の騰落率は-5.0%となり、ベンチマークの-6.6%を1.6%上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(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 |
| 富士フィ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 |
| S U B A R U | 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 S A T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 | | 百万円 | 百万円 |
| 内 | 株式先物取引 | 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。