

■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	2010年12月28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	アムンディ・日経平均オープン	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	アムンディ・日経平均オープン	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9月10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（評価益を含みます。）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。	

アムンディ・日経平均オープン

運用報告書（全体版）

第5期（決算日 2015年9月10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>

アムンディ・日経平均オープン

◆設定以来の運用実績

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			
(設定日) 2010年12月28日	円 10,000	円 —	% —	円 (2010年12月27日) 10,355.99	% —	% —	% —	百万円 93
1期(2011年9月12日)	8,361	0	△16.4	8,535.67	△17.6	95.7	4.3	4,707
2期(2012年9月10日)	8,827	0	5.6	8,869.37	3.9	96.1	3.9	9,417
3期(2013年9月10日)	14,564	0	65.0	14,423.36	62.6	96.2	3.7	16,347
4期(2014年9月10日)	16,107	0	10.6	15,788.78	9.5	96.1	3.8	19,687
5期(2015年9月10日)	18,908	0	17.4	18,299.62	15.9	95.3	4.7	17,180

(注1) 設定日の基準価額は設定時の価額(10,000円)、純資産総額は設定元本を表示しております。

(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。

(注4) 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、その他一切の権利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おります。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) 2014年9月10日	円 16,107	% —	円 15,788.78	% —	% 96.1	% 3.8
9月末	16,586	3.0	16,173.52	2.4	94.9	5.0
10月末	16,821	4.4	16,413.76	4.0	94.9	5.0
11月末	17,905	11.2	17,459.85	10.6	93.9	6.0
12月末	17,913	11.2	17,450.77	10.5	97.8	2.1
2015年1月末	18,131	12.6	17,674.39	11.9	96.4	3.5
2月末	19,281	19.7	18,797.94	19.1	95.4	4.5
3月末	19,806	23.0	19,206.99	21.6	93.6	6.3
4月末	20,140	25.0	19,520.01	23.6	95.4	4.5
5月末	21,227	31.8	20,563.15	30.2	96.4	3.6
6月末	20,888	29.7	20,235.73	28.2	91.4	8.5
7月末	21,234	31.8	20,585.24	30.4	92.5	7.4
8月末	19,520	21.2	18,890.48	19.6	94.0	6.0
(期末) 2015年9月10日	円 18,908	% 17.4	円 18,299.62	% 15.9	% 95.3	% 4.7

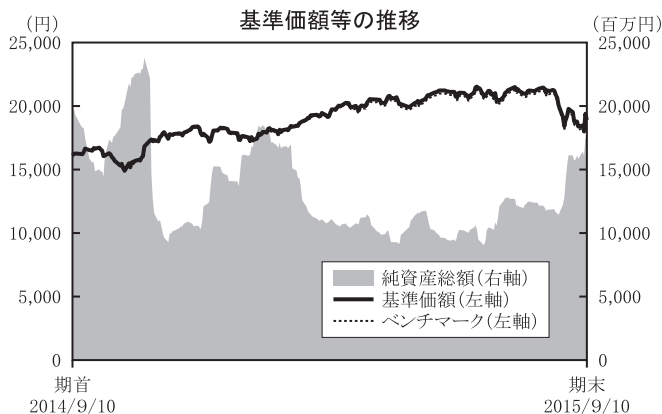
(注1) 騰落率は期首比です。

(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5期首	16,107円
第5期末	18,908円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	17.4%



(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、2014年9月10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 日銀の予想外の追加金融緩和策や政府の成長戦略への期待感の高まりなど (2014年11月から2015年6月下旬まで)

下落要因

① ユーロ圏や中国景気への懸念の高まり (2014年10月)

② 中国景気低迷の余波がアジア諸国や資源国に拡散し世界的な株安となったこと (2015年8月中旬以降)

【投資環境】

<国内株式市場>

国内株式市場は期初からドル高・円安進行、企業の積極的な株主還元姿勢、さらには法人実効税率引き下げを含む成長戦略を評価して好調なスタートを切りました。ところが10月に入ると、消費税増税の反動が厳しいことが認識され、海外ではユーロ圏や中国景気への不安とともに、同月に終了するFRB (米連邦準備理事会) の資産購入による悪影響への警戒感がにわかに高まり、世界株安進行から国内株式市場も5ヵ月ぶりの安値水準まで調整しました。その後、GPIF (年金積立金管理運用独立行政法人) の株式運用比率大幅引き上げ観測報道を手掛かりに市場は下落を埋める展開となり、10月29日にFRBが予定通り資産購入終了を決定するとドル高・円安の流れが強まり、31日には日銀が予想外の追加金融緩和を決定したことで急速に円安が進行し、株価はそれまでの下落を一気に埋め切りました。さらに消費税率再引き上げの先延ばし決定、衆院選での与党圧勝、円安・中小企業対策策定、法人税率下げ幅拡大が株価を一段と押し上げました。新年になると原油急落の負の側面を嫌った世界株安が加速し、円高方向への揺り戻しもあってしばらく調整地合いとなりました。しかしECB (欧州中央銀行) の国債購入による量的緩和決定、円安・原油安による日本企業の業績上方修正期待、国家公務員共済組合連合会の国内株式投資比率引き上げ報道、増配や自社株買いによる株主重視姿勢強化など好材料が相次いだことから、外国人投資家の旺盛な買いに支えられて世界の主要市場を上回る上昇を記録しました。ただ2015年6月にはギリシャの債務不履行懸念と中国株急落が大きく市場を崩しましたが、最終的に前者は追加支援継続協議がなされ、後者はあらゆる手を尽くした株価下支え策が奏功したため、市場はすぐに反発しました。しかしながら8月に入り、中国が人民元を突如切り下げたことから、中国景気低迷の余波がアジア諸国や資源国へ拡散して世界同時株安となり、国内株式市場は急落商状で期末を迎えました。

【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

アムンディ・日経平均オープン

に連動する投資成果を目標としております。当期におきましても、基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>

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。定期見直しによる銘柄の入れ替えはありませんでした。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ってまいりました。

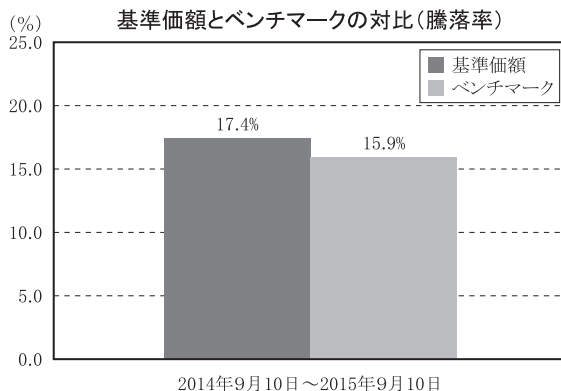
株式組入比率は、期首より日経平均株価との連動性を維持するため、株式先物を利用することにより出来る限り高位を保ちました。

【ベンチマークとの差異】

当期の基準価額は、ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率（+15.9%）を1.5%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。

上昇要因：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

下落要因：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>

運用の基本方針に基づき、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>

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 5 期 (2014/9/11~2015/9/10)		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 (41) (42) (6)	0.464% (0.215) (0.217) (0.032)	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 (先物オプション)	2 (2)	0.008 (0.008)	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 刷) (そ の 他)	5 (2) (2) (1)	0.027 (0.010) (0.011) (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 印刷会社に支払うファンドに係る費用 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	0.499	

期中の平均基準価額は19,121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 (2014年9月11日から2015年9月10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	千円	千口	千円
	28,583,435	34,832,230	33,271,083	41,015,590

(注) 単位未満は切捨てです。

アムンディ・日経平均オープン

◆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・日経平均オープン	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	－千円	211,833,592千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	－千円	58,038,570千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	－	3.64

(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。

◆利害関係人との取引状況等 (2014年9月11日から2015年9月10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

親投資信託残高

銘 柄	期首 (前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	千口 18,009,265	千口 13,321,617	千円 17,174,228

(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59,925,854千口です。

◆投資信託財産の構成

(2015年9月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
アムンディ・日経225オープンマザーファンド	千円 17,174,228	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	79,758	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	17,253,986	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

(2015年9月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	17,253,986,215円
コール・ローン等	79,757,356
アムンディ・日経225オープン マザーファンド（評価額）	17,174,228,838
未 収 利 息	21
(B) 負 債	73,667,624
未 払 解 約 金	45,011,625
未 払 信 託 報 酬	26,385,291
そ の 他 未 払 費 用	2,270,708
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	17,180,318,591
元 本	9,086,438,301
次 期 繰 越 損 益 金	8,093,880,290
(D) 受 益 権 総 口 数	9,086,438,301口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	18,908円

(注記事項)

期首元本額	12,223,054,465円
期中追加設定元本額	23,444,483,853円
期中一部解約元本額	26,581,100,017円

◆損益の状況

当期（自2014年9月11日 至2015年9月10日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,755円
受 取 利 息	3,755
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△284,620,057
売 買 損 益	1,213,597,087
売 買 損 益	△1,498,217,144
(C) 信 託 報 酬 等	△65,247,298
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△349,863,600
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	34,168,435
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,409,575,455
(配 当 等 相 当 額)	(1,841,351,706)
(売 買 損 益 相 当 額)	(6,568,223,749)
(G) 計 (D + E + F)	8,093,880,290
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	8,093,880,290
追 加 信 託 差 損 益 金	8,409,575,455
(配 当 等 相 当 額)	(1,864,807,279)
(売 買 損 益 相 当 額)	(6,544,768,176)
分 配 準 備 積 立 金	167,953,739
繰 越 損 益 金	△483,648,904

(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。

課税上の取扱いについて

<平成26年1月1日以降>

普通分配金並びに解約時または償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）の税率が適用されます。

※法人の受益者の場合、税率が異なります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。

※税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第5期
	(2014年9月11日～2015年9月10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	8,907

(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26年12月1日付で、改正投資信託法の施行に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。
- ・平成27年6月10日付で、信託事務の諸費用の内容を明記するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

＜補足情報＞

「アムンディ・日経225オープンマザーファンド」の決算日（2015年7月13日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、以下2015年9月10日現在における「アムンディ・日経225オープンマザーファンド」の補足情報を掲載しております。

◆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（2014年9月11日から2015年9月10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	210	9,515,930	45,313	ファーストリテイリング	262	11,269,659	43,013
ソフトバンクグループ	630	4,471,062	7,096	ソフトバンクグループ	786	6,094,207	7,753
ファナック	210	4,310,630	20,526	ファナック	262	5,588,153	21,328
KDD I	828	3,315,380	4,004	KDD I	692	4,007,752	5,791
京セラ	420	2,330,222	5,548	京セラ	524	2,926,631	5,585
アステラス製薬	1,050	1,797,315	1,711	アステラス製薬	1,310	2,340,848	1,786
ダイキン工業	210	1,542,362	7,344	東京エレクトロン	262	2,022,693	7,720
本田技研工業	420	1,538,270	3,662	本田技研工業	524	1,983,240	3,784
TDK	210	1,522,780	7,251	ダイキン工業	262	1,963,562	7,494
日東電工	210	1,519,148	7,234	信越化学工業	262	1,963,133	7,492

（注）金額は受渡し代金です。

◆組入資産の明細

（1）国内株式

銘 柄	2014年9月10日現在	2015年9月10日現在	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
日本水産	210	158	57,986
マルハニチロ	21	15.8	26,717
鉱業(0.1%)			
国際石油開発帝石	84	63.2	72,522
建設業(2.7%)			
コムシスホールディングス	210	158	236,842
大成建設	210	158	125,452
大林組	210	158	160,528
清水建設	210	158	175,538
鹿島建設	210	158	103,174
大和ハウス工業	210	158	463,888
積水ハウス	210	158	278,396
日揮	210	158	280,450
千代田化工建設	210	158	139,040
食料品(4.9%)			
日清製粉グループ本社	210	158	241,898

銘 柄	2014年9月10日現在	2015年9月10日現在	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治ホールディングス	21	15.8	268,284
日本ハム	210	158	411,748
サッポロホールディングス	210	158	70,468
アサヒグループホールディングス	210	158	571,723
麒麟ホールディングス	210	158	258,646
宝ホールディングス	210	158	118,026
キッコーマン	210	158	519,820
味の素	210	158	387,811
ニチレイ	210	158	105,702
日本たばこ産業	210	158	653,804
繊維製品(0.7%)			
東洋紡	210	158	26,544
ユニチカ	210	158	10,112
日清紡ホールディングス	210	158	231,154
帝人	210	158	59,250
東レ	210	158	164,083
パルプ・紙(0.3%)			

アムンディ・日経225オープンマザーファンド

銘柄	2014年9月10日現在	2015年9月10日現在	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
王子ホールディングス	210	158	90,692
日本製紙	21	15.8	33,306
北越紀州製紙	210	158	112,970
化学(7.8%)			
クラレ	210	158	228,784
旭化成	210	158	144,538
昭和電工	210	158	21,962
住友化学	210	158	96,064
日産化学工業	210	158	430,076
日本曹達	210	158	113,444
東ソー	210	158	93,536
トクヤマ	210	158	32,074
電気化学工業	210	158	77,736
信越化学工業	210	158	1,005,354
三井化学	210	158	63,042
三菱ケミカルホールディングス	105	79	52,076
宇部興産	210	158	34,286
日本化薬	210	158	215,038
花王	210	158	814,174
富士フイルムホールディングス	210	158	752,712
資生堂	210	158	372,801
日東電工	210	158	1,200,484
医薬品(7.8%)			
協和発酵キリン	210	158	296,250
武田薬品工業	210	158	911,976
アステラス製薬	1,050	790	1,340,630
大日本住友製薬	210	158	210,772
塩野義製薬	210	158	748,920
中外製薬	210	158	656,490
エーザイ	210	158	1,245,514
第一三共	210	158	348,548
石油・石炭製品(0.3%)			
昭和シェル石油	210	158	156,736
JXホールディングス	210	158	72,490
ゴム製品(1.1%)			
横浜ゴム	210	79	169,297
ブリヂストン	210	158	655,068
ガラス・土石製品(1.6%)			
日東紡績	210	158	64,938
旭硝子	210	158	116,446
日本板硝子	210	158	17,380
日本電気硝子	315	237	142,674

銘柄	2014年9月10日現在	2015年9月10日現在	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友大阪セメント	210	158	74,734
太平洋セメント	210	158	62,094
東海カーボン	210	158	47,716
TOTO	210	158	267,652
日本碍子	210	158	402,900
鉄鋼(0.2%)			
新日鐵住金	210	158	39,120
神戸製鋼所	210	158	25,122
ジェイ エフ イー ホールディングス	21	15.8	29,514
日新製鋼	21	15.8	18,233
大平洋金属	210	158	48,664
非鉄金属(1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	210	158	29,072
三井金属鉱業	210	158	39,184
東邦亜鉛	210	158	48,980
三菱マテリアル	210	158	63,042
住友金属鉱山	210	158	236,684
DOWAホールディングス	210	158	156,736
古河機械金属	210	158	42,186
古河電気工業	210	158	31,916
住友電気工業	210	158	266,704
フジクラ	210	158	94,168
金属製品(0.5%)			
SUMCO	21	15.8	17,964
東洋製罐グループホールディングス	210	158	313,788
機械(4.5%)			
日本製鋼所	210	158	63,042
オークマ	210	158	143,306
アマダホールディングス	210	158	163,688
小松製作所	210	158	320,977
住友重機械工業	210	158	85,636
日立建機	210	158	293,090
クボタ	210	158	290,404
荏原製作所	210	158	76,156
ダイキン工業	210	158	1,108,212
日本精工	210	158	215,038
NTN	210	158	90,850
ジェイテクト	210	158	271,602
日立造船	42	31.6	20,666
三菱重工業	210	158	90,628
IHI	210	158	55,458
電気機器(16.8%)			

銘柄	2014年9月10日現在		2015年9月10日現在	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
コニカミノルタ	210	158	206,190	
ミネベア	210	158	231,628	
日立製作所	210	158	100,282	
東芝	210	158	52,456	
三菱電機	210	158	189,284	
富士電機	210	158	75,840	
安川電機	210	158	207,612	
明電舎	210	158	63,042	
ジェス・ユアサ コーポレーション	210	158	70,468	
日本電気	210	158	60,672	
富士通	210	158	91,987	
沖電気工業	210	158	31,442	
パナソニック	210	158	204,215	
シャープ	210	158	26,860	
ソニー	210	158	495,014	
TDK	210	158	1,158,140	
ミツミ電機	210	158	107,440	
アルプス電気	210	158	568,800	
パイオニア	210	158	40,764	
横河電機	210	158	215,038	
アドバンテスト	420	316	296,092	
カシオ計算機	210	158	350,918	
ファナック	210	158	3,229,520	
京セラ	420	316	1,900,108	
太陽誘電	210	158	229,732	
SCREENホールディングス	210	158	101,120	
キャノン	315	237	874,530	
リコー	210	158	198,527	
東京エレクトロン	210	158	1,022,734	
輸送用機器 (7.0%)				
デンソー	210	158	883,220	
三井造船	210	158	29,862	
川崎重工業	210	158	71,732	
日産自動車	210	158	176,960	
いすゞ自動車	210	79	103,924	
トヨタ自動車	210	158	1,133,650	
日野自動車	210	158	207,612	
三菱自動車工業	21	15.8	15,199	
マツダ	42	31.6	61,272	
本田技研工業	420	316	1,182,630	
スズキ	210	158	605,535	
富士重工業	210	158	677,662	

銘柄	2014年9月10日現在		2015年9月10日現在	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
精密機器 (2.8%)				
テルモ	420	316	1,028,580	
ニコン	210	158	242,056	
オリンパス	210	158	661,230	
シチズンホールディングス	210	158	136,354	
その他製品 (1.0%)				
凸版印刷	210	158	156,736	
大日本印刷	210	158	191,970	
ヤマハ	210	158	420,596	
電気・ガス業 (0.3%)				
東京電力	21	15.8	13,066	
中部電力	21	15.8	28,937	
関西電力	21	15.8	22,601	
東京瓦斯	210	158	99,287	
大阪瓦斯	210	158	74,181	
陸運業 (2.4%)				
東武鉄道	210	158	83,108	
東京急行電鉄	210	158	135,090	
小田急電鉄	210	158	171,272	
京王電鉄	210	158	135,880	
京成電鉄	210	158	199,712	
東日本旅客鉄道	21	15.8	161,081	
西日本旅客鉄道	21	15.8	119,985	
東海旅客鉄道	21	15.8	303,202	
日本通運	210	158	95,748	
ヤマトホールディングス	210	158	370,431	
海運業 (0.2%)				
日本郵船	210	158	49,296	
商船三井	210	158	53,562	
川崎汽船	210	158	43,608	
空運業 (0.1%)				
ANAホールディングス	210	158	54,446	
倉庫・運輸関連業 (0.3%)				
三菱倉庫	210	158	246,480	
情報・通信業 (11.2%)				
ヤフー	84	63.2	31,157	
トレンドマイクロ	210	158	670,710	
スカパーJ SATホールディングス	21	15.8	8,611	
日本電信電話	21	31.6	145,928	
KDDI	420	948	2,878,128	
NTTドコモ	21	15.8	39,152	
東宝	21	15.8	42,849	

アムンディ・日経225オープンマザーファンド

銘柄	2014年9月10日現在		2015年9月10日現在	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
エヌ・ティ・ティ・データ	210	158	875,320	
コナミ	210	158	410,326	
ソフトバンクグループ	630	474	3,107,070	
卸売業(2.2%)				
双日	21	15.8	3,934	
伊藤忠商事	210	158	226,493	
丸紅	210	158	104,596	
豊田通商	210	158	449,036	
三井物産	210	158	248,376	
住友商事	210	158	205,400	
三菱商事	210	158	348,548	
小売業(12.7%)				
J.フロント リテイリング	105	79	139,672	
三越伊勢丹ホールディングス	210	158	281,556	
セブン&アイ・ホールディングス	210	158	775,543	
高島屋	210	158	149,942	
丸井グループ	210	158	215,354	
イオン	210	158	272,787	
ユニークグループ・ホールディングス	210	158	112,022	
ファーストリテイリング	210	158	7,414,150	
銀行業(1.3%)				
新生銀行	210	158	40,290	
あおぞら銀行	210	158	67,782	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	210	158	120,569	
りそなホールディングス	21	15.8	9,429	
三井住友トラスト・ホールディングス	210	158	75,271	
三井住友フィナンシャルグループ	21	15.8	74,868	
千葉銀行	210	158	137,144	
横浜銀行	210	158	117,030	
ふくおかフィナンシャルグループ	210	158	92,114	
静岡銀行	210	158	202,556	
みずほフィナンシャルグループ	210	158	37,367	
証券、商品先物取引業(0.6%)				
大和証券グループ本社	210	158	129,212	
野村ホールディングス	210	158	118,484	
松井証券	210	158	165,900	
保険業(1.1%)				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	52.5	39.5	151,166	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	63	47.4	170,782	
ソニーフィナンシャルホールディングス	42	31.6	68,319	
第一生命保険	21	15.8	32,074	
東京海上ホールディングス	105	79	366,639	

銘柄	2014年9月10日現在		2015年9月10日現在	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
T&Dホールディングス	42	31.6	49,217	
その他金融業(0.5%)				
クレディセゾン	210	158	357,870	
不動産業(2.4%)				
東急不動産ホールディングス	210	158	129,244	
三井不動産	210	158	513,974	
三菱地所	210	158	391,840	
平和不動産	42	31.6	40,005	
東京建物	210	79	113,523	
住友不動産	210	158	611,618	
サービス業(3.1%)				
電通	210	158	979,600	
東京ドーム	210	158	79,000	
セコム	210	158	1,199,536	
合計	株数・金額	44,089	33,582	73,651,120
	銘柄数<比率>	225	225	<95.3%>

(注1) 銘柄欄の()内は、2015年9月10日現在の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、マザーファンドの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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	2015年9月10日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経225	3,593	—

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) ー印は組入れなしです。

アムンディ・日経225オープンマザーファンド 第16期

運用報告書

(決算日 2015年7月13日)
(計算期間：2014年7月12日～2015年7月13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	騰落率	円	騰落率			
12期 (2011年7月11日)	6,587	7.5	10,069.53	5.5	97.4	2.6	53,065
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

(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

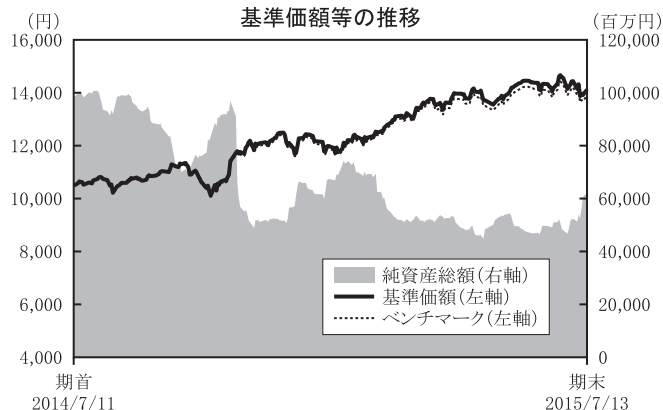
年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2014年7月11日	10,487	—	15,164.04	—	95.9	4.4
7月末	10,803	3.0	15,620.77	3.0	97.0	3.0
8月末	10,675	1.8	15,424.59	1.7	94.7	5.3
9月末	11,256	7.3	16,173.52	6.7	95.0	5.0
10月末	11,420	8.9	16,413.76	8.2	95.0	5.0
11月末	12,161	16.0	17,459.85	15.1	93.9	6.0
12月末	12,172	16.1	17,450.77	15.1	97.9	2.1
2015年1月末	12,325	17.5	17,674.39	16.6	96.5	3.5
2月末	13,112	25.0	18,797.94	24.0	95.5	4.5
3月末	13,475	28.5	19,206.99	26.7	93.6	6.3
4月末	13,708	30.7	19,520.01	28.7	95.4	4.5
5月末	14,454	37.8	20,563.15	35.6	96.4	3.6
6月末	14,229	35.7	20,235.73	33.4	91.5	8.5
(期末) 2015年7月13日	14,123	34.7	20,089.77	32.5	90.1	9.8

(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16期首	10,487円
第16期末	14,123円
騰落率	34.7%



(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、2014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 円安進展による業績改善期待 (2014年9月まで)
- ② 日銀の予想外の追加金融緩和策や政府の成長戦略への期待感の高まりなど (2014年11月以降)

下落要因

- ① ユーロ圏や中国景気への懸念の高まり (2014年10月)

【投資環境】

<国内株式市場>

国内株式市場は期初から買い優勢で始まりました。消費税増税後の景気不安が和らぎ、また株主還元積極姿勢を見せる企業が相次いだこと、さらには成長戦略に法人実効税率引き下げが盛り込まれたことが買い材料として評価されました。2014年8月下旬からはドル高・円安が市場を一段高に導きました。ところが10月に入ると、消費税増税の反動が厳しいことが認識され、海外ではユーロ圏や中国景気への不安とともに、同月に終了するFRB (米連邦準備理事会) の資産購入による悪影響への警戒感がにわかに高まり、世界株安進行から国内株式市場も5ヵ月ぶりの安値水準まで調整しました。その後、GPIF (年金積立金管理運用独立行政法人) の株式運用比率大幅引き上げ観測報道を手掛かりに市場は下落を埋める展開となり、10月29日にFRBが予定通り資産購入終了を決定するとドル高・円安の流れが強まり、31日には日銀が予想外の追加金融緩和を決定したことで急速に円安が進行し、株価はそれまでの下落を一気に埋め切りました。さらに消費税率再引き上げの先延ばし決定、衆院選での与党圧勝、

円安・中小企業対策策定、法人税率下げ幅拡大が株価を一段と押し上げました。新年になると原油急落の負の側面を嫌った世界株安が加速し、円高方向への揺り戻しもあってしばらく調整地合いとなりました。しかしECB（欧州中央銀行）の国債購入による量的緩和決定、円安・原油安による日本企業の業績上方修正期待、国家公務員共済組合連合会の国内株式投資比率引き上げ報道、増配や自社株買いによる株主重視姿勢強化など好材料が相次いだことから、外国人投資家の旺盛な買いに支えられて世界の主要市場を上回る上昇を記録しました。ただ2015年6月にはギリシャの債務不履行懸念と中国株急落が大きく市場を崩しましたが、最終的に前者は追加支援継続協議がなされ、後者はあらゆる手を尽くした株価下支え策が奏功したため、市場は反発地合いで期末を迎えました。

【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。定期見直しによる銘柄の入れ替えはありませんでした。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ってまいりました。

株式組入比率は、期首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 16 期 (2014/7/12~2015/7/13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	1円 (1)	0.008% (0.008)	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
合 計	1	0.008	

期中の平均基準価額は12,482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 (2014年7月12日から2015年7月13日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 35,788 (△58)	千円 73,843,577 (-)	千株 63,894	千円 133,739,109

(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	株 式 先 物 取 引	百万円 142,050	百万円 141,587	百万円 29,765	百万円 29,950

◆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	207,582,686千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	62,474,983千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	3.32

(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 (2014年7月12日から2015年7月13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	170	7,273,760	42,786	ファーストリテイリング	304	12,542,289	41,257
ソフトバンクグループ	510	3,627,630	7,113	ソフトバンクグループ	912	7,040,155	7,719
ファナック	170	3,500,150	20,589	ファナック	304	6,319,473	20,787
KDD I	532	2,498,696	4,696	KDD I	752	4,479,838	5,957
京セラ	340	1,829,216	5,380	京セラ	608	3,326,345	5,470
アステラス製薬	850	1,416,390	1,666	アステラス製薬	1,520	2,641,108	1,737
東京エレクトロン	170	1,254,438	7,379	東京エレクトロン	304	2,318,737	7,627
ダイキン工業	170	1,247,206	7,336	本田技研工業	608	2,277,140	3,745
本田技研工業	340	1,230,798	3,619	ダイキン工業	304	2,254,162	7,415
信越化学工業	170	1,226,256	7,213	信越化学工業	304	2,233,711	7,347

(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 (2014年7月12日から2015年7月13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

(1) 国内株式

(2015年7月13日現在)

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	244	110	40,260
マルハニチロ	24.4	11	23,683
鉱業(0.1%)			
国際石油開発帝石	97.6	44	58,872
建設業(2.6%)			
コムシスホールディングス	244	110	201,850
大成建設	244	110	79,640
大林組	244	110	104,390
清水建設	244	110	116,270
鹿島建設	244	110	66,660
大和ハウス工業	244	110	323,785
積水ハウス	244	110	209,605
日揮	244	110	244,750
千代田化工建設	244	110	117,260
食料品(5.0%)			
日清製粉グループ本社	244	110	186,120
明治ホールディングス	24.4	11	180,840
日本ハム	244	110	326,700
サッポロホールディングス	244	110	50,710
アサヒグループホールディングス	244	110	429,165
キリンホールディングス	244	110	190,520
宝ホールディングス	244	110	110,110
キッコーマン	244	110	454,850
味の素	244	110	304,480
ニチレイ	244	110	101,860
日本たばこ産業	244	110	482,130
繊維製品(0.6%)			
東洋紡	244	110	20,240
ユニチカ	244	110	6,270
日清紡ホールディングス	244	110	148,170
帝人	244	110	50,930
東レ	244	110	107,811
パルプ・紙(0.3%)			
王子ホールディングス	244	110	56,980
日本製紙	24.4	11	23,078
北越紀州製紙	244	110	75,900
化学(8.0%)			
クラレ	244	110	159,280
旭化成	244	110	102,696
昭和電工	244	110	16,720
住友化学	244	110	75,460
日産化学工業	244	110	308,330
日本曹達	244	110	83,380
東ソー	244	110	70,290

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	244	110	24,420
電気化学工業	244	110	56,210
信越化学工業	244	110	811,250
三井化学	244	110	46,750
三菱ケミカルホールディングス	122	55	41,096
宇部興産	244	110	24,090
日本化薬	244	110	140,250
花王	244	110	661,760
富士フイルムホールディングス	244	110	482,075
資生堂	244	110	308,990
日東電工	244	110	1,062,490
医薬品(7.5%)			
協和発酵キリン	244	110	187,880
武田薬品工業	244	110	666,380
アステラス製薬	1,220	550	998,525
大日本住友製薬	244	110	153,340
塩野義製薬	244	110	552,200
中外製薬	244	110	487,300
エーザイ	244	110	894,300
第一三共	244	110	273,790
石油・石炭製品(0.3%)			
昭和シェル石油	244	110	119,680
JXホールディングス	244	110	55,671
ゴム製品(1.1%)			
横浜ゴム	244	55	129,030
ブリヂストン	244	110	496,705
ガラス・土石製品(1.7%)			
日東紡績	244	110	67,320
旭硝子	244	110	76,230
日本板硝子	244	110	13,530
日本電気硝子	366	165	96,690
住友大阪セメント	244	110	50,820
太平洋セメント	244	110	41,030
東海カーボン	244	110	39,820
TOTO	244	110	224,070
日本碍子	244	110	341,000
鉄鋼(0.2%)			
新日鐵住金	244	110	32,417
神戸製鋼所	244	110	20,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	24.4	11	26,735
日新製鋼	24.4	11	15,543
大平洋金属	244	110	38,720
非鉄金属(1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	244	110	22,110
三井金属鉱業	244	110	32,560

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
東邦亜鉛	244	110	39,160
三菱マテリアル	244	110	48,730
住友金属鉱山	244	110	189,750
DOWAホールディングス	244	110	123,750
古河機械金属	244	110	24,860
古河電気工業	244	110	22,440
住友電気工業	244	110	207,020
フジクラ	244	110	71,830
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	24.4	11	14,905
東洋製罐グループホールディングス	244	110	207,240
機械 (4.9%)			
日本製鋼所	244	110	52,360
オークマ	244	110	142,010
アマダホールディングス	244	110	136,730
小松製作所	244	110	251,020
住友重機械工業	244	110	72,160
日立建機	244	110	221,210
クボタ	244	110	223,245
荏原製作所	244	110	61,710
ダイキン工業	244	110	934,560
日本精工	244	110	188,100
NTN	244	110	79,640
ジェイテクト	244	110	240,460
日立造船	48.8	22	15,048
三菱重工業	244	110	77,825
IHI	244	110	59,950
電気機器 (17.4%)			
コニカミノルタ	244	110	162,910
ミネベア	244	110	209,440
日立製作所	244	110	84,403
東芝	244	110	40,975
三菱電機	244	110	162,250
富士電機	244	110	56,320
安川電機	244	110	171,930
明電舎	244	110	47,190
ジーエス・ユアサ コーポレーション	244	110	51,260
日本電気	244	110	41,030
富士通	244	110	75,460
沖電気工業	244	110	27,830
パナソニック	244	110	178,200
シャープ	244	110	19,690
ソニー	244	110	387,915
TDK	244	110	962,500
ミツミ電機	244	110	85,800
アルプス電気	244	110	392,150
パイオニア	244	110	25,190
横河電機	244	110	158,950

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドバンテスト	488	220	271,040
カシオ計算機	244	110	270,930
ファナック	244	110	2,639,450
京セラ	488	220	1,387,980
太陽誘電	244	110	176,330
SCREENホールディングス	244	110	79,090
キヤノン	366	165	648,202
リコー	244	110	135,245
東京エレクトロン	244	110	846,780
輸送用機器 (6.8%)			
デンソー	244	110	644,820
三井造船	244	110	23,210
川崎重工業	244	110	60,060
日産自動車	244	110	131,670
いすゞ自動車	244	55	85,965
トヨタ自動車	244	110	892,430
日野自動車	244	110	156,640
三菱自動車工業	24.4	11	11,363
マツダ	244	22	52,976
本田技研工業	488	220	852,500
スズキ	244	110	443,960
富士重工業	244	110	489,500
精密機器 (2.5%)			
テルモ	488	220	672,100
ニコン	244	110	159,610
オリンパス	244	110	493,900
シチズンホールディングス	244	110	92,400
その他製品 (1.0%)			
凸版印刷	244	110	114,070
大日本印刷	244	110	141,295
ヤマハ	244	110	289,190
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力	24.4	11	7,711
中部電力	24.4	11	20,812
関西電力	24.4	11	15,735
東京瓦斯	244	110	72,765
大阪瓦斯	244	110	53,328
陸運業 (2.4%)			
東武鉄道	244	110	61,820
東京急行電鉄	244	110	95,590
小田急電鉄	244	110	132,440
京王電鉄	244	110	104,060
京成電鉄	244	110	161,590
東日本旅客鉄道	24.4	11	126,170
西日本旅客鉄道	24.4	11	93,225
東海旅客鉄道	24.4	11	235,125
日本通運	244	110	64,570
ヤマトホールディングス	244	110	269,720

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
海運業(0.2%)				
日本郵船	244	110	36,740	
商船三井	244	110	41,800	
川崎汽船	244	110	30,800	
空運業(0.1%)				
ANAホールディングス	244	110	38,929	
倉庫・運輸関連業(0.3%)				
三菱倉庫	244	110	186,340	
情報・通信業(10.3%)				
ヤフー	97.6	44	20,944	
トレンドマイクロ	244	110	455,400	
スカパーJ SATホールディングス	24.4	11	7,007	
日本電信電話	24.4	22	98,472	
KDDI	488	660	2,019,930	
NTTドコモ	24.4	11	26,763	
東宝	24.4	11	32,120	
エヌ・ティ・ティ・データ	244	110	596,200	
コナミ	244	110	260,480	
ソフトバンクグループ	732	330	2,285,250	
卸売業(2.2%)				
双日	24.4	11	3,201	
伊藤忠商事	244	110	164,450	
丸紅	244	110	75,141	
豊田通商	244	110	350,350	
三井物産	244	110	176,605	
住友商事	244	110	150,975	
三菱商事	244	110	291,555	
小売業(13.4%)				
J.フロントリテイリング	244	55	127,380	
三越伊勢丹ホールディングス	244	110	240,350	
セブン&アイホールディングス	244	110	591,030	
高島屋	244	110	122,540	
丸井グループ	244	110	191,840	
イオン	244	110	197,835	
ユニグループホールディングス	244	110	87,120	
ファーストリテイリング	244	110	5,998,300	
銀行業(1.3%)				
新生銀行	244	110	28,050	
あおぞら銀行	244	110	50,930	
三菱UFJフィナンシャルグループ	244	110	95,920	
りそなホールディングス	24.4	11	7,269	
三井住友トラストホールディングス	244	110	60,786	
三井住友フィナンシャルグループ	24.4	11	58,806	
千葉銀行	244	110	102,850	
横浜銀行	244	110	86,009	
ふくおかフィナンシャルグループ	244	110	69,850	
静岡銀行	244	110	142,780	
みずほフィナンシャルグループ	244	110	28,820	

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
証券・商品先物取引業(0.6%)				
大和証券グループ本社	244	110	99,968	
野村ホールディングス	244	110	94,072	
松井証券	244	110	120,120	
保険業(1.1%)				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	61	27.5	115,610	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	73.2	33	123,799	
ソニーフィナンシャルホールディングス	48.8	22	50,798	
第一生命保険	24.4	11	25,437	
東京海上ホールディングス	122	55	275,440	
T&Dホールディングス	48.8	22	39,424	
その他金融業(0.5%)				
クレディセゾン	244	110	306,020	
不動産業(2.4%)				
東急不動産ホールディングス	244	110	106,480	
三井不動産	244	110	374,330	
三菱地所	244	110	296,450	
平和不動産	48.8	22	38,808	
東京建物	244	55	90,090	
住友不動産	244	110	469,590	
サービス業(3.0%)				
電通	244	110	738,100	
東京ドーム	244	110	55,330	
セコム	244	110	886,160	
合計	株数・金額	51,545	23,380	56,292,141
	銘柄数<比率>	225	225	<90.1%>

(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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄	当期末	
		買建額	売建額
国内	日経225	百万円 6,147	百万円 -

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) -印は組入れなしです。

◆投資信託財産の構成

(2015年7月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	56,292,141	81.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,177,264	19.0
投 資 信 託 財 産 総 額	69,469,405	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

(2015年7月13日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	69,469,405,080円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,845,628,866
株 式 (評価額)	56,292,141,400
未 収 入 金	86,617,295
未 収 配 当 金	39,564,000
未 収 利 息	3,519
差 入 委 託 証 拠 金	205,450,000
(B) 負 債	7,001,837,500
未 払 金	7,001,837,500
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	62,467,567,580
元 本	44,230,155,430
次 期 繰 越 損 益 金	18,237,412,150
(D) 受 益 権 総 口 数	44,230,155,430口
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C / D)	14,123円

(注記事項)

期首元本額	93,709,162,082円
期中追加設定元本額	88,125,553,172円
期中一部解約元本額	137,604,559,824円

(当期末元本の内訳)

りそな・日経225オープン	29,476,129,165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)	5,674,838,061円
アムンディ・日経平均オープン	8,884,429,085円
りそな・日経225オープンVA (適格機関投資家専用)	194,759,119円

◆損益の状況

当期 (自2014年7月12日 至2015年7月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	971,646,387円
受 取 配 当 金	970,924,472
受 取 利 息	636,212
そ の 他 収 益 金	85,703
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	21,911,002,733
売 買 益	22,804,712,552
売 買 損	△893,709,819
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,220,817,897
取 引 益	2,568,237,749
取 引 損	△1,347,419,852
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	24,103,467,017
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,562,419,181
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	17,185,915,828
(G) 解 約 差 損 益 金	△27,614,389,876
(H) 計 (D + E + F + G)	18,237,412,150
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	18,237,412,150

(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) (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3) (G)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》

平成26年12月1日付で、改正投資信託法の施行に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。