

■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	2014年1月22日から2023年11月20日までです。	
運用方針	JPX日経インデックス400（配当込み）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・JPX日経400オープン	アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド受益証券
	アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	日本の金融商品取引所の上場株式
組入制限	りそな・JPX日経400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・JPX日経400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（毎年11月19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います。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みません）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および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・JPX日経400オープン

償還 運用報告書（全体版）

第10期（償還日 2023年11月20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、2023年11月20日に信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに、謹んで運用経過と償還内容を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、よろしく願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

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：<https://www.amundi.co.jp/>

< 3268183・3255729 >

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入 比率	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	%	ポイント	%	%	%	百万円
6期(2019年11月19日)	14,090	0	6.3	17,358.40	7.1	98.7	1.2	4,405
7期(2020年11月19日)	14,826	0	5.2	18,389.39	5.9	96.0	3.9	3,337
8期(2021年11月19日)	17,712	0	19.5	22,139.45	20.4	97.8	2.1	3,400
9期(2022年11月21日)	17,435	0	△1.6	21,945.43	△0.9	97.7	2.2	3,278
(償還時)	(償還価額)							
10期(2023年11月20日)	21,014.33		20.5	27,131.58	23.6	—	—	3,055

(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います。以下同じ。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注3) ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。)および株式会社日本経済新聞社(以下、「日経」といいます。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。

「JPX日経インデックス400」を示す標準に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJPX総研、株式会社日本取引所グループおよび日経に帰属します。

・「りそな・JPX日経400オープン」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研および日経は、その運用および「りそな・JPX日経400オープン」の取引に関して、一切の責任を負いません。

・JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。

・JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有します。

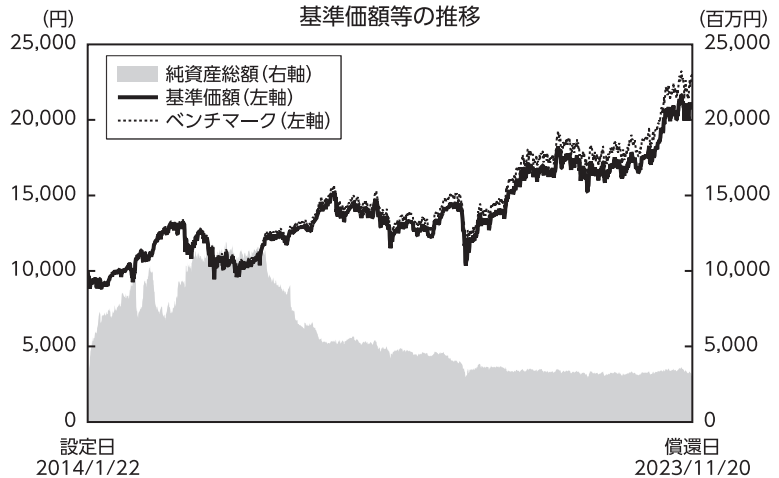
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入 比率	株式先物 比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年11月21日	17,435	—	21,945.43	—	97.7	2.2
11月末	17,530	0.5	22,075.59	0.6	98.3	1.6
12月末	16,706	△4.2	21,052.19	△4.1	97.9	2.0
2023年1月末	17,444	0.1	21,999.20	0.2	98.0	1.9
2月末	17,603	1.0	22,212.78	1.2	98.7	1.3
3月末	17,888	2.6	22,588.54	2.9	97.8	2.1
4月末	18,333	5.2	23,167.58	5.6	97.7	2.3
5月末	19,131	9.7	24,192.59	10.2	97.6	2.3
6月末	20,564	17.9	26,022.39	18.6	98.5	1.5
7月末	20,827	19.5	26,371.68	20.2	99.1	0.9
8月末	20,854	19.6	26,425.20	20.4	99.0	0.9
9月末	20,869	19.7	26,461.72	20.6	98.5	1.4
10月末	20,140	15.5	25,542.53	16.4	98.4	1.6
(償還時)	(償還価額)					
2023年11月20日	21,014.33	20.5	27,131.58	23.6	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

【設定以来の基準価額等の推移】

第1期首 (設定日)	10,000円
第10期末 (償還日)	21,014円33銭
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	110.1%



(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、JPX日経インデックス400（配当込み）です。

(注2) ベンチマークは、設定日（2014年1月22日）を10,000として指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 日本政府が成長戦略に法人実効税率の引き下げを盛り込んだことや、日銀が追加的金融緩和を行ったこと（2014年）
- ② 米国のトランプ新政権への期待、欧州における反EU（欧州連合）勢力の後退、国内衆議院選挙での与党の大勝など（2017年）
- ③ 世界各国での景気下支え策や新型コロナウイルスのワクチン開発が好感されたことなど（2020年4月～12月）
- ④ 東証が企業に低PBR（株価純資産倍率）改善に向けた経営改革を要請したことや、海外投資家が大幅に日本株を買い越したことなど（2023年4月～6月）

下落要因

- ① 英国のEU離脱や米国大統領選挙でトランプ候補が想定外の勝利を収めたことなどで先行きに対する不透明感が高まったことなど（2016年）
- ② 米国での利上げや米中間の貿易摩擦が高まったこと（2018年）
- ③ 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大（2020年2月～3月）

【投資環境】

投資環境については、主要投資対象であるアムンディ・JPX日経400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・JPX日経400オープンマザーファンドの受益証券への投資を通じて、JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。また、マザーファンドの株式の組入比率は原則として高位を保ちました。なお、償還に向けて2023年11月にマザーファンド受益証券を全て売却し、以降は解約金、償還金の支払いに備えコール・ローン等の短期金融資産を中心とした安定運用に切り替えました。

<アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド>

ポートフォリオについては、主要投資対象であるアムンディ・JPX日経400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】

設定来の基準価額の騰落率は+110.1%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の騰落率（+129.5%）を下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。

マイナス要因

- ① 売買手数料や信託報酬等
- ② 償還に向けて2023年11月13日にマザーファンドで保有する株式および先物を全て売却したため、以降の基準価額の変動が小さくなった一方、ベンチマークは同月20日の償還日にかけて上昇したため、マイナスの乖離が発生したこと

プラス要因

- ① 追加設定・一部解約と株式等の売買タイミングの違い
- ② 先物取引の影響

【分配金】

基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、信託期間中分配は行いませんでした。

満期償還にあたり、受益者のみなさまのご愛顧に対し心からお礼申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第10期 (2022年11月22日 ～2023年11月20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)	125円 (56) (62) (6)	0.658% (0.296) (0.329) (0.033)	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) (1)	0.005 (0.002) (0.003)	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)	10 (1) (5) (4)	0.055 (0.005) (0.028) (0.022)	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	136	0.718	

期中の平均基準価額は18,990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。

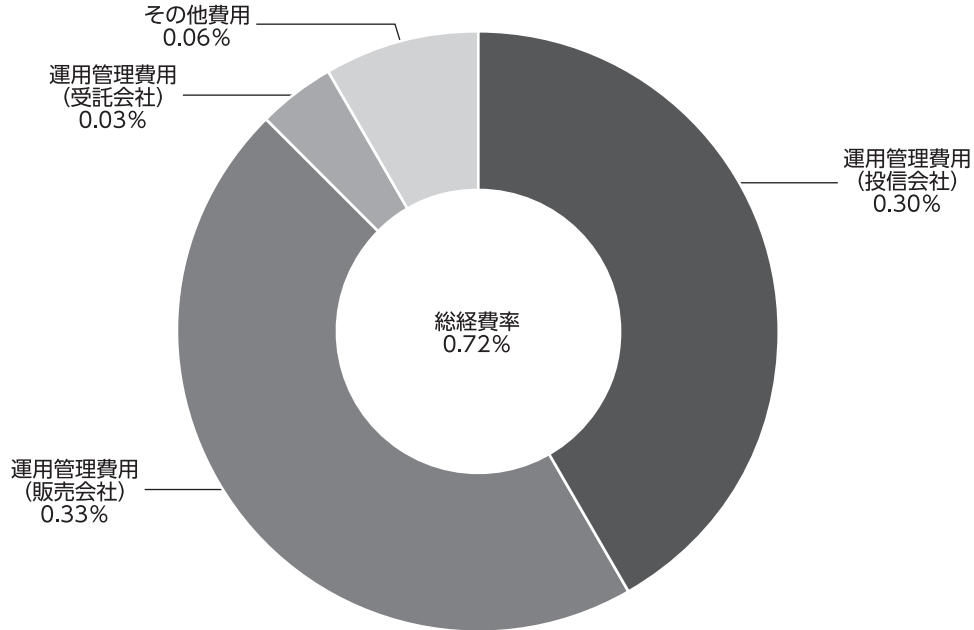
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

●総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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0.72%です。



(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 当ファンドの費用は、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費用を含みます。

(注5) 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異なります。

■売買及び取引の状況（2022年11月22日から2023年11月20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・JPX日経400オープンマザーファンド	105,366	213,196	1,877,791	4,144,175

(注) 単位未満は切捨てです。

■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・JPX日経400 オープンマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,147,955千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,281,859千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.26

(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（2022年11月22日から2023年11月20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（2023年11月20日現在）

償還日現在、マザーファンドの組入はありません。

(前期末：2022年11月21日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首（前期末）
	口 数
	千口
アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド	1,772,425

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2023年11月20日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 3,175,345	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,175,345	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2023年11月20日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	3,175,345,558円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,175,345,558
(B) 負 債	119,943,938
未 払 解 約 金	107,480,426
未 払 信 託 報 酬	11,325,542
未 払 利 息	9,482
そ の 他 未 払 費 用	1,128,488
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,055,401,620
元 本	1,453,961,255
償 還 差 益 金	1,601,440,365
(D) 受 益 権 総 口 数	1,453,961,255口
1 万 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	21,014円33銭

(注記事項)

期首元本額	1,880,677,023円
期中追加設定元本額	188,589,638円
期中一部解約元本額	615,305,406円

■損益の状況

当期 (自2022年11月22日 至2023年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 13,700円
支 払 利 息	△ 13,700
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	516,949,385
売 買 益	645,611,230
売 買 損	△ 128,661,845
(C) 信 託 報 酬 等	△ 23,806,664
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	493,129,021
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	548,233,496
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	560,077,848
(配 当 等 相 当 額)	(561,260,506)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,182,658)
償 還 差 益 金 (D + E + F)	1,601,440,365

(注1) (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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年1月22日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年11月20日		資産総額	3,175,345,558円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	119,943,938円
受益権口数	400,000,000口	1,453,961,255口	1,053,961,255口	純資産総額	3,055,401,620円
元本額	400,000,000円	1,453,961,255円	1,053,961,255円	受益権口数	1,453,961,255口
				1万口当たり償還金	21,014.33円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	6,496,603,125円	7,163,096,865円	11,026円	0円	0.0000%
第2期	8,754,580,108	11,071,172,917	12,646	0	0.0000
第3期	9,813,148,439	11,288,530,948	11,503	0	0.0000
第4期	3,757,117,227	5,282,303,671	14,059	0	0.0000
第5期	3,669,419,983	4,864,421,899	13,257	0	0.0000
第6期	3,126,998,901	4,405,810,509	14,090	0	0.0000
第7期	2,250,864,930	3,337,103,625	14,826	0	0.0000
第8期	1,919,655,347	3,400,110,439	17,712	0	0.0000
第9期	1,880,677,023	3,278,956,690	17,435	0	0.0000

■償還金のお知らせ

償還決算日	2023年11月20日
1万口当たりの償還金(税込み)	21,014円33銭

アムンディ・JPX日経400オープンマザーファンド

償還 運用報告書

《第10期》

償還日：2023年11月17日

(計算期間：2022年11月22日～2023年11月17日)

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況と償還内容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。

信託期間	2014年1月22日から2023年11月17日（当初：無期限）までです。
運用方針	JPX日経インデックス400（配当込み）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	日本の金融商品取引所の上場株式
組入制限	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。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純資産 総 額
	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率	(ベンチマーク)			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
6期 (2019年11月19日)	14,619	7.1	17,358.40	7.1	98.7	1.2	4,403
7期 (2020年11月19日)	15,496	6.0	18,389.39	5.9	96.0	3.9	3,336
8期 (2021年11月19日)	18,650	20.4	22,139.45	20.4	97.9	2.1	3,399
9期 (2022年11月21日)	18,491	△ 0.9	21,945.43	△ 0.9	97.7	2.2	3,277
(償 還 時)	(償還価額)						
10期 (2023年11月17日)	22,448.21	21.4	27,308.97	24.4	—	—	3,161

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。以下同じ。

(注2) ・「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研（以下「JPX総研」といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。

「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJPX総研、株式会社日本取引所グループおよび日経に帰属します。

・「りそな・JPX日経400オープン」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研および日経は、その運用および「りそな・JPX日経400オープン」の取引に関して、一切の責任を負いません。

・JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。

・JPX総研および日経は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有します。

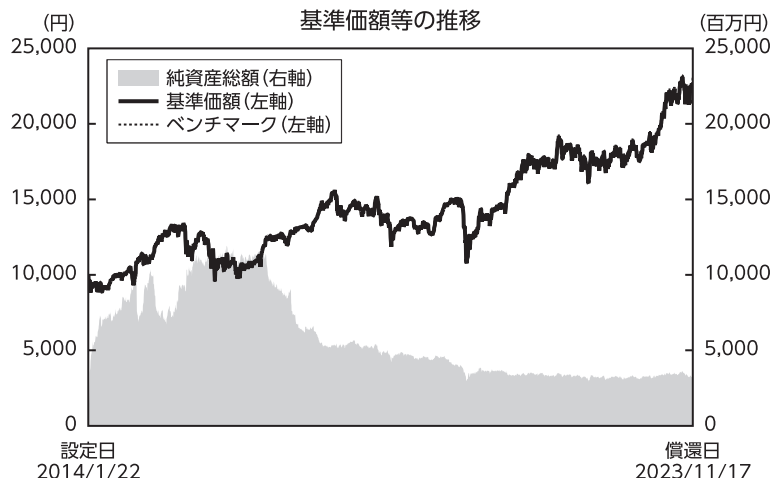
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	(ベンチマーク)		
(期 首)	円	%	ポイント	%	%	%
2022年11月21日	18,491	—	21,945.43	—	97.7	2.2
11月末	18,595	0.6	22,075.59	0.6	98.3	1.6
12月末	17,731	△ 4.1	21,052.19	△ 4.1	97.9	2.0
2023年1月末	18,527	0.2	21,999.20	0.2	98.0	1.9
2月末	18,706	1.2	22,212.78	1.2	98.7	1.3
3月末	19,021	2.9	22,588.54	2.9	97.8	2.1
4月末	19,505	5.5	23,167.58	5.6	97.7	2.3
5月末	20,367	10.1	24,192.59	10.2	97.7	2.3
6月末	21,906	18.5	26,022.39	18.6	98.5	1.5
7月末	22,199	20.1	26,371.68	20.2	99.1	0.9
8月末	22,241	20.3	26,425.20	20.4	99.1	0.9
9月末	22,270	20.4	26,461.72	20.6	98.6	1.4
10月末	21,505	16.3	25,542.53	16.4	98.4	1.6
(償 還 時)	(償還価額)					
2023年11月17日	22,448.21	21.4	27,308.97	24.4	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

【設定以来の基準価額等の推移】

第1期首 (設定日)	10,000円
第10期末 (償還日)	22,448円21銭
騰落率	124.5%



(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、JPX日経インデックス400 (配当込み) です。

(注2) ベンチマークは、設定日 (2014年1月22日) を10,000として指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 日本政府が成長戦略に法人実効税率の引き下げを盛り込んだことや、日銀が追加的金融緩和を行ったこと (2014年)
- ② 米国のトランプ新政権への期待、欧州における反EU (欧州連合) 勢力の後退、国内衆議院選挙での与党の大勝など (2017年)
- ③ 世界各国での景気下支え策や新型コロナウイルスのワクチン開発が好感されたことなど (2020年4月～12月)
- ④ 東証が企業に低PBR (株価純資産倍率) 改善に向けた経営改革を要請したことや、海外投資家が大幅に日本株を買い越したことなど (2023年4月～6月)

下落要因

- ① 英国のEU離脱や米国大統領選挙でトランプ候補が想定外の勝利を収めたことなどで先行きに対する不透明感が高まったことなど (2016年)
- ② 米国での利上げや米中間の貿易摩擦が高まったこと (2018年)
- ③ 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大 (2020年2月～3月)

【投資環境】

＜国内株式市場＞

当ファンドが設定された2014年からの約9年10ヵ月において、国内株式市場は下落する局面もみられたものの大幅に上昇しました。設定当初は寒波による米国経済の悪化や円高が懸念され軟調な滑り出しとなりましたが、日本政府による成長戦略に法人実効税率の引き下げが盛り込まれたことや、日銀の追加的金融緩和などにより、市場は上昇基調に転じました。2015年もおおむね良好な地合いが継続したものの、2016年に入ると英国のEU（欧州連合）離脱や、米国大統領選挙でトランプ候補が想定外の勝利を収めたことなどにより先行きに対する不透明感が高まったため、株式市場は下落基調に転じました。しかし、2017年にはトランプ米新政権への期待、欧州における反EU勢力の後退、国内では衆議院選挙で与党が大勝したことが好感され、株式市場は上昇しました。続く2018年には米国の利上げや米中間の経済摩擦の高まりが嫌気されたことで下落となりました。2020年2月～3月には新型コロナウイルスの感染拡大により世界的に景気見通しが悪化したことで、株式市場は急落しました。しかし、その後は各国・地域の政府が景気を支えるための政策を導入したことや、新型コロナウイルスに対するワクチン開発を好感し回復局面となりました。2023年の春には東証が企業の低PBR（株価純資産倍率）改善に向けた経営改革を要請したことや、海外投資家が大幅に日本株を買い越したことなどにより株式市場は大きく上昇しました。その後、信託期間末に向けて、株式市場は上下に振れながらも高水準で推移しました。

【ポートフォリオ】

当ファンドは、JPX日経インデックス400（配当込み）と連動する投資成果を目標とし運用を行いました。運用につきましては、「マルチファクター・リスクモデル」を活用した最適化法によりポートフォリオを維持・管理しました。ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の属性の変化や設定解約による資金流出入に対応し、ポートフォリオの見直しを随時行いました。信託期間当初より、株式の高位組入れを維持し、株式先物を利用することにより、設定や株式配当金等のキャッシュフローに迅速に対応し、株式組入比率を出来る限り100%に近づけ推移させました。2023年11月には、ファンドの償還に備えポジションをすべて売却しました。

【ベンチマークとの差異】

設定来の基準価額の騰落率は+124.5%となり、ベンチマークであるJPX日経インデックス400（配当込み）の騰落率（+131.0%）を下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。

マイナス要因

- ① 売買手数料等
- ② 償還に向けて2023年11月13日に保有株式および先物をすべて売却したため、以降の基準価額の変動が小さくなった一方、ベンチマークは同月17日の償還日にかけて上昇したため、マイナスの乖離が発生したこと

プラス要因

- ① 東芝の株主訴訟での和解金

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第10期 (2022年11月22日 ～2023年11月17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) (1)	0.006% (0.002) (0.003)	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)	0.002 (0.002)	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	0.008	

期中の平均基準価額は20,214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 (2022年11月22日から2023年11月17日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 86 (360)	千円 198,429 (-)	千株 1,571	千円 3,949,525

(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 996	百万円 1,082	百万円 4	百万円 4

■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	4,147,955千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,281,859千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.26

(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 (2022年11月22日から2023年11月17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
ローム	0.7	8,508	12,155	三井住友フィナンシャルグループ	11	76,214	6,928
KDDI	1.9	8,137	4,283	三菱UFJフィナンシャル・グループ	63.3	76,050	1,201
マツダ	5.3	7,981	1,506	三菱商事	10.8	75,460	6,987
ソフトバンクグループ	1.2	7,887	6,573	三井物産	13	70,962	5,458
SBIホールディングス	2.3	6,819	2,965	信越化学工業	14.2	68,397	4,816
三井物産	1	5,381	5,381	東京エレクトロン	3	66,292	22,097
信越化学工業	1.1	4,955	4,504	トヨタ自動車	23.9	65,723	2,749
任天堂	0.7	4,353	6,219	日立製作所	6.6	64,528	9,777
伊藤忠商事	0.8	4,290	5,363	伊藤忠商事	10.9	63,219	5,799
三菱商事	0.6	4,154	6,924	本田技研工業	36.2	60,399	1,668

(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 (2022年11月22日から2023年11月17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（2023年11月17日現在）

償還日現在、有価証券の組入はありません。

（前期末：2022年11月21日現在）

(1) 国内株式

銘柄	期首（前期末）	
	株	数
		千株
水産・農林業		
ニッスイ	2.6	
鉱業		
INPEX	8	
建設業		
ウエストホールディングス	0.2	
ショーボンドホールディングス	0.3	
ミライト・ワン	0.6	
安藤・間	0.8	
コムシスホールディングス	0.9	
大成建設	1.4	
大林組	5.1	
清水建設	4.8	
長谷工コーポレーション	1.5	
鹿島建設	3.8	
西松建設	0.3	
戸田建設	1.5	
熊谷組	0.3	
五洋建設	2.1	
住友林業	1.2	
大和ハウス工業	4.3	
積水ハウス	4.8	
関電工	0.4	
エクシオグループ	0.9	
九電工	0.4	
インフロニア・ホールディングス	2.1	
食料品		
森永製菓	0.4	
カルビー	0.7	
森永乳業	0.3	
ヤクルト本社	1.1	
明治ホールディングス	0.9	
プリマハム	0.1	

銘柄	期首（前期末）	
	株	数
		千株
日本ハム	0.7	
アサヒグループホールディングス	3.5	
麒麟ホールディングス	6.9	
宝ホールディングス	1	
サントリー食品インターナショナル	1	
キッコーマン	1	
味の素	3.8	
キューピー	0.7	
カゴメ	0.7	
ニチレイ	0.6	
東洋水産	0.7	
日清食品ホールディングス	0.6	
日本たばこ産業	10	
繊維製品		
帝人	1.5	
東レ	10.6	
ゴールドウイン	0.3	
パルプ・紙		
王子ホールディングス	7.4	
大王製紙	0.6	
レンゴー	1.3	
化学		
クラレ	2.6	
旭化成	9.7	
住友化学	11.5	
日産化学	0.7	
東ソー	2	
トクヤマ	0.5	
デンカ	0.6	
信越化学工業	2.7	
エア・ウォーター	1.6	
日本酸素ホールディングス	1.3	
三菱瓦斯化学	1.2	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
三井化学	1.3	
三菱ケミカルグループ	10.8	
KHネオケム	0.3	
ダイセル	2.3	
積水化学工業	3.3	
日本ゼオン	1.2	
アイカ工業	0.4	
UBE	0.9	
日油	0.5	
花王	3.8	
日本ペイントホールディングス	6.9	
関西ペイント	1.5	
富士フイルムホールディングス	3	
資生堂	3.2	
ライオン	2	
ファンケル	0.7	
コーセー	0.3	
小林製薬	0.4	
タカラバイオ	0.5	
デクセリアルズ	0.3	
日東電工	1.1	
エフピコ	0.2	
ニフコ	0.7	
ユニ・チャーム	3.1	
医薬品		
協和キリン	1.7	
武田薬品工業	11.8	
アステラス製薬	15.1	
住友ファーマ	1.3	
塩野義製薬	2	
日本新薬	0.4	
中外製薬	4.9	
科研製薬	0.3	
エーザイ	1.9	
ロート製薬	0.7	
小野薬品工業	3	
参天製薬	2.8	
JCRファーマ	0.6	
東和薬品	0.2	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
第一三共	13.5	
大塚ホールディングス	3.6	
ペプチドリーム	0.7	
石油・石炭製品		
出光興産	1.9	
ENEOSホールディングス	28	
コスモエネルギーホールディングス	0.7	
ゴム製品		
横浜ゴム	0.8	
TOYO TIRE	0.9	
ブリヂストン	5	
住友ゴム工業	1.6	
ガラス・土石製品		
AGC	1.5	
太平洋セメント	0.8	
東海カーボン	1.1	
TOTO	1	
日本碍子	1.8	
日本特殊陶業	1.2	
MARUWA	0.1	
ニチアス	0.5	
鉄鋼		
日本製鉄	7.2	
JFEホールディングス	4.3	
東京製鉄	0.5	
非鉄金属		
三井金属鉱業	0.3	
住友金属鉱山	1.9	
DOWAホールディングス	0.4	
住友電気工業	5.7	
AREホールディングス	0.6	
金属製品		
SUMCO	2.8	
三和ホールディングス	1.7	
リンナイ	0.3	
機械		
三浦工業	0.7	
アマダ	2.4	
FUJI	0.7	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
DMG森精機		0.8
ディスコ		0.3
オプトラン		0.1
ナブテスコ		0.9
SMC		0.5
小松製作所		7.3
住友重機械工業		0.8
日立建機		0.7
ローツェ		0.1
クボタ		8.3
荏原製作所		0.6
ダイキン工業		1.9
ダイフク		0.8
竹内製作所		0.3
ホンザキ		1
マキタ		2.1
三菱重工業		2.7
I H I		1.1
電気機器		
イビデン		0.9
ブラザー工業		1.9
ミネベアミツミ		2.8
日立製作所		6.6
三菱電機		15.9
富士電機		1
安川電機		1.8
ニデック		3.8
オムロン		1.4
MC J		0.5
日本電気		2.1
富士通		1.6
ルネサスエレクトロニクス		9.8
セイコーエプソン		2.1
ワコム		1.9
アルバック		0.3
エレコム		0.5
パナソニック ホールディングス		18.1
シャープ		1.9
アンリツ		0.9

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
ソニーグループ		4.1
TDK		2.6
横河電機		1.6
アズビル		1.1
日本光電工業		0.8
堀場製作所		0.3
アドバンテスト		1.3
キーエンス		1
シスメックス		1.3
フェローテックホールディングス		0.4
レーザーテック		0.8
カシオ計算機		1.1
ファナック		1.5
浜松ホトニクス		1.2
新光電気工業		0.5
京セラ		2.4
太陽誘電		0.9
村田製作所		4.7
小糸製作所		1.8
SCREENホールディングス		0.3
東京エレクトロン		1
輸送用機器		
トヨタ紡織		0.5
豊田自動織機		1.2
デンソー		3.2
いすゞ自動車		4.5
トヨタ自動車		23.2
アイシン		1.3
本田技研工業		12.6
スズキ		2.8
SUBARU		4.7
ヤマハ発動機		2.4
豊田合成		0.6
シマノ		0.6
テイ・エス テック		0.8
精密機器		
テルモ		4.9
島津製作所		1.9
東京精密		0.3

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
オリンパス	9.7	
HOYA	3.3	
朝日インテック	1.9	
その他製品		
バンダイナムコホールディングス	1.4	
パイロットコーポレーション	0.2	
ヤマハ	1	
ビジョン	0.8	
任天堂	7.7	
電気・ガス業		
中部電力	5.7	
関西電力	6.2	
九州電力	3.2	
北海道電力	1.6	
電源開発	1.2	
イーレックス	0.4	
レノバ	0.4	
東京瓦斯	3.2	
大阪瓦斯	3.1	
陸運業		
東海旅客鉄道	1.2	
ヤマトホールディングス	2	
山九	0.4	
センコーグループホールディングス	0.4	
日立物流	0.3	
AZ-COM丸和ホールディングス	0.6	
SGホールディングス	2.8	
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.5	
海運業		
日本郵船	4.2	
商船三井	2.7	
川崎汽船	1.5	
情報・通信業		
NECネットエスアイ	0.5	
システナ	2	
日鉄ソリューションズ	0.3	
TIS	1.7	
コーエーテクモホールディングス	1	
ネクソン	4	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
ティーガイア	0.5	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.3	
GMOペイメントゲートウェイ	0.4	
インターネットイニシアティブ	1	
ラクス	0.6	
チェンジホールディングス	0.4	
野村総合研究所	3.1	
インフォコム	0.1	
オービック	0.5	
ジャストシステム	0.2	
LINEヤフー	22.1	
トレンドマイクロ	0.9	
日本オラクル	0.3	
伊藤忠テクノソリューションズ	0.7	
大塚商会	0.9	
電通国際情報サービス	0.3	
東映アニメーション	0.1	
デジタルガレージ	0.3	
ネットワンシステムズ	0.6	
BIPROGY	0.5	
USEN-NEXT HOLDINGS	0.1	
日本電信電話	12.1	
KDDI	10.2	
ソフトバンク	24.9	
光通信	0.2	
GMOインターネットグループ	0.5	
東宝	1	
NTTデータグループ	4.7	
DTS	0.3	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.8	
カプコン	1.5	
SCSK	1.2	
NSD	0.5	
コナミグループ	0.7	
ソフトバンクグループ	7.6	
卸売業		
双日	1.8	
アルフレッサホールディングス	1.5	
神戸物産	1.2	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
ダイワボウホールディングス	0.6	
TOKAIホールディングス	1.3	
シップヘルスケアホールディングス	0.7	
メディパルホールディングス	1.6	
伊藤忠商事	10.1	
丸紅	12.9	
豊田通商	1.4	
兼松	0.6	
三井物産	12	
住友商事	10.2	
三菱商事	10.2	
阪和興業	0.3	
岩谷産業	0.4	
PAL TAC	0.3	
日鉄物産	0.1	
ミスミグループ本社	2.5	
小売業		
ローソン	0.4	
エービーシー・マート	0.3	
日本マクドナルドホールディングス	0.9	
セリア	0.3	
Monotaro	2.6	
マツキヨココカラ&カンパニー	1	
ZOZO	1.2	
ウエルシアホールディングス	0.8	
クリエイトSDホールディングス	0.3	
ネクステージ	0.3	
コスモス薬品	0.2	
セブン&アイ・ホールディングス	5.7	
ツルハホールディングス	0.4	
クスリのアオキホールディングス	0.2	
FOOD & LIFE COMPANIES	0.9	
ノジマ	0.6	
良品計画	2.2	
コーナン商事	0.3	
パソパソ・インターナショナルホールディングス	3.8	
ゼンショーホールディングス	0.8	
ワークマン	0.2	
スギホールディングス	0.3	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
日本瓦斯	0.8	
ライフコーポレーション	0.1	
丸井グループ	1.3	
イズミ	0.3	
ヤオコー	0.2	
ケーズホールディングス	1.5	
ニトリホールディングス	0.7	
ファーストリテイリング	0.2	
サンドラッグ	0.7	
銀行業		
めぶきフィナンシャルグループ	8	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	8.5	
SBI新生銀行	0.4	
あおぞら銀行	0.9	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	62.4	
りそなホールディングス	18.5	
三井住友トラスト・ホールディングス	2.9	
三井住友フィナンシャルグループ	11	
千葉銀行	5	
ふくおかフィナンシャルグループ	1.1	
セブン銀行	5	
みずほフィナンシャルグループ	22	
証券、商品先物取引業		
GMOフィナンシャルホールディングス	0.9	
ジャフコグループ	0.6	
大和証券グループ本社	11.2	
野村ホールディングス	28.1	
マネックスグループ	1.4	
保険業		
SOMPOホールディングス	2.6	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.4	
第一生命ホールディングス	7.8	
東京海上ホールディングス	15.4	
T&Dホールディングス	4.1	
その他金融業		
全国保証	0.4	
芙蓉総合リース	0.2	
みずほリース	0.1	
東京センチュリー	0.3	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
イオンフィナンシャルサービス	1.1	
アコム	3.4	
オリエンコーポレーション	0.7	
オリックス	10.2	
三菱HCキャピタル	5.1	
日本取引所グループ	4	
不動産業		
大東建託	0.6	
ヒューリック	3.7	
野村不動産ホールディングス	1	
プレサンスコーポレーション	0.1	
オープンハウスグループ	0.5	
東急不動産ホールディングス	4.4	
飯田グループホールディングス	1.3	
三井不動産	6.8	
三菱地所	9.5	
東京建物	1.5	
住友不動産	2.8	
スターツコーポレーション	0.3	
日本エスコン	0.7	
イオンモール	0.7	
カチタス	0.3	
サービス業		
UTグループ	0.1	
エス・エム・エス	0.5	
パーソルホールディングス	1.8	
総合警備保障	0.6	
カカクコム	1.3	
ディップ	0.2	
ベネフィット・ワン	0.8	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
		千株
エムスリー	3.1	
博報堂DYホールディングス	2.5	
H. U. グループホールディングス	0.4	
ビー・エム・エル	0.2	
ユー・エス・エス	1.9	
サイバーエージェント	3.6	
フルキャストホールディングス	0.3	
エン・ジャパン	0.2	
テクノプロ・ホールディングス	1.1	
ジャパンマテリアル	0.5	
リクルートホールディングス	11.2	
ベルシステム24ホールディングス	0.3	
ペイカレント・コンサルティング	1.3	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.3	
リログループ	0.9	
トランス・コスモス	0.2	
セコム	1.6	
メイテックグループホールディングス	0.6	
イオンディライト	0.1	
合計	株数	1,123
	銘柄数	396

(2) 先物取引の銘柄別期首(前期末)残高

銘柄	期首(前期末)	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
JPX日経400	73	—

(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 (2023年11月17日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,206,772	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,206,772	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2023年11月17日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	3,206,772,389円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,206,772,389
(B) 負 債	45,127,551
未 払 解 約 金	45,088,000
そ の 他 未 払 費 用	39,551
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,161,644,838
元 本	1,408,417,631
償 還 差 益 金	1,753,227,207
(D) 受 益 権 総 口 数	1,408,417,631口
1 万 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	22,448円21銭

(注記事項)

期首元本額	1,772,425,675円
期中追加設定元本額	105,366,099円
期中一部解約元本額	469,374,143円

(償還時元本の内訳)

りそな・JPX日経400オープン	1,408,417,631円
------------------	----------------

■損益の状況

当期 (自2022年11月22日 至2023年11月17日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	92,118,072円
受 取 配 当 金	85,911,510
そ の 他 収 益 金	6,241,079
支 払 利 息	△ 34,517
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	548,520,905
売 買 益	656,691,117
売 買 損	△ 108,170,212
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	13,002,480
取 引 益	18,590,890
取 引 損	△ 5,588,410
(D) そ の 他 費 用 等	△ 52,391
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	653,589,066
(F) 前期繰越損益金	1,504,965,097
(G) 追加信託差損益金	107,829,901
(H) 解約差損益金	△ 513,156,857
償還差益金 (E + F + G + H)	1,753,227,207

(注1) (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2) (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》

当該親投資信託を投資対象とするすべての投資信託が、投資信託契約を解約し信託終了することとなったため、2023年11月17日付で信託終了日を繰り上げ、信託契約を解約いたしました。