

■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 | 東京証券取引所第一部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17期（決算日 2016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お願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900（フリーダイヤル）

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：<http://www.amundi.co.jp>

◆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 |
| 13期(2012年7月11日) | 5,315 | 0 | △10.9 | 8,851.00 | △12.1 | 96.3 | 3.6 | 48,359 |
| 14期(2013年7月11日) | 8,788 | 0 | 65.3 | 14,472.58 | 63.5 | 97.6 | 2.3 | 59,858 |
| 15期(2014年7月11日) | 9,270 | 0 | 5.5 | 15,164.04 | 4.8 | 95.9 | 4.4 | 67,860 |
| 16期(2015年7月13日) | 12,379 | 0 | 33.5 | 20,089.77 | 32.5 | 90.1 | 9.8 | 41,644 |
| 17期(2016年7月11日) | 9,786 | 0 | △20.9 | 15,708.82 | △21.8 | 93.6 | 6.4 | 66,425 |

(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おります。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(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 | | 株式組入率 | 株式先物比率 |
|------------|--------|-------|-----------|-------|-------|--------|
| | | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | |
| (期首) | 円 | % | 円 | % | % | % |
| 2015年7月13日 | 12,379 | — | 20,089.77 | — | 90.1 | 9.8 |
| 7月末 | 12,679 | 2.4 | 20,585.24 | 2.5 | 92.5 | 7.4 |
| 8月末 | 11,652 | △5.9 | 18,890.48 | △6.0 | 94.0 | 6.0 |
| 9月末 | 10,784 | △12.9 | 17,388.15 | △13.4 | 92.6 | 7.3 |
| 10月末 | 11,828 | △4.5 | 19,083.10 | △5.0 | 95.8 | 4.1 |
| 11月末 | 12,229 | △1.2 | 19,747.47 | △1.7 | 96.5 | 3.5 |
| 12月末 | 11,792 | △4.7 | 19,033.71 | △5.3 | 93.2 | 6.8 |
| 2016年1月末 | 10,854 | △12.3 | 17,518.30 | △12.8 | 93.0 | 6.9 |
| 2月末 | 9,920 | △19.9 | 16,026.76 | △20.2 | 94.2 | 5.7 |
| 3月末 | 10,445 | △15.6 | 16,758.67 | △16.6 | 93.7 | 6.3 |
| 4月末 | 10,377 | △16.2 | 16,666.05 | △17.0 | 96.4 | 3.6 |
| 5月末 | 10,731 | △13.3 | 17,234.98 | △14.2 | 94.5 | 5.4 |
| 6月末 | 9,705 | △21.6 | 15,575.92 | △22.5 | 93.1 | 6.8 |
| (期末) | | | | | | |
| 2016年7月11日 | 9,786 | △20.9 | 15,708.82 | △21.8 | 93.6 | 6.4 |

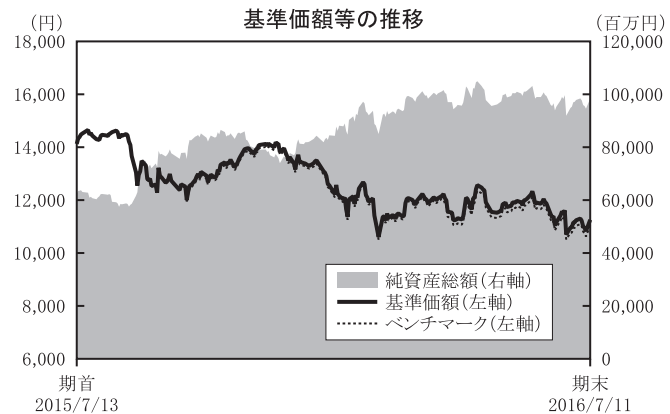
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 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おります。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

【基準価額等の推移】

| | |
|----------------|---------|
| 第17期首 | 12,379円 |
| 第17期末 | 9,786円 |
| 既払分配金 (税込み) | 0円 |
| 騰落率 | △20.9% |



(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、2015年7月13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】

下落要因

- ① ギリシャ債務不履行不安と中国人民元切り下げを契機とした資本流出による急激な円高と株安 (期初-2015年9月末まで)
- ② E C B (欧州中央銀行) の追加金融緩和に対する失望と日銀の質的・量的緩和の不透明な補完措置、さらに、原油価格下落による大幅な株安 (2015年11月末-2016年2月半ばまで)
- ③ 低調な米雇用統計による米ドル安・円高の進行と日銀によるマイナス金利政策導入後の金融株懸念を背景とした株安 (2016年4月後半-期末まで)

上昇要因

- ① 中国の金融緩和とE C Bによる追加緩和示唆発言、さらにF R B (米連邦準備理事会) による利上げ期待に伴う株高 (2015年9月末-2015年11月末まで)
- ② 原油価格の反発に伴うデフレ不安の後退による株高 (2016年2月半ば-2016年4月後半まで)

【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、アムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券への投資を通じて、日経平均株価に連動する投資成果を目標とし運用を行いました。また、マザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

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>

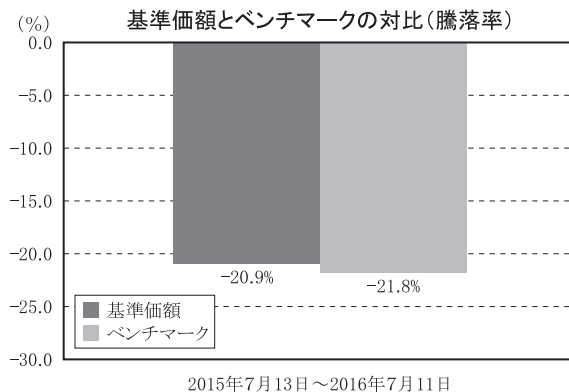
マザーファンドのポートフォリオにつきましては、アムンディ・日経225オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額は、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（-21.8%）を0.9%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

マイナス要因：信託報酬などのコスト負担



（注）ベンチマーク（ファンドの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。

【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17期 (2015年7月14日 ～2016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) | 89円 (36) (42) (12) | 0.806% (0.322) (0.376) (0.107) | 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) | 2 (1) (0) (1) | 0.018 (0.007) (0.004) (0.006) | 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 | 91 | 0.826 | |

期中の平均基準価額は11,083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。

◆ 売買及び取引の状況 (2015年7月14日から2016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 | 48,373,860 | 61,194,080 | 18,852,509 | 25,433,800 |

(注) 単位未満は切捨てです。

りそな・日経225オープン

◆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 | 88,794,851千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 82,432,571千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.07 |

(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 (2015年7月14日から2016年7月11日まで)

アムンディ・日経225オープンマザーファンドにおける主要な売買銘柄
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 |
| ファーストリテイリング | 156 | 6,556,892 | 42,031 | ファーストリテイリング | 36 | 1,694,087 | 47,057 |
| ファナック | 156 | 2,928,682 | 18,773 | ファナック | 36 | 775,662 | 21,546 |
| ソフトバンクグループ | 468 | 2,842,055 | 6,072 | ソフトバンクグループ | 108 | 727,372 | 6,734 |
| KDDI | 936 | 2,779,762 | 2,969 | KDDI | 216 | 663,844 | 3,073 |
| 京セラ | 312 | 1,690,939 | 5,419 | 京セラ | 72 | 425,895 | 5,915 |
| アステラス製薬 | 780 | 1,300,354 | 1,667 | アステラス製薬 | 180 | 316,791 | 1,759 |
| セコム | 156 | 1,207,185 | 7,738 | ダイキン工業 | 36 | 309,766 | 8,604 |
| ダイキン工業 | 156 | 1,195,336 | 7,662 | TDK | 36 | 303,237 | 8,423 |
| エーザイ | 156 | 1,161,824 | 7,447 | 日東電工 | 36 | 302,717 | 8,408 |
| 日東電工 | 156 | 1,153,580 | 7,394 | セコム | 36 | 297,790 | 8,271 |

(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 (2015年7月14日から2016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 (2016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 | 29,476,129 | 58,997,480 | 66,401,664 |

(注1) 口数・評価額の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87,416,908千口です。

◆投資信託財産の構成 (2016年7月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| アムンディ・日経225オープンマザーファンド | 66,401,664 | 99.5 |
| コール・ローン等、その他 | 336,651 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 66,738,315 | 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

(2016年7月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 66,738,315,428円 |
| コール・ローン等 | 336,651,234 |
| アムンディ・日経225オープンマザーファンド(評価額) | 66,401,664,194 |
| (B) 負 債 | 312,746,942 |
| 未払解約金 | 44,442,329 |
| 未払信託報酬 | 260,408,497 |
| 未払利息 | 830 |
| その他未払費用 | 7,895,286 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 66,425,568,486 |
| 元 本 | 67,881,504,193 |
| 次期繰越損益金 | △1,455,935,707 |
| (D) 受益権総口数 | 67,881,504,193口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,786円 |

(注記事項)

期首元本額

33,640,945,406円

期中追加設定元本額

64,672,810,853円

期中一部解約元本額

30,432,252,066円

◆損益の状況

当期(自2015年7月14日 至2016年7月11日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △62,002円 |
| 受 取 利 息 | 13,144 |
| 支 払 利 息 | △75,146 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △10,013,034,436 |
| 売 買 益 | 1,615,370,725 |
| 売 買 損 | △11,628,405,161 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △480,630,046 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △10,493,726,484 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,843,263,893 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 7,194,526,884 |
| (配当等相当額) | (32,004,502,026) |
| (売買損益相当額) | (△24,809,975,142) |
| (G) 計 (D + E + F) | △1,455,935,707 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △1,455,935,707 |
| 追加信託差損益金 | 7,194,526,884 |
| (配当等相当額) | (32,081,040,396) |
| (売買損益相当額) | (△24,886,513,512) |
| 分配準備積立金 | 2,445,973,071 |
| 繰越損益金 | △11,096,435,662 |

(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17期 |
|-----------|-------------------------|
| | (2015年7月14日～2016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 | 5,086 |

(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。

◀お知らせ▶

平成27年10月14日付で、信用リスク集中回避のための投資制限に関する条文の新設、及び条文整備のため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

アムンディ・日経225オープンマザーファンド 第17期

運用報告書

(決算日 2016年7月11日)
(計算期間：2015年7月14日～2016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 | 東京証券取引所第一部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。 |

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

お客様サポートライン 0120-202-900(フリーダイヤル)

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：<http://www.amundi.co.jp>

◆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 |
|-----------------|--------|-----------|--------------------|-----------|------------|------------|-----------|
| | 円 | 期中 騰落率 | 円 | 期中 騰落率 | | | |
| 13期(2012年7月11日) | 5,915 | △10.2 | 8,851.00 | △12.1 | 96.4 | 3.6 | 66,947 |
| 14期(2013年7月11日) | 9,861 | 66.7 | 14,472.58 | 63.5 | 97.6 | 2.3 | 81,435 |
| 15期(2014年7月11日) | 10,487 | 6.3 | 15,164.04 | 4.8 | 95.9 | 4.4 | 98,271 |
| 16期(2015年7月13日) | 14,123 | 34.7 | 20,089.77 | 32.5 | 90.1 | 9.8 | 62,467 |
| 17期(2016年7月11日) | 11,255 | △20.3 | 15,708.82 | △21.8 | 93.6 | 6.4 | 98,387 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(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

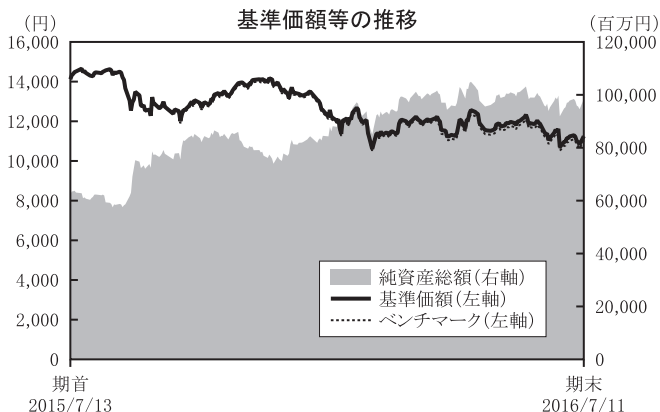
| 年月日 | 基準価額 | | 日経平均株価 (ベンチマーク) | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 |
|--------------------|--------|-------|--------------------|-------|------------|------------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | |
| (期首) 2015年7月13日 | 14,123 | — | 20,089.77 | — | 90.1 | 9.8 |
| 7月末 | 14,471 | 2.5 | 20,585.24 | 2.5 | 92.6 | 7.4 |
| 8月末 | 13,308 | △5.8 | 18,890.48 | △6.0 | 94.0 | 6.0 |
| 9月末 | 12,324 | △12.7 | 17,388.15 | △13.4 | 92.7 | 7.3 |
| 10月末 | 13,527 | △4.2 | 19,083.10 | △5.0 | 95.9 | 4.1 |
| 11月末 | 13,996 | △0.9 | 19,747.47 | △1.7 | 96.5 | 3.5 |
| 12月末 | 13,505 | △4.4 | 19,033.71 | △5.3 | 93.2 | 6.8 |
| 2016年1月末 | 12,438 | △11.9 | 17,518.30 | △12.8 | 93.1 | 6.9 |
| 2月末 | 11,375 | △19.5 | 16,026.76 | △20.2 | 94.2 | 5.7 |
| 3月末 | 11,986 | △15.1 | 16,758.67 | △16.6 | 93.7 | 6.3 |
| 4月末 | 11,916 | △15.6 | 16,666.05 | △17.0 | 96.4 | 3.6 |
| 5月末 | 12,331 | △12.7 | 17,234.98 | △14.2 | 94.6 | 5.4 |
| 6月末 | 11,160 | △21.0 | 15,575.92 | △22.5 | 93.2 | 6.8 |
| (期末) 2016年7月11日 | 11,255 | △20.3 | 15,708.82 | △21.8 | 93.6 | 6.4 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

【基準価額等の推移】

| | |
|-------|---------|
| 第17期首 | 14,123円 |
| 第17期末 | 11,255円 |
| 騰落率 | △20.3% |



- (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、2015年7月13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】

下落要因

- ① ギリシャ債務不履行不安と中国人民元切り下げを契機とした資本流出による急激な円高と株安（期初－2015年9月末まで）
- ② E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和に対する失望と日銀の質的・量的緩和の不透明な補完措置、さらに、原油価格下落による大幅な株安（2015年11月末－2016年2月半ばまで）
- ③ 低調な米雇用統計による米ドル安・円高の進行と日銀によるマイナス金利政策導入後の金融株懸念を背景とした株安（2016年4月後半－期末まで）

上昇要因

- ① 中国の金融緩和とE C Bによる追加緩和示唆発言、さらにF R B（米連邦準備理事会）による利上げ期待に伴う株高（2015年9月末－2015年11月末まで）
- ② 原油価格の反発に伴うデフレ不安の後退による株高（2016年2月半ば－2016年4月後半まで）

【投資環境】

<国内株式市場>

当期の国内株式市場は、当初1ヵ月は相次ぐ好材料が市場を支えたものの、その後内外景気の弱さに投資家のリスク資産回避の動きが加わり、厳しい展開を余儀なくされました。期初は米利上げ期待を背

景とした円安と増産で軟化する需給を映した原油安によって日本企業業績上方修正期待が高まり、投資家の買い意欲が盛り上がりました。ところが折からのギリシャの債務不履行への不安が高まり、2015年8月には中国が突如人民元の切り下げを発表したことで、中国からの資本流出を懸念して世界株式市場が動揺し、急激な円高で日本株は大きく水準を切り下げました。10月に入って中国の金融緩和とECBからの追加緩和示唆発言が株価の急反発を演出し、近づくFRBによる利上げを織り込んで米ドル高・円安が進行すると12月には夏場の高値を射程に捉えました。ところが実施されたECBの追加金融緩和策が期待以下であったこと、利上げを実施したFRBが慎重姿勢を強調したこと、日銀が導入した質的・量的緩和の補完措置の効果が不透明とみなされたことが重なり、円高が進行しました。原油価格が2003年来の安値に沈んだことで投資家のリスク回避姿勢が強まった2016年1月末に日銀はマイナス金利政策の導入を決定し、市場は大きく反発しました。2月には原油価格も反発に転じ、デフレ不安が後退する中で市場は下値切り上げの展開へ移行しました。ところが大方の予想に反して日銀は4月末の追加緩和を見送ったことで一気に失望売りが出ました。やがて米国の雇用統計の弱さから利上げ先送りの予想が主流になると、米ドル安・円高が進行し、予想ほど落ち込まなかった2015年度決算や政府の消費増税先送り決定にもかかわらず水準を切り下げて期末を迎えました。マイナス金利政策導入後は、大幅な金利低下と預貸スプレッドの縮小を懸念して、とりわけ金融株が大きく売られました。

【ポートフォリオ】

当ファンドは、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銘柄以上に等株数投資を行い、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。2015年10月の定例入替で、除外となる日東紡と平和不動産を売却し、新規採用の長谷工コーポレーションとディー・エヌ・エーを組入れました。また、2016年3月末に除外となる横浜銀行を売却し、4月に新規採用となるコンコルディア・フィナンシャルグループを組入れました。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。

【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17期 (2015年7月14日 ～2016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) | 0.000 (0.000) | 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 | 0.002 | |

期中の平均基準価額は12,694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 (2015年7月14日から2016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 33,266 (△598) | 千円 70,665,441 (-) | 千株 8,013 | 千円 18,129,409 |

(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 91,361 | 百万円 90,281 | 百万円 274 | 百万円 272 |

◆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 | 88,794,851千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 82,432,571千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 1.07 |

(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 (2015年7月14日から2016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 |
| ファーストリテイリング | 156 | 6,556,892 | 42,031 | ファーストリテイリング | 36 | 1,694,087 | 47,057 |
| ファナック | 156 | 2,928,682 | 18,773 | ファナック | 36 | 775,662 | 21,546 |
| ソフトバンクグループ | 468 | 2,842,055 | 6,072 | ソフトバンクグループ | 108 | 727,372 | 6,734 |
| KDD I | 936 | 2,779,762 | 2,969 | KDD I | 216 | 663,844 | 3,073 |
| 京セラ | 312 | 1,690,939 | 5,419 | 京セラ | 72 | 425,895 | 5,915 |
| アステラス製薬 | 780 | 1,300,354 | 1,667 | アステラス製薬 | 180 | 316,791 | 1,759 |
| セコム | 156 | 1,207,185 | 7,738 | ダイキン工業 | 36 | 309,766 | 8,604 |
| ダイキン工業 | 156 | 1,195,336 | 7,662 | TDK | 36 | 303,237 | 8,423 |
| エーザイ | 156 | 1,161,824 | 7,447 | 日東電工 | 36 | 302,717 | 8,408 |
| 日東電工 | 156 | 1,153,580 | 7,394 | セコム | 36 | 297,790 | 8,271 |

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

◆利害関係人との取引状況等 (2015年7月14日から2016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 (2016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(0.2%) | | | |
| 日本水産 | 110 | 230 | 118,220 |
| マルハニチロ | 11 | 23 | 62,514 |
| 鉱業(0.1%) | | | |
| 国際石油開発帝石 | 44 | 92 | 70,508 |
| 建設業(3.1%) | | | |
| コムシスホールディングス | 110 | 230 | 395,140 |
| 大成建設 | 110 | 230 | 198,490 |
| 大林組 | 110 | 230 | 252,540 |
| 清水建設 | 110 | 230 | 226,780 |
| 長谷工コーポレーション | — | 46 | 45,218 |
| 鹿島建設 | 110 | 230 | 168,130 |
| 大和ハウス工業 | 110 | 230 | 658,260 |
| 積水ハウス | 110 | 230 | 385,020 |
| 日揮 | 110 | 230 | 345,920 |
| 千代田化工建設 | 110 | 230 | 158,010 |
| 食料品(6.2%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 110 | 230 | 389,620 |
| 明治ホールディングス | 11 | 46 | 494,960 |
| 日本ハム | 110 | 230 | 600,760 |
| サッポロホールディングス | 110 | 46 | 137,862 |
| アサヒグループホールディングス | 110 | 230 | 797,410 |
| キリンホールディングス | 110 | 230 | 414,575 |
| 宝ホールディングス | 110 | 230 | 222,180 |
| キッコーマン | 110 | 230 | 900,450 |
| 味の素 | 110 | 230 | 588,800 |
| ニチレイ | 110 | 230 | 223,100 |
| 日本たばこ産業 | 110 | 230 | 991,990 |
| 繊維製品(0.4%) | | | |
| 東洋紡 | 110 | 230 | 47,150 |
| ユニチカ | 110 | 230 | 13,570 |
| 日清紡ホールディングス | 110 | — | — |
| 帝人 | 110 | 230 | 85,790 |
| 東レ | 110 | 230 | 212,520 |
| パルプ・紙(0.3%) | | | |
| 王子ホールディングス | 110 | 230 | 92,460 |
| 日本製紙 | 11 | 23 | 42,596 |
| 北越紀州製紙 | 110 | 230 | 173,650 |
| 化学(8.6%) | | | |
| クラレ | 110 | 230 | 286,120 |
| 旭化成 | 110 | 230 | 166,428 |
| 昭和電工 | 110 | 23 | 21,827 |
| 住友化学 | 110 | 230 | 94,760 |
| 日産化学工業 | 110 | 230 | 730,250 |
| 日本曹達 | 110 | 230 | 94,760 |
| 東ソー | 110 | 230 | 104,880 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|-------------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トクヤマ | 110 | 230 | 68,770 |
| デンカ | 110 | 230 | 94,070 |
| 信越化学工業 | 110 | 230 | 1,397,710 |
| 三井化学 | 110 | 230 | 83,490 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 55 | 115 | 54,694 |
| 宇部興産 | 110 | 230 | 39,100 |
| 日本化薬 | 110 | 230 | 217,120 |
| 花王 | 110 | 230 | 1,356,540 |
| 富士フイルムホールディングス | 110 | 230 | 894,240 |
| 資生堂 | 110 | 230 | 674,820 |
| 日東電工 | 110 | 230 | 1,509,950 |
| 医薬品(8.5%) | | | |
| 協和発酵キリン | 110 | 230 | 418,600 |
| 武田薬品工業 | 110 | 230 | 1,008,090 |
| アステラス製薬 | 550 | 1,150 | 1,872,200 |
| 大日本住友製薬 | 110 | 230 | 442,290 |
| 塩野義製薬 | 110 | 230 | 1,322,500 |
| 中外製薬 | 110 | 230 | 874,000 |
| エーザイ | 110 | 230 | 1,317,440 |
| 第一三共 | 110 | 230 | 606,740 |
| 石油・石炭製品(0.3%) | | | |
| 昭和シェル石油 | 110 | 230 | 218,040 |
| JXホールディングス | 110 | 230 | 90,206 |
| ゴム製品(1.0%) | | | |
| 横浜ゴム | 55 | 115 | 148,695 |
| ブリヂストン | 110 | 230 | 748,190 |
| ガラス・土石製品(1.6%) | | | |
| 日東紡績 | 110 | — | — |
| 旭硝子 | 110 | 230 | 119,140 |
| 日本板硝子 | 110 | 230 | 14,720 |
| 日本電気硝子 | 165 | 345 | 150,765 |
| 住友大阪セメント | 110 | 230 | 108,330 |
| 太平洋セメント | 110 | 230 | 60,260 |
| 東海カーボン | 110 | 230 | 62,560 |
| TOTO | 110 | 115 | 473,225 |
| 日本碍子 | 110 | 230 | 462,760 |
| 鉄鋼(0.2%) | | | |
| 新日鐵住金 | 110 | 23 | 45,551 |
| 神戸製鋼所 | 110 | 230 | 19,780 |
| ジェイエフイーホールディングス | 11 | 23 | 30,693 |
| 日新製鋼 | 11 | 23 | 29,647 |
| 大平洋金属 | 110 | 230 | 66,240 |
| 非鉄金属(1.2%) | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 110 | 230 | 51,520 |
| 三井金属鉱業 | 110 | 230 | 42,780 |
| 東邦亜鉛 | 110 | 230 | 81,420 |

アムンディ・日経225オープンマザーファンド

| 銘柄 | 期首 (前期末) | 当期末 | |
|---------------------|-------------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱マテリアル | 110 | 230 | 58,650 |
| 住友金属鉱山 | 110 | 230 | 248,515 |
| DOWAホールディングス | 110 | 230 | 127,190 |
| 古河機械金属 | 110 | 230 | 31,740 |
| 古河電気工業 | 110 | 230 | 57,730 |
| 住友電気工業 | 110 | 230 | 298,540 |
| フジクラ | 110 | 230 | 105,340 |
| 金属製品 (0.5%) | | | |
| SUMCO | 11 | 23 | 14,720 |
| 東洋製鐵グループホールディングス | 110 | 230 | 461,610 |
| 機械 (4.8%) | | | |
| 日本製鋼所 | 110 | 230 | 104,420 |
| オークマ | 110 | 230 | 155,710 |
| アマダホールディングス | 110 | 230 | 232,300 |
| 小松製作所 | 110 | 230 | 427,915 |
| 住友重機械工業 | 110 | 230 | 101,430 |
| 日立建機 | 110 | 230 | 335,800 |
| クボタ | 110 | 230 | 305,440 |
| 荏原製作所 | 110 | 230 | 131,330 |
| ダイキン工業 | 110 | 230 | 1,956,610 |
| 日本精工 | 110 | 230 | 171,120 |
| NTN | 110 | 230 | 59,570 |
| ジェイテクト | 110 | 230 | 256,220 |
| 日立造船 | 22 | 46 | 22,218 |
| 三菱重工業 | 110 | 230 | 99,130 |
| IHI | 110 | 230 | 66,470 |
| 電気機器 (16.5%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | — | 230 | 218,040 |
| コニカミノルタ | 110 | 230 | 171,810 |
| ミネベア | 110 | 230 | 149,960 |
| 日立製作所 | 110 | 230 | 96,577 |
| 東芝 | 110 | 230 | 65,550 |
| 三菱電機 | 110 | 230 | 269,215 |
| 富士電機 | 110 | 230 | 97,980 |
| 安川電機 | 110 | 230 | 288,880 |
| 明電舎 | 110 | 230 | 75,440 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 110 | 230 | 92,230 |
| 日本電気 | 110 | 230 | 58,420 |
| 富士通 | 110 | 230 | 83,099 |
| 沖電気工業 | 110 | 230 | 30,130 |
| パナソニック | 110 | 230 | 214,153 |
| シャープ | 110 | 230 | 24,380 |
| ソニー | 110 | 230 | 720,590 |
| TDK | 110 | 230 | 1,274,200 |
| ミツミ電機 | 110 | 230 | 94,300 |
| アルプス電気 | 110 | 230 | 399,740 |
| パイオニア | 110 | 230 | 39,560 |
| 横河電機 | 110 | 230 | 276,690 |
| アドバンテスト | 220 | 460 | 494,040 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | 当期末 | |
|----------------------|-------------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カシオ計算機 | 110 | 230 | 345,000 |
| ファナック | 110 | 230 | 3,716,800 |
| 京セラ | 220 | 460 | 2,219,040 |
| 太陽誘電 | 110 | 230 | 190,670 |
| SCREENホールディングス | 110 | 230 | 253,230 |
| キャノン | 165 | 345 | 994,290 |
| リコー | 110 | 230 | 194,350 |
| 東京エレクトロン | 110 | 230 | 2,017,100 |
| 輸送用機器 (5.9%) | | | |
| デンソー | 110 | 230 | 813,280 |
| 三井造船 | 110 | 230 | 32,430 |
| 川崎重工業 | 110 | 230 | 61,640 |
| 日産自動車 | 110 | 230 | 222,410 |
| いすゞ自動車 | 55 | 115 | 148,637 |
| トヨタ自動車 | 110 | 230 | 1,219,230 |
| 日野自動車 | 110 | 230 | 222,410 |
| 三菱自動車工業 | 11 | 23 | 10,649 |
| マツダ | 22 | 46 | 59,478 |
| 本田技研工業 | 220 | 460 | 1,185,190 |
| スズキ | 110 | 230 | 650,440 |
| 富士重工業 | 110 | 230 | 802,470 |
| 精密機器 (3.7%) | | | |
| テルモ | 220 | 460 | 2,129,800 |
| ニコン | 110 | 230 | 321,540 |
| オリンパス | 110 | 230 | 823,400 |
| シチズンホールディングス | 110 | 230 | 117,530 |
| その他製品 (1.2%) | | | |
| 凸版印刷 | 110 | 230 | 202,170 |
| 大日本印刷 | 110 | 230 | 274,160 |
| ヤマハ | 110 | 230 | 622,380 |
| 電気・ガス業 (0.3%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 11 | 23 | 9,453 |
| 中部電力 | 11 | 23 | 33,522 |
| 関西電力 | 11 | 23 | 22,358 |
| 東京瓦斯 | 110 | 230 | 99,015 |
| 大阪瓦斯 | 110 | 230 | 92,276 |
| 陸運業 (2.9%) | | | |
| 東武鉄道 | 110 | 230 | 132,480 |
| 東京急行電鉄 | 110 | 230 | 201,940 |
| 小田急電鉄 | 110 | 230 | 284,050 |
| 京王電鉄 | 110 | 230 | 226,090 |
| 京成電鉄 | 110 | 230 | 308,430 |
| 東日本旅客鉄道 | 11 | 23 | 219,857 |
| 西日本旅客鉄道 | 11 | 23 | 151,478 |
| 東海旅客鉄道 | 11 | 23 | 432,630 |
| 日本通運 | 110 | 230 | 112,010 |
| ヤマトホールディングス | 110 | 230 | 601,450 |
| 海運業 (0.2%) | | | |
| 日本郵船 | 110 | 230 | 40,710 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | 当期末 | |
|-------------------------|-------------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 商船三井 | 110 | 230 | 49,220 |
| 川崎汽船 | 110 | 230 | 57,500 |
| 空運業(0.1%) | | | |
| ANAホールディングス | 110 | 230 | 65,389 |
| 倉庫・運輸関連業(0.4%) | | | |
| 三菱倉庫 | 110 | 230 | 327,980 |
| 情報・通信業(12.6%) | | | |
| ヤフー | 44 | 92 | 42,228 |
| トレンドマイクロ | 110 | 230 | 833,750 |
| スカパーJ SATホールディングス | 11 | 23 | 10,166 |
| 日本電信電話 | 22 | 46 | 226,044 |
| KDDI | 660 | 1,380 | 4,367,700 |
| NTTドコモ | 11 | 23 | 65,343 |
| 東宝 | 11 | 23 | 63,710 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 110 | 230 | 1,129,300 |
| コナミホールディングス | 110 | 230 | 982,100 |
| ソフトバンクグループ | 330 | 690 | 3,917,820 |
| 卸売業(2.0%) | | | |
| 双日 | 11 | 23 | 5,658 |
| 伊藤忠商事 | 110 | 230 | 292,675 |
| 丸紅 | 110 | 230 | 110,009 |
| 豊田通商 | 110 | 230 | 526,240 |
| 三井物産 | 110 | 230 | 281,520 |
| 住友商事 | 110 | 230 | 241,155 |
| 三菱商事 | 110 | 230 | 424,695 |
| 小売業(9.3%) | | | |
| J.フロントリテイリング | 55 | 115 | 123,625 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 110 | 230 | 218,500 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 110 | 230 | 985,320 |
| 高島屋 | 110 | 230 | 169,050 |
| 丸井グループ | 110 | 230 | 346,610 |
| イオン | 110 | 230 | 342,125 |
| ユニグループ・ホールディングス | 110 | 230 | 198,950 |
| ファーストリテイリング | 110 | 230 | 6,174,350 |
| 銀行業(0.9%) | | | |
| コンソルディア・フィナンシャルグループ | — | 230 | 92,966 |
| 新生銀行 | 110 | 230 | 33,120 |
| あおぞら銀行 | 110 | 230 | 79,350 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 110 | 230 | 102,695 |
| りそなホールディングス | 11 | 23 | 8,429 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 110 | 230 | 70,564 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 11 | 23 | 65,573 |
| 千葉銀行 | 110 | 230 | 107,870 |
| 横浜銀行 | 110 | — | — |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 110 | 230 | 77,050 |
| 静岡銀行 | 110 | 230 | 158,700 |
| みずほフィナンシャルグループ | 110 | 230 | 33,649 |
| 証券・商品先物取引業(0.4%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 110 | 230 | 124,637 |

| 銘柄 | 期首 (前期末) | 当期末 | | |
|---------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 野村ホールディングス | 110 | 230 | 85,951 | |
| 松井証券 | 110 | 230 | 200,560 | |
| 保険業(0.9%) | | | | |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 27.5 | 57.5 | 155,278 | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 33 | 69 | 176,260 | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 22 | 46 | 49,358 | |
| 第一生命保険 | 11 | 23 | 24,403 | |
| 東京海上ホールディングス | 55 | 115 | 396,750 | |
| T&Dホールディングス | 22 | 46 | 40,010 | |
| その他金融業(0.4%) | | | | |
| クレディセゾン | 110 | 230 | 384,100 | |
| 不動産業(1.9%) | | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 110 | 230 | 135,010 | |
| 三井不動産 | 110 | 230 | 497,030 | |
| 三菱地所 | 110 | 230 | 410,780 | |
| 平和不動産 | 22 | — | — | |
| 東京建物 | 55 | 115 | 138,345 | |
| 住友不動産 | 110 | 230 | 592,710 | |
| サービス業(3.4%) | | | | |
| ディー・エヌ・エー | — | 69 | 177,054 | |
| 電通 | 110 | 230 | 1,074,100 | |
| 東京ドーム | 110 | 230 | 108,560 | |
| セコム | 110 | 230 | 1,762,260 | |
| 合計 | 株数・金額 | 23,380 | 48,035 | 92,114,138 |
| | 銘柄数<比率> | 225 | 225 | <93.6%> |

(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。

(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 |
| 国内 | 百万円 | 百万円 |
| 日経 225 | 6,268 | — |

(注) 単位未満は切捨てです。

◆投資信託財産の構成 (2016年7月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株 式 | 92,114,138 | 92.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 7,255,281 | 7.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 99,369,419 | 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

(2016年7月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 99,318,702,325円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 6,409,161,675 |
| 株 式 (評価額) | 92,114,138,650 |
| 未 収 配 当 金 | 130,416,000 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 664,986,000 |
| (B) 負 債 | 930,739,222 |
| 未 払 金 | 930,723,419 |
| 未 払 利 息 | 15,803 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 98,387,963,103 |
| 元 本 | 87,416,908,225 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 10,971,054,878 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 87,416,908,225口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D) | 11,255円 |

(注記事項)

| | |
|-----------|-----------------|
| 期首元本額 | 44,230,155,430円 |
| 期中追加設定元本額 | 69,738,248,122円 |
| 期中一部解約元本額 | 26,551,495,327円 |

(当期末元本の内訳)

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| りそな・日経225オープン | 58,997,480,404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) | 5,963,596,030円 |
| アムンディ・日経平均オープン | 22,301,527,748円 |
| りそな・日経225オープンVA (適格機関投資家専用) | 154,304,043円 |

《お知らせ》

平成27年10月14日付で、信用リスク集中回避のための投資制限に関する条文の新設、及び条文整備のため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

◆損益の状況

当期 (自2015年7月14日 至2016年7月11日)

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,590,661,357円 |
| 受 取 配 当 金 | 1,591,314,800 |
| 受 取 利 息 | 317,357 |
| そ の 他 収 益 金 | 181,212 |
| 支 払 利 息 | △1,152,012 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △16,714,034,200 |
| 売 買 益 | 3,543,617,668 |
| 売 買 損 | △20,257,651,868 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △955,971,763 |
| 取 引 益 | 1,396,704,143 |
| 取 引 損 | △2,352,675,906 |
| (D) そ の 他 費 用 等 | △33,107 |
| (E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D) | △16,079,377,713 |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金 | 18,237,412,150 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 18,117,162,374 |
| (H) 解 約 差 損 益 金 | △9,304,141,933 |
| (I) 計 (E + F + G + H) | 10,971,054,878 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (I) | 10,971,054,878 |

(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。