

■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18期（決算日 2017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
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
18期(2017年7月11日)	12,715	0	29.9	20,195.48	28.6	96.5	3.5	30,114

(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	%	%	%
2016年7月11日	9,786	—	15,708.82	—	93.6	6.4
7月末	10,320	5.5	16,569.27	5.5	96.7	3.3
8月末	10,516	7.5	16,887.40	7.5	97.0	2.9
9月末	10,308	5.3	16,449.84	4.7	94.0	5.9
10月末	10,911	11.5	17,425.02	10.9	95.1	4.9
11月末	11,458	17.1	18,308.48	16.5	95.5	4.5
12月末	11,973	22.3	19,114.37	21.7	97.2	2.7
2017年1月末	11,919	21.8	19,041.34	21.2	97.8	2.2
2月末	11,970	22.3	19,118.99	21.7	96.2	3.7
3月末	11,913	21.7	18,909.26	20.4	97.1	2.8
4月末	12,087	23.5	19,196.74	22.2	96.2	3.7
5月末	12,368	26.4	19,650.57	25.1	98.3	1.6
6月末	12,615	28.9	20,033.43	27.5	97.5	2.5
(期末)						
2017年7月11日	12,715	29.9	20,195.48	28.6	96.5	3.5

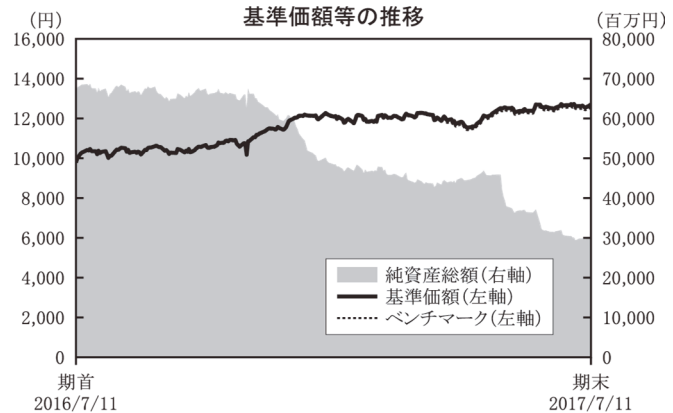
(注1) 騰落率は期首比です。

(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18期首	9,786円
第18期末	12,715円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	29.9%



(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、2016年7月11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】

上昇要因

- ① 世界景気不安の後退による米ドル高・円安進行 (期初から2016年8月)
- ② 日銀による新しい金融調節の枠組を受けて、恩恵の大きい金融株などが買われたこと (2016年9月)
- ③ トランプ米国大統領が選挙で公約した景気刺激策への期待とそれに伴う米ドル高・円安進行 (2016年11月から12月)
- ④ フランス大統領選挙において中道のマクロン氏が勝利し、政治リスクへの警戒感が後退したこと (2017年4月中旬から6月上旬)

下落要因

- ① 米国大統領選挙において、外交政策などに懸念のあるトランプ候補が予想に反して勝利したこと (2016年11月9日)
- ② トランプ政権への期待が薄れたことによる米ドル安・円高進行 (2017年3月)

【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、日経平均株価に連動する投資成果を目標としております。運用に際しては、アムンディ・日経225オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象としております。当期においても、基

りそな・日経225オープン

本方針に基づきマザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

<アムンディ・日経225オープンマザーファンド>

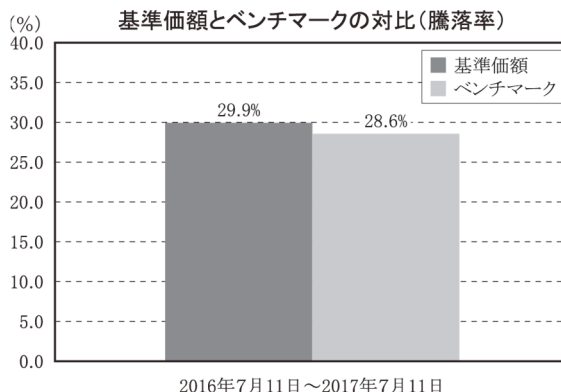
マザーファンドのポートフォリオにつきましては、アムンディ・日経225オープンマザーファンドの運用報告書（後述）をご覧ください。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+29.9%と、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（+28.6%）を1.3%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18期 (2016年7月12日 ～2017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)	93円 (37) (44) (12)	0.810% (0.324) (0.378) (0.108)	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种書類の送付、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)	1 (0) (0)	0.005 (0.001) (0.004)	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) (1) (1)	0.019 (0.007) (0.005) (0.007)	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	96	0.834	

期中の平均基準価額は11,529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 (2016年7月12日から2017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
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	千口 8,615,316	千円 11,213,478	千口 47,200,143	千円 64,135,415

(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	88,788,245千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	74,920,799千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.18

(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 (2016年7月12日から2017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
ユニ・ファミリーマートホールディングス	238	1,839,331	7,728	ファーストリテイリング	158	6,174,770	39,080
大塚ホールディングス	152	783,784	5,156	ソフトバンクグループ	474	3,728,193	7,865
ファーストリテイリング	14	489,900	34,992	ファナック	158	3,275,844	20,733
ヤマハ発動機	242	436,902	1,805	KDDI	948	2,872,757	3,030
ソフトバンクグループ	42	331,224	7,886	東京エレクトロン	158	1,884,857	11,929
ファナック	14	316,380	22,598	京セラ	316	1,864,682	5,900
楽天	228	296,724	1,301	ダイキン工業	158	1,686,896	10,676
KDDI	84	245,736	2,925	信越化学工業	158	1,433,260	9,071
京セラ	28	169,808	6,064	日東電工	158	1,350,624	8,548
東京エレクトロン	14	166,220	11,872	テルモ	316	1,323,179	4,187

(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 (2016年7月12日から2017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 (2017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	58,997,480	20,412,653	30,104,580

(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32,090,318千口です。

◆投資信託財産の構成 (2017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	30,104,580	99.1
コール・ローン等、その他	266,032	0.9
投資信託財産総額	30,370,612	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

(2017年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	30,370,612,866円
コール・ローン等	227,832,014
アムンディ・日経225オープンマザーファンド(評価額)	30,104,580,852
未 収 入 金	38,200,000
(B) 負 債	256,078,152
未 払 解 約 金	83,308,743
未 払 信 託 報 酬	166,489,999
未 払 利 息	561
そ の 他 未 払 費 用	6,278,849
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	30,114,534,714
元 本	23,684,451,389
次 期 繰 越 損 益 金	6,430,083,325
(D) 受 益 権 総 口 数	23,684,451,389口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,715円

(注記事項)

期首元本額

67,881,504,193円

期中追加設定元本額

18,284,216,603円

期中一部解約元本額

62,481,269,407円

◆損益の状況

当期(自2016年7月12日 至2017年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△100,847円
支 払 利 息	△100,847
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,762,808,218
売 買 益	12,037,783,104
売 買 損	△6,274,974,886
(C) 信 託 報 酬 等	△435,763,474
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	5,326,943,897
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,966,803,607
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,069,943,035
(配 当 等 相 当 額)	(11,490,546,467)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,420,603,432)
(G) 計 (D + E + F)	6,430,083,325
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	6,430,083,325
追 加 信 託 差 損 益 金	3,069,943,035
(配 当 等 相 当 額)	(11,525,789,358)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,455,846,323)
分 配 準 備 積 立 金	3,360,140,290

(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18期
	(2016年7月12日～2017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	6,285

(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28年10月12日付で、監査報酬の上限を設定するため、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18期

運用報告書

(決算日 2017年7月11日)
(計算期間：2016年7月12日～2017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 %			
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
18期 (2017年7月11日)	14,748	31.0	20,195.48	28.6	96.5	3.5	47,325

(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

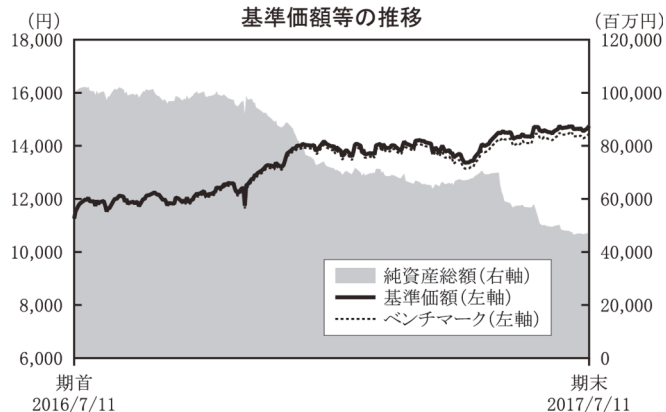
年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首) 2016年7月11日	11,255	—	15,708.82	—	93.6	6.4
7月末	11,875	5.5	16,569.27	5.5	96.7	3.3
8月末	12,109	7.6	16,887.40	7.5	97.1	2.9
9月末	11,878	5.5	16,449.84	4.7	94.0	5.9
10月末	12,582	11.8	17,425.02	10.9	95.1	4.9
11月末	13,222	17.5	18,308.48	16.5	95.5	4.5
12月末	13,826	22.8	19,114.37	21.7	97.3	2.7
2017年1月末	13,774	22.4	19,041.34	21.2	97.8	2.2
2月末	13,841	23.0	19,118.99	21.7	96.2	3.7
3月末	13,785	22.5	18,909.26	20.4	97.1	2.8
4月末	13,996	24.4	19,196.74	22.2	96.3	3.7
5月末	14,332	27.3	19,650.57	25.1	98.4	1.6
6月末	14,629	30.0	20,033.43	27.5	97.5	2.5
(期末) 2017年7月11日	14,748	31.0	20,195.48	28.6	96.5	3.5

(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18期首	11,255円
第18期末	14,748円
騰落率	31.0%



(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、2016年7月11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】

上昇要因

- ① 世界景気不安の後退による米ドル高・円安進行（期初から2016年8月）
- ② 日銀による新しい金融調節の枠組を受けて、恩恵の大きい金融株などが買われたこと（2016年9月）
- ③ トランプ米国大統領が選挙で公約した景気刺激策への期待とそれに伴う米ドル高・円安進行（2016年11月から12月）
- ④ フランス大統領選挙において中道のマクロン氏が勝利し、政治リスクへの警戒感が後退したこと（2017年4月中旬から6月上旬）

下落要因

- ① 米国大統領選挙において、外交政策などに懸念のあるトランプ候補が予想に反して勝利したこと（2016年11月9日）
- ② トランプ政権への期待が薄れたことによる米ドル安・円高進行（2017年3月）

【投資環境】

<国内株式市場>

当期の国内株式市場は、前期末から大きく反発し、日経平均株価で28.6%の上昇となりました。前期

末に英国の国民投票においてEU（欧州連合）離脱が選択されたことで株式市場は急落していましたが、その後の英国の景気が予想外に好調であったことや、米国やEUの堅調な経済指標に支えられて当期は期初から上昇基調で始まりました。世界景気不安の後退による米ドル高・円安進行も日本株の上昇を後押ししました。9月に日銀が新しい金融調節の枠組みを採用すると、株式市場は恩恵を受ける金融株主導で上げ幅を拡大しました。11月には円高でも予想ほど悪くない中間決算に安堵が広がっているなかで、米国大統領選挙において予想外となるトランプ候補が勝利し、株式市場はいったんは急落しました。しかし、トランプ氏が選挙で公約した景気刺激策を期待して株価は間髪を入れず持ち直し、年末にかけて118円台まで米ドル高・円安が進んだことも好感されて、株式市場は大幅続伸しました。2017年に入るとトランプ政権への期待が薄れ、円高への揺り戻しも加わって日本株は上げ渋る展開になりましたが、4月になると反EUのうねり加速が懸念されたフランス大統領選挙で中道のマクロン氏が勝利し、欧州への警戒感が後退して海外市場対比で出遅れていた日本株に大規模な買いが入りました。期末にかけては海外の主要中央銀行が金融政策正常化に動き出したとの思惑から内外金利が急騰し、利ざや改善が期待された金融株の買戻しが顕著となりました。

【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。期中の日経平均株価の構成銘柄の変更に対しても適切に銘柄の入替えや組入比率の調整を行いました。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。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額の騰落率は+31.0%と、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（+28.6%）を2.4%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：保有株式の受取配当金

マイナス要因：売買手数料など

【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18期 (2016年7月12日 ～2017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)	1円 (0) (0)	0.005% (0.001) (0.004)	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)	0.001 (0.001)	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	1	0.006	

期中の平均基準価額は13,320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 (2016年7月12日から2017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 3,579 (△2,099)	千円 10,048,935 (一)	千株 32,294	千円 78,739,309

(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 87,253	百万円 92,912	百万円 11,471	百万円 11,479

◆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	88,788,245千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	74,920,799千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.18

(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 (2016年7月12日から2017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
ユニ・ファミリーマートホールディングス	238	1,839,331	7,728	ファーストリテイリング	158	6,174,770	39,080
大塚ホールディングス	152	783,784	5,156	ソフトバンクグループ	474	3,728,193	7,865
ファーストリテイリング	14	489,900	34,992	ファナック	158	3,275,844	20,733
ヤマハ発動機	242	436,902	1,805	KDD I	948	2,872,757	3,030
ソフトバンクグループ	42	331,224	7,886	東京エレクトロン	158	1,884,857	11,929
ファナック	14	316,380	22,598	京セラ	316	1,864,682	5,900
楽天	228	296,724	1,301	ダイキン工業	158	1,686,896	10,676
KDD I	84	245,736	2,925	信越化学工業	158	1,433,260	9,071
京セラ	28	169,808	6,064	日東電工	158	1,350,624	8,548
東京エレクトロン	14	166,220	11,872	テルモ	316	1,323,179	4,187

(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 (2016年7月12日から2017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 (2017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	230	86	54,782
マルハニチロ	23	8.6	25,060
鉱業(0.1%)			
国際石油開発帝石	92	34.4	36,876
建設業(2.9%)			
コムシスホールディングス	230	86	199,090
大成建設	230	86	90,816
大林組	230	86	114,638
清水建設	230	86	103,802
長谷工コーポレーション	46	17.2	23,959
鹿島建設	230	86	84,710
大和ハウス工業	230	86	335,572
積水ハウス	230	86	171,140
日揮	230	86	155,918
千代田化工建設	230	86	55,642
食料品(5.1%)			
日清製粉グループ本社	230	86	155,230
明治ホールディングス	46	17.2	154,628
日本ハム	230	86	287,240
サッポロホールディングス	46	17.2	53,664
アサヒグループホールディングス	230	86	381,668
キリンホールディングス	230	86	203,433
宝ホールディングス	230	86	101,136
キッコーマン	230	86	307,450
味の素	230	86	206,271
ニチレイ	230	43	140,395
日本たばこ産業	230	86	333,164
繊維製品(0.3%)			
東洋紡	230	86	18,318
ユニチカ	230	86	7,138
帝人	230	17.2	38,235
東レ	230	86	83,239
パルプ・紙(0.3%)			
王子ホールディングス	230	86	50,138
日本製紙	23	8.6	19,315
北越紀州製紙	230	86	73,616
化学(9.1%)			
クラレ	230	86	186,190
旭化成	230	86	105,565
昭和電工	23	8.6	23,555
住友化学	230	86	56,158
日産化学工業	230	86	329,810
日本曹達	230	—	—
東ソー	230	86	106,382
トクヤマ	230	86	48,246

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デンカ	230	86	51,686
信越化学工業	230	86	862,150
三井化学	230	86	53,836
三菱ケミカルホールディングス	115	43	42,084
宇部興産	230	86	25,800
日本化薬	230	86	140,180
花王	230	86	572,846
富士フイルムホールディングス	230	86	356,298
資生堂	230	86	330,928
日東電工	230	86	844,004
医薬品(7.5%)			
協和発酵キリン	230	86	171,742
武田薬品工業	230	86	490,716
アステラス製薬	1,150	430	596,195
大日本住友製薬	230	86	131,924
塩野義製薬	230	86	515,570
中外製薬	230	86	374,100
エーザイ	230	86	524,170
第一三共	230	86	217,408
大塚ホールディングス	—	86	410,650
石油・石炭製品(0.3%)			
昭和シェル石油	230	86	95,460
JXTGホールディングス	230	86	42,277
ゴム製品(1.1%)			
横浜ゴム	115	43	100,018
ブリヂストン	230	86	421,572
ガラス・土石製品(1.6%)			
旭硝子	230	17.2	84,882
日本板硝子	230	8.6	8,488
日本電気硝子	345	25.8	105,135
住友大阪セメント	230	86	46,956
太平洋セメント	230	86	35,862
東海カーボン	230	86	56,760
TOTO	115	43	184,040
日本碍子	230	86	193,930
鉄鋼(0.2%)			
新日鐵住金	23	8.6	22,712
神戸製鋼所	230	8.6	10,535
ジェイエフイーホールディングス	23	8.6	17,535
日新製鋼	23	8.6	10,904
大平洋金属	230	86	25,284
非鉄金属(1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	230	86	24,166
三井金属鉱業	230	86	40,936
東邦亜鉛	230	86	40,334
三菱マテリアル	230	8.6	29,369

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
住友金属鉱山	230	86	131,279
DOWAホールディングス	230	86	75,250
古河機械金属	230	86	17,458
古河電気工業	230	8.6	43,774
住友電気工業	230	86	154,069
フジクラ	230	86	84,624
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	23	8.6	15,075
東洋製罐グループホールディングス	230	86	162,884
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	230	17.2	31,974
オークマ	230	86	91,418
アマダホールディングス	230	86	111,886
小松製作所	230	86	251,765
住友重機械工業	230	86	68,972
日立建機	230	86	248,196
クボタ	230	86	169,291
荏原製作所	230	17.2	57,190
ダイキン工業	230	86	1,011,790
日本精工	230	86	127,968
NTN	230	86	45,924
ジェイテクト	230	86	146,630
日立造船	46	17.2	9,632
三菱重工業	230	86	39,276
IHI	230	86	33,626
電気機器 (18.4%)			
日清紡ホールディングス	230	86	99,760
コニカミノルタ	230	86	82,818
ミネベアミツミ	230	86	159,100
日立製作所	230	86	61,240
東芝	230	86	21,577
三菱電機	230	86	143,878
富士電機	230	86	52,890
安川電機	230	86	209,238
明電舎	230	86	34,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	230	86	42,828
日本電気	230	86	25,542
富士通	230	86	72,007
沖電気工業	230	8.6	14,293
パナソニック	230	86	130,806
シャープ	230	—	—
ソニー	230	86	381,754
TDK	230	86	650,160
ミツミ電機	230	—	—
アルプス電気	230	86	279,500
パイオニア	230	86	18,834
横河電機	230	86	157,036
アドバンテスト	460	172	339,184
カシオ計算機	230	86	150,930

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファナック	230	86	1,926,400
京セラ	460	172	1,124,708
太陽誘電	230	86	157,638
SCREENホールディングス	230	17.2	133,472
キヤノン	345	129	486,201
リコー	230	86	84,452
東京エレクトロン	230	86	1,347,620
輸送用機器 (6.3%)			
デンソー	230	86	419,078
三井造船	230	86	13,846
川崎重工業	230	86	29,412
日産自動車	230	86	99,287
いすゞ自動車	115	43	60,931
トヨタ自動車	230	86	538,618
日野自動車	230	86	108,962
三菱自動車工業	23	8.6	6,346
マツダ	46	17.2	27,924
本田技研工業	460	172	533,888
スズキ	230	86	452,188
SUBARU	230	86	356,384
ヤマハ発動機	—	86	255,076
精密機器 (2.9%)			
テルモ	460	172	751,640
ニコン	230	86	160,390
オリンパス	230	86	360,340
シチズン時計	230	86	71,036
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	230	86	105,178
大日本印刷	230	86	109,134
ヤマハ	230	86	346,150
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	23	8.6	3,964
中部電力	23	8.6	12,513
関西電力	23	8.6	12,642
東京瓦斯	230	86	49,639
大阪瓦斯	230	86	38,433
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	230	86	52,288
東京急行電鉄	230	86	72,842
小田急電鉄	230	43	95,417
京王電鉄	230	86	80,152
京成電鉄	230	43	127,882
東日本旅客鉄道	23	8.6	93,611
西日本旅客鉄道	23	8.6	69,118
東海旅客鉄道	23	8.6	154,069
日本通運	230	86	60,716
ヤマトホールディングス	230	86	193,414
海運業 (0.2%)			
日本郵船	230	86	19,006

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	230	86	30,960
川崎汽船	230	86	24,166
空運業(0.1%)			
ANAホールディングス	230	86	33,540
倉庫・運輸関連業(0.3%)			
三菱倉庫	230	86	125,904
情報・通信業(12.2%)			
ヤフー	92	34.4	17,062
トレンドマイクロ	230	86	497,080
スカパーJ SATホールディングス	23	8.6	4,093
日本電信電話	46	17.2	91,246
KDDI	1,380	516	1,511,364
NTTドコモ	23	8.6	22,712
東宝	23	8.6	29,283
エヌ・ティ・ティ・データ	230	430	534,920
コナミホールディングス	230	86	528,900
ソフトバンクグループ	690	258	2,349,348
卸売業(2.1%)			
双日	23	8.6	2,408
伊藤忠商事	230	86	148,952
丸紅	230	86	63,760
豊田通商	230	86	292,400
三井物産	230	86	138,374
住友商事	230	86	128,785
三菱商事	230	86	204,508
小売業(10.1%)			
J.フロントリテイリング	115	43	70,563
三越伊勢丹ホールディングス	230	86	95,718
セブン&アイ・ホールディングス	230	86	389,408
ユニ・ファミリーマートホールディングス	—	86	548,680
高島屋	230	86	88,150
丸井グループ	230	86	135,622
イオン	230	86	147,791
ユニグループ・ホールディングス	230	—	—
ファーストリテイリング	230	86	3,162,220
銀行業(1.0%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	230	86	49,716
新生銀行	230	86	16,512
あおぞら銀行	230	86	37,668
三菱UFJフィナンシャル・グループ	230	86	64,620
りそなホールディングス	23	8.6	5,179
三井住友トラスト・ホールディングス	230	8.6	34,632
三井住友フィナンシャルグループ	23	8.6	37,650
千葉銀行	230	86	71,810
ふくおかフィナンシャルグループ	230	86	46,698
静岡銀行	230	86	89,440
みずほフィナンシャルグループ	230	86	17,630
証券、商品先物取引業(0.4%)			
大和証券グループ本社	230	86	57,869

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	230	86	57,602	
松井証券	230	86	80,754	
保険業(1.1%)				
SOMPOホールディングス	57.5	21.5	95,460	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	69	25.8	100,362	
ソニーフィナンシャルホールディングス	46	17.2	34,726	
第一生命ホールディングス	23	8.6	17,780	
東京海上ホールディングス	115	43	206,701	
T&Dホールディングス	46	17.2	29,781	
その他金融業(0.4%)				
クレディセゾン	230	86	189,200	
不動産業(1.8%)				
東急不動産ホールディングス	230	86	56,760	
三井不動産	230	86	223,256	
三菱地所	230	86	175,913	
東京建物	115	43	62,436	
住友不動産	230	86	295,324	
サービス業(3.1%)				
ディー・エヌ・エー	69	25.8	68,086	
電通	230	86	450,640	
楽天	—	86	114,208	
東京ドーム	230	43	44,806	
セコム	230	86	737,364	
合計	株数・金額	48,035	17,221	45,679,882
	銘柄数<比率>	225	225	<96.5%>

(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) ー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	1,634	—

(注) 単位未満は切捨てです。

◆投資信託財産の構成 (2017年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	45,679,882	96.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,706,840	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	47,386,722	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

(2017年7月11日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	47,386,722,825円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,585,168,618
株 式 (評価額)	45,679,882,980
未 収 入 金	13,442,687
未 収 配 当 金	60,456,000
差 入 委 託 証 拠 金	47,772,540
(B) 負 債	61,373,907
未 払 解 約 金	61,370,000
未 払 利 息	3,907
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	47,325,348,918
元 本	32,090,318,087
次 期 繰 越 損 益 金	15,235,030,831
(D) 受 益 権 総 口 数	32,090,318,087口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	14,748円

(注記事項)

期首元本額	87,416,908,225円
期中追加設定元本額	11,783,344,375円
期中一部解約元本額	67,109,934,513円

(当期末元本の内訳)

りそな・日経225オープン	20,412,653,141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)	5,390,170,927円
アムンディ・日経平均オープン	6,161,188,770円
りそな・日経225オープンVA (適格機関投資家専用)	126,305,249円

◆損益の状況

当期 (自2016年7月12日 至2017年7月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,410,346,018円
受 取 配 当 金	1,412,540,228
受 取 利 息	48
そ の 他 収 益 金	131,798
支 払 利 息	△2,326,056
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	22,256,118,308
売 買 益	23,936,532,364
売 買 損	△1,680,414,056
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,016,882,419
取 引 益	1,271,784,698
取 引 損	△254,902,279
(D) そ の 他 費 用 等	△813,030
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	24,682,533,715
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	10,971,054,878
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,656,703,625
(H) 解 約 差 損 益 金	△24,075,261,387
(I) 計 (E + F + G + H)	15,235,030,831
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	15,235,030,831

(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。