

■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	2004年11月19日から2024年2月16日（当初：無期限）までです。	
運用方針	りそな・日本株式インデックス・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、東証株価指数（TOPIX）に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・TOPIXオープン	りそな・日本株式インデックス・マザーファンドの受益証券
	りそな・日本株式インデックス・マザーファンド	日本の金融商品取引所上場株式
組入制限	りそな・TOPIX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。
	りそな・日本株式インデックス・マザーファンド	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。
分配方針	毎決算時（年1回、原則として毎年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う方針です。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分も含めた利子・配当等収益および売買益（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。	

りそな・TOPIXオープン

償還 運用報告書（全体版）

第20期（償還日 2024年2月16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、2024年2月16日に信託期間を終了（繰上償還）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/>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数 (TOPIX)		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
16期 (2020年11月19日)	18,922	0	3.5	1,726.41	1.7	96.4	3.6	2,204
17期 (2021年11月19日)	22,757	0	20.3	2,044.53	18.4	97.2	2.8	2,923
18期 (2022年11月21日)	22,256	0	△ 2.2	1,972.57	△ 3.5	98.0	2.1	1,440
19期 (2023年11月20日)	27,286	0	22.6	2,372.60	20.3	95.5	4.4	1,238
(償還時)	(償還価額)							
20期 (2024年2月16日)	29,420.82		7.8	2,624.73	10.6	—	—	940

(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) ベンチマークは東証株価指数 (TOPIX) です。

東証株価指数 (TOPIX) とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など TOPIX に関するすべての権利・ノウハウおよび TOPIX にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、TOPIX の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。以下同じ。

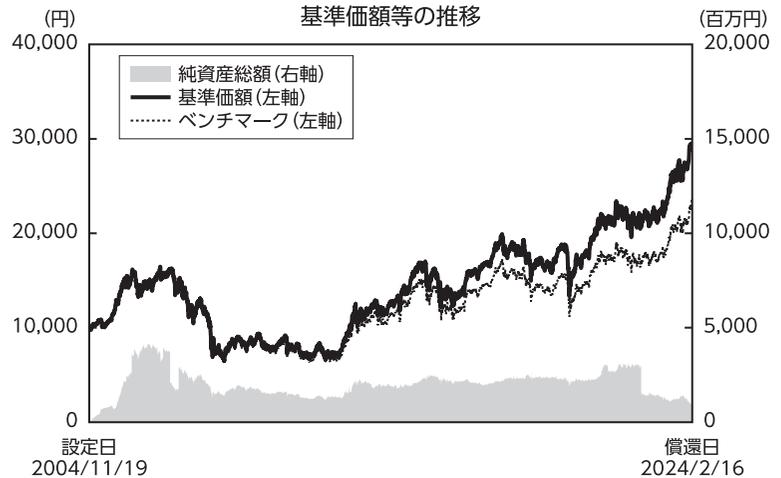
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX)		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	%	%	%
2023年11月20日	27,286	—	2,372.60	—	95.5	4.4
11月末	27,309	0.1	2,374.93	0.1	92.9	6.9
12月末	27,361	0.3	2,366.39	△ 0.3	98.5	1.5
2024年1月末	29,452	7.9	2,551.10	7.5	97.0	2.9
(償還時)	(償還価額)					
2024年2月16日	29,420.82	7.8	2,624.73	10.6	—	—

(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20期末 (償還日)	29,420円82銭
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	194.2%



(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、東証株価指数(TOPIX)です。

(注2) ベンチマークは、設定日(2004年11月19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 不良債権問題が解決に向かったことを背景に日本経済が好転するとの期待が広がったこと(設定当初～2007年半ば)
- ② アベノミクスに対する期待が高まったこと(2013年～2015年)
- ③ 東証が企業の経営改革を促したことや、生成A I(人工知能)が新しい市場のテーマとなったこと(2023年～当期末)

下落要因

- ① 米国のサブプライムローン問題による世界的な信用収縮と景気後退への不安が高まったこと(2008年)
- ② 新型コロナウイルスの感染拡大により世界的に景気が悪化したこと(2020年1月～3月)

【投資環境】**＜国内株式市場＞**

当ファンドの運用開始から2007年までは、不良債権問題が解決に向かい始めたことをきっかけに日本経済が転換点を迎えたとの期待が膨らんだことなどで上昇相場となりました。ただし、2008年になると米国のサブプライムローン問題に端を発した世界的な信用収縮と景気不安によって、株式市場は急落しました。その後、しばらくは市場は低迷し続けましたが、大胆な金融政策、機動的な財政政策および民間投資を喚起する成長戦略を柱とするアベノミクスに対する期待から、2013年から2015年にかけて株式市場は大きく上昇しました。2020年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が悪化し市場が急落する局面もみられましたが、主要国の政府による政策が相次いで発表されたことから、市場は早期に回復を遂げました。2023年に入ると、東証が収益性の低い企業に対する経営改革を促したことや、生成AI（人工知能）という新しい市場のテーマなどによって市場センチメントが大きく改善し、国内株式市場は上昇基調のなかで運用期間を終えました。

【ポートフォリオ】**＜当ファンド＞**

当ファンドは、りそな・日本株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目標とします。信託期間を通じて、基本方針に基づきマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。なお、償還に向けて2024年2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。

＜りそな・日本株式インデックス・マザーファンド＞

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）（以下、TOPIX（配当込み））と連動する投資成果を目指すものです。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TOPIX（配当込み）の属性の変化や設定・解約による資金流入に対応し、ポートフォリオの見直しを随時行いました。また、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。2024年2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+194.2%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の騰落率（+136.5%）を57.7%上回る結果となりました。ファンド償還のために2024年2月7日にマザーファンドで保有する株式を売却した後は基準価額の変化は限定的なものとなりました。

プラス要因：当ファンドが投資しているりそな・日本株式インデックス・マザーファンド受益証券での保有株式の配当金や、東芝に対する株主集団訴訟に係る和解金の受け取りなどがプラスに影響しました。

マイナス要因：償還に向けて2024年2月7日にマザーファンドにおいて保有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ました。その他では、売買手数料や信託報酬等がマイナスに影響しました。

【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。

繰上償還にあたり、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20期 (2023年11月21日 ～2024年2月16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)	44円 (15) (22) (7)	0.159% (0.053) (0.079) (0.026)	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)	2 (1) (1)	0.007 (0.003) (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 (印 刷 費 用) (そ の 他)	11 (2) (9)	0.040 (0.007) (0.033)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	57	0.206	

期中の平均基準価額は28,040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。

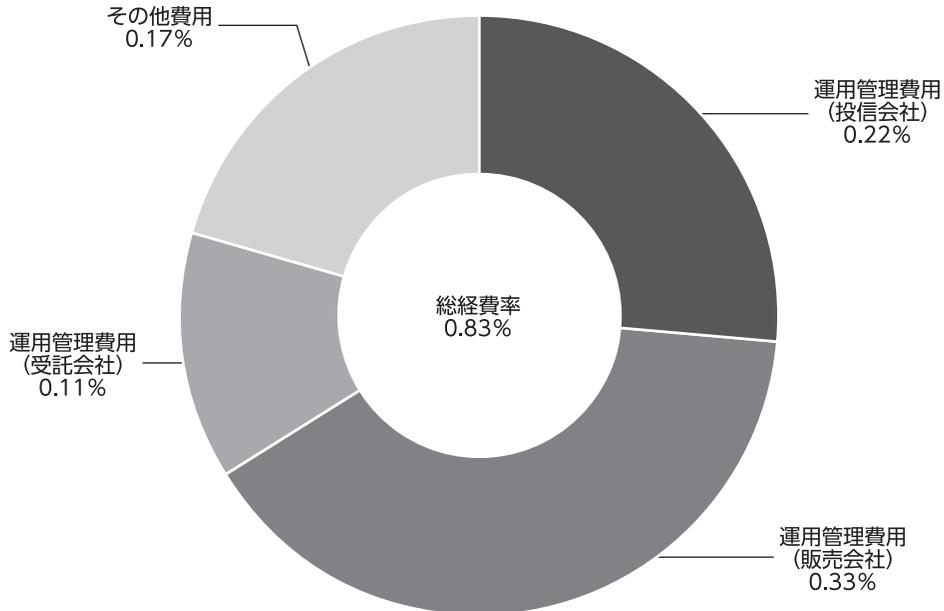
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.83%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（2023年11月21日から2024年2月16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
りそな・日本株式インデックス・マザーファンド	千口 65,482	千円 196,456	千口 474,778	千円 1,515,780

(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
	りそな・日本株式インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,275,292千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,072,731千円
(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。

■利害関係人との取引状況等（2023年11月21日から2024年2月16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（2024年2月16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：2023年11月20日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首（前期末）
	口 数
りそな・日本株式インデックス・マザーファンド	千口 409,296

(注) 単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2024年2月16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 955,460	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	955,460	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

(2024年2月16日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	955,460,959円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	955,460,959
(B) 負 債	15,211,443
未 払 解 約 金	13,327,315
未 払 信 託 報 酬	1,768,242
未 払 利 息	8,481
そ の 他 未 払 費 用	107,405
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	940,249,516
元 本	319,586,414
償 還 差 益 金	620,663,102
(D) 受 益 権 総 口 数	319,586,414口
1万口当たり償還価額(C/D)	29,420円82銭

(注記事項)

期首元本額

453,773,296円

期中追加設定元本額

140,441,430円

期中一部解約元本額

274,628,312円

■損益の状況

当期 (自2023年11月21日 至2024年2月16日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 10,022円
支 払 利 息	△ 10,022
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	70,144,361
売 買 益	83,459,248
売 買 損	△ 13,314,887
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,876,988
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	68,257,351
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	50,676,302
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	501,729,449
(配 当 等 相 当 額)	(467,050,246)
(売 買 損 益 相 当 額)	(34,679,203)
償 還 差 益 金(D+E+F)	620,663,102

(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	2004年11月19日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年2月16日		資産総額	955,460,959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	15,211,443円
受益権口数	52,143,988口	319,586,414口	267,442,426口	純資産総額	940,249,516円
元本額	52,143,988円	319,586,414円	267,442,426円	受益権口数	319,586,414口
				1万口当たり償還金	29,420.82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9期	1,594,257,678円	1,949,202,816円	12,226円	0円	0.0000%
第10期	1,332,544,150	1,863,372,846	13,984	0	0.0000
第11期	1,516,454,649	2,460,031,662	16,222	0	0.0000
第12期	1,515,294,022	2,248,137,751	14,836	0	0.0000
第13期	1,177,197,650	2,160,362,581	18,352	0	0.0000
第14期	1,440,578,706	2,496,744,050	17,332	0	0.0000
第15期	1,233,029,401	2,254,328,048	18,283	0	0.0000
第16期	1,165,085,145	2,204,570,969	18,922	0	0.0000
第17期	1,284,789,348	2,923,798,473	22,757	0	0.0000
第18期	647,337,389	1,440,735,493	22,256	0	0.0000
第19期	453,773,296	1,238,143,306	27,286	0	0.0000

■償還金のお知らせ

償還決算日	2024年2月16日
1万口当たりの償還金(税込み)	29,420円82銭

《お知らせ》

2023年11月29日(公告日)現在の受益者のみなさまを対象に信託終了(繰上償還)にかかる異議申立の受付を行いました。その結果、異議申立をされた受益者の受益権口数の合計が公告日における受益権総口数の2分の1を超えませんでしたので、2024年2月16日をもって信託を終了(繰上償還)することといたしました。

りそな・日本株式インデックス・マザーファンド

償還 運用報告書

《第23期》

償還日：2024年2月15日

(計算期間：2023年5月20日～2024年2月15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	2001年8月1日から2024年2月15日（当初：無期限）までです。
運用方針	当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
主要運用対象	日本の金融商品取引所上場株式
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。新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (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
19期(2020年5月19日)	17,509	△ 1.8	2,295.94	△ 1.9	98.1	1.9	4,278
20期(2021年5月19日)	22,823	30.4	2,988.76	30.2	97.4	2.5	3,005
21期(2022年5月19日)	22,939	0.5	3,002.88	0.5	95.8	4.1	2,997
22期(2023年5月19日)	27,269	18.9	3,587.44	19.5	96.8	3.5	1,123
(償還時)	(償還価額)						
23期(2024年2月15日)	32,668.84	19.8	4,356.86	21.4	—	—	942

(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) ベンチマークは東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) です。

東証株価指数 (TOPIX) とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。以下同じ。

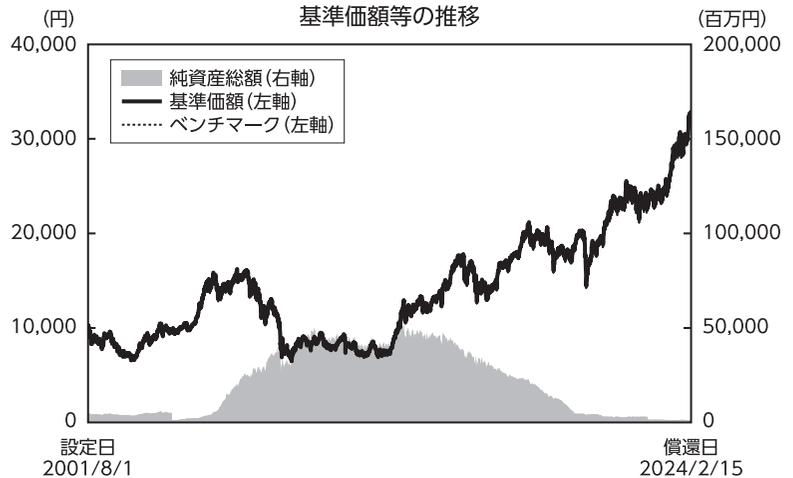
■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (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	%	%	%
2023年5月19日	27,269	—	3,587.44	—	96.8	3.5
5月末	26,878	△ 1.4	3,537.93	△ 1.4	98.5	1.8
6月末	28,900	6.0	3,805.00	6.1	93.4	6.6
7月末	29,341	7.6	3,861.80	7.6	98.5	1.7
8月末	29,466	8.1	3,878.51	8.1	98.0	2.1
9月末	29,639	8.7	3,898.26	8.7	90.2	9.8
10月末	28,728	5.4	3,781.64	5.4	95.2	4.7
11月末	30,277	11.0	3,986.65	11.1	92.9	6.9
12月末	30,352	11.3	3,977.63	10.9	98.5	1.5
2024年1月末	32,693	19.9	4,288.36	19.5	97.0	2.9
(償還時)	(償還価額)					
2024年2月15日	32,668.84	19.8	4,356.86	21.4	—	—

(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23期末 (償還日)	32,668円84銭
騰落率	226.7%



(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、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）です。

(注2) ベンチマークは、設定日（2001年8月1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 不良債権問題が解決に向かったことを背景に日本経済が好転すると期待が広がったこと（2003年半ば～2007年半ば）
- ② アベノミクスに対する期待が高まったこと（2013年～2015年）
- ③ 東証が企業の経営改革を促したことや、生成A I（人工知能）が新しい市場のテーマとなったこと（2023年～当期末）

下落要因

- ① 不良債権問題を背景にしたデフレが続いたこと（運用開始時～2003年半ば）
- ② サブプライムローン問題による世界的な信用収縮と景気後退への不安が高まったこと（2008年）
- ③ 新型コロナウイルスの感染拡大により世界的に景気が悪化したこと（2020年1月～3月）

【投資環境】

＜国内株式市場＞

当ファンドの運用が開始された2001年8月以降から2003年半ばまでは、不良債権問題を抱えた日本はデフレスパイラルに陥り厳しい状況が続きました。その後、2007年までは不良債権問題が解決に向かい始めたことをきっかけに日本経済が転換点を迎えたとの期待が膨らんだことなどで上昇相場となりました。ただし、2008年になると米国のサブプライムローン問題に端を発した世界的な信用収縮と景気不安によって、株式市場は急落しました。その後、しばらくは市場は低迷し続けましたが、大胆な金融政策、機動的な財政政策および民間投資を喚起する成長戦略を柱とするアベノミクスに対する期待から、2013年から2015年にかけて株式市場は大きく上昇しました。2020年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が悪化し市場が急落する局面もみられましたが、主要国の政府による政策が相次いで発表されたことから、市場は早期に回復を遂げました。2023年に入ると東証が収益性の低い企業に対する経営改革を促したことや、生成AI（人工知能）という新しい市場のテーマなどによって市場センチメントが大きく改善し、国内株式市場は上昇基調のなかで運用期間を終えました。

【ポートフォリオ】

当ファンドは、TOPIX（配当込み）と連動する投資成果を目指すものです。運用については、「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TOPIX（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。2024年2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】

当期の当ファンドの騰落率は+226.7%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の騰落率+227.4%を0.7%下回る結果となりましたが、ファンド償還のために2024年2月7日に保有する株式を売却するまでは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：償還に向けて2024年2月7日に保有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ました。その他では、売買手数料や信託報酬等がマイナスに影響しました。

プラス要因：東証に対する株主集団訴訟に係る和解金の受け取りなどがプラスに影響しました。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第23期 (2023年5月20日 ～2024年2月15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)	8円 (4) (4)	0.028% (0.014) (0.014)	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)	9 (9)	0.029 (0.029)	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	17	0.057	

期中の平均基準価額は29,586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 (2023年5月20日から2024年2月15日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 299 (134)	千円 605,724 (-)	千株 862	千円 1,881,308

(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 1,883	百万円 1,933	百万円 323	百万円 328

■ 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	2,487,033千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,147,535千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.16

(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 (2023年5月20日から2024年2月15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
トヨタ自動車	9.8	24,622	2,512	トヨタ自動車	29.2	86,213	2,952
キーエンス	0.3	18,296	60,986	ソニーグループ	3.8	52,304	13,764
ソニーグループ	1.3	16,254	12,503	キーエンス	0.7	44,518	63,597
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11.3	13,434	1,188	三菱UFJフィナンシャル・グループ	32.8	42,803	1,304
東京エレクトロン	0.5	10,220	20,441	東京エレクトロン	1.2	30,492	25,410
日本電信電話	57.5	9,758	169	日本電信電話	167.6	30,175	180
三菱商事	1.3	9,176	7,059	三菱商事	8.2	27,860	3,397
三井住友フィナンシャルグループ	1.2	8,336	6,946	三井住友フィナンシャルグループ	3.7	27,159	7,340
伊藤忠商事	1.5	8,163	5,442	日立製作所	2.4	26,267	10,944
HOYA	0.5	7,978	15,956	任天堂	3.4	25,759	7,576

(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 (2023年5月20日から2024年2月15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 (2024年2月15日現在)

償還日現在、有価証券の組入はありません。

(前期末：2023年5月19日現在)

(1) 国内株式

銘 柄	期 首(前期末)	銘 柄	期 首(前期末)	銘 柄	期 首(前期末)
	株 数		株 数		株 数
	千株		千株		千株
水産・農林業		大林組	1.2	大和ハウス工業	1
ニッセイ	0.6	清水建設	1.1	ライト工業	0.1
マルハニチロ	0.1	飛島建設	0.2	積水ハウス	1.1
サカタのタネ	0.1	長谷工コーポレーション	0.3	ユアテック	0.1
鉱業		鹿島建設	0.7	中電工	0.1
INPEX	1.7	鉄建建設	0.1	関電工	0.3
石油資源開発	0.1	西松建設	0.1	きんでん	0.2
建設業		三井住友建設	0.7	住友電設	0.1
ショーボンドホールディングス	0.1	奥村組	0.1	日本電設工業	0.1
ミライト・ワン	0.1	東鉄工業	0.1	エクシオグループ	0.1
安藤・間	0.4	戸田建設	0.2	九電工	0.1
東急建設	0.2	熊谷組	0.1	三機工業	0.2
コムシスホールディングス	0.2	五洋建設	0.7	日揮ホールディングス	0.3
ピーアールホールディングス	0.1	世紀東急工業	0.2	中外炉工業	0.1
オリエンタル白石	0.6	住友林業	0.2	高砂熟学工業	0.1
大成建設	0.3	巴コーポレーション	0.1	明星工業	0.2

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株		株数	千株		株数	千株
ダイダシ		0.1	デサント		0.1	artience		0.1
インフロンア・ホールディングス		0.3	バルブ・紙			富士フィルムホールディングス		0.7
食料品			王子ホールディングス		1.5	資生堂		0.7
ニッポン		0.2	北越コーポレーション		0.3	ライオン		0.4
日清製粉グループ本社		0.4	大王製紙		0.1	高砂香料工業		0.1
昭和産業		0.1	レンゴー		0.4	ミルボン		0.1
中部飼料		0.2	化学			ファンケル		0.1
フィード・ワン		0.1	北の達人コーポレーション		0.2	コーセー		0.1
森永製菓		0.1	クラレ		0.5	ポーラ・オルビスホールディングス		0.1
江崎グリコ		0.1	旭化成		2.2	アジュバンホールディングス		0.2
不二家		0.1	共和レザー		0.3	長谷川香料		0.1
山崎製パン		0.2	レゾナック・ホールディングス		0.3	星光PMC		0.1
カルビー		0.2	住友化学		2.2	小林製菓		0.1
森永乳業		0.1	日産化学		0.2	タカラバイオ		0.2
ヤクルト本社		0.2	東ソー		0.5	JCU		0.1
明治ホールディングス		0.4	トクヤマ		0.2	デクセリアルズ		0.1
雪印メグミルク		0.1	セントラル硝子		0.1	有沢製作所		0.1
プリマハム		0.1	東亜合成		0.3	日東電工		0.3
日本ハム		0.1	デンカ		0.1	レック		0.1
丸大食品		0.1	信越化学工業		2.9	信越ポリマー		0.1
S Foods		0.1	堺化学工業		0.1	ニフコ		0.1
伊藤ハム米久ホールディングス		0.4	エア・ウォーター		0.3	ユニ・チャーム		0.7
サッポロホールディングス		0.1	日本酸素ホールディングス		0.3	医薬品		
アサヒグループホールディングス		0.8	日本触媒		0.1	協和キリン		0.4
キリンホールディングス		1.6	カネカ		0.1	武田薬品工業		3.1
宝ホールディングス		0.1	三菱瓦斯化学		0.3	アステラス製薬		3.4
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス		0.4	三井化学		0.3	住友ファーマ		0.3
サントリー食品インターナショナル		0.2	JSR		0.3	塩野義製薬		0.4
伊藤園		0.1	東京応化工業		0.1	日本新薬		0.1
キーコーヒー		0.1	大阪有機化学工業		0.1	中外製薬		1.1
日清オイリオグループ		0.1	三菱ケミカルグループ		2.5	科研製薬		0.1
不二製油グループ本社		0.1	KHネオケム		0.1	エーザイ		0.4
キッコーマン		0.2	ダイセル		0.6	ロート製薬		0.3
味の素		0.8	住友ベークライト		0.1	小野薬品工業		0.7
キューピー		0.2	積水化学工業		0.7	久光製薬		0.1
ハウス食品グループ本社		0.1	日本ゼオン		0.2	参天製薬		0.5
カゴメ		0.2	アイカ工業		0.1	ツムラ		0.1
ニチレイ		0.2	UBE		0.2	キッセイ薬品工業		0.1
東洋水産		0.2	タキロンシーアイ		0.2	栄研化学		0.1
日清食品ホールディングス		0.1	ニチバン		0.1	JCRファーマ		0.1
日本たばこ産業		2.3	積水化成工業		0.2	東和薬品		0.1
ケンコーマヨネーズ		0.1	タイガースポリマー		0.1	そーせいグループ		0.1
わらべや日洋ホールディングス		0.1	ダイキョーニシカワ		0.2	第一三共		3.1
ファーマフーズ		0.1	日本化薬		0.3	杏林製薬		0.1
ユーグレナ		0.3	カーリットホールディングス		0.3	大幸薬品		0.1
繊維製品			トリケミカル研究所		0.1	ダイト		0.1
東洋紡		0.2	ADEKA		0.2	大塚ホールディングス		0.8
ユニチカ		0.4	日油		0.1	大正製薬ホールディングス		0.1
帝国繊維		0.1	新日本理化		0.1	ペプチドリーム		0.2
帝人		0.3	花王		0.9	サワイグループホールディングス		0.1
東レ		2.4	日本ペイントホールディングス		1.6	石油・石炭製品		
ワコールホールディングス		0.1	関西ペイント		0.3	日本コークス工業		0.8
ホギメディカル		0.1	日本特殊塗料		0.2	富士石油		0.3
T S Iホールディングス		0.2	DIC		0.1	出光興産		0.4
ゴールドウイン		0.1	サカタインクス		0.2	ENEOSホールディングス		6

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株		株数	千株		株数	千株
コスモエネルギーホールディングス		0.1	SUMCO		0.7	理想科学工業		0.1
ゴム製品			東洋製糖グループホールディングス		0.3	SANKYO		0.1
横浜ゴム		0.2	三和ホールディングス		0.4	竹内製作所		0.1
TOYO TIRE		0.3	三協立山		0.1	アマノ		0.1
ブリヂストン		1.1	LIXIL		0.6	JUKI		0.4
住友ゴム工業		0.2	リンナイ		0.2	サンデン		0.5
藤倉コンポジット		0.1	東プレ		0.2	マックス		0.1
三ツ星ベルト		0.1	モリテック スチール		0.4	グローリー		0.1
バンドー化学		0.1	日本発條		0.5	セガサミーホールディングス		0.3
ガラス・土石製品			機械			ツバキ・ナカシマ		0.1
日東紡績		0.1	日本製鋼所		0.1	ホシザキ		0.2
AGC		0.4	三浦工業		0.2	日本精工		0.8
日本板硝子		0.4	タクマ		0.1	NTN		0.9
日本電気硝子		0.1	ツガミ		0.1	ジェイテクト		0.4
オハラ		0.1	芝浦機械		0.1	THK		0.2
住友大阪セメント		0.1	アマダ		0.5	前澤工業		0.1
太平洋セメント		0.2	FUJI		0.2	キッツ		0.1
日本ヒューム		0.3	オーエスジー		0.2	マキタ		0.4
日本コンクリート工業		0.8	ダイジェット工業		0.1	三井E&S		0.5
アジアパイルホールディングス		0.1	旭ダイヤモンド工業		0.2	日立造船		0.2
東海カーボン		0.2	DMG森精機		0.3	三菱重工業		0.6
TOTO		0.2	ディスコ		0.2	IHI		0.2
日本碍子		0.4	日進工具		0.1	電気機器		
日本特殊陶業		0.3	バンチ工業		0.4	日清紡ホールディングス		0.3
ダントーホールディングス		0.1	オプトラン		0.1	イビデン		0.2
ヨータイ		0.1	フリュー		0.1	コニカミノルタ		0.5
ニチアス		0.1	ヤマシンフィルタ		0.7	ブラザー工業		0.4
ニチハ		0.1	タツモ		0.1	ミネベアミツミ		0.6
鉄鋼			ナブテスコ		0.2	日立製作所		1.7
日本製鉄		1.6	三井海洋開発		0.1	東芝		0.7
神戸製鋼所		0.9	レオン自動車		0.2	三菱電機		3.6
JFEホールディングス		1	SMC		0.1	富士電機		0.2
大和工業		0.1	サトーホールディングス		0.1	安川電機		0.4
淀川製鋼所		0.1	技研製作所		0.1	明電舎		0.1
丸一鋼管		0.1	日本エアーテック		0.1	マブチモーター		0.1
日本金属		0.1	小松製作所		1.7	ニデック		0.9
三菱製鋼		0.1	住友重機械工業		0.2	ダブル・スコープ		0.1
シンニッタン		0.7	日立建機		0.1	ヤーマン		0.1
非鉄金属			井関農機		0.2	JVCケンウッド		0.4
日本軽金属ホールディングス		0.2	TOWA		0.1	オムロン		0.3
三井金属鉱業		0.1	クボタ		1.9	ジューズ・ユアサ コーポレーション		0.1
三菱マテリアル		0.2	月島ホールディングス		0.2	日本電気		0.5
住友金属鉱山		0.4	新東工業		0.1	富士通		0.4
DOWAホールディングス		0.1	澁谷工業		0.1	ルネサスエレクトロニクス		2.3
古河機械金属		0.1	小森コーポレーション		0.1	セイコーエプソン		0.4
大阪チタニウムテクノロジーズ		0.1	荏原製作所		0.1	ワコム		0.4
東邦チタニウム		0.1	ダイキン工業		0.4	アルバック		0.1
UACJ		0.1	オルガノ		0.1	アクセル		0.1
古河電気工業		0.1	栗田工業		0.2	ジャパンディスプレイ		1.6
住友電気工業		1.3	椿本チエイン		0.1	能美防災		0.1
フジクラ		0.4	ダイフク		0.6	パナソニック ホールディングス		4.1
タツタ電線		0.2	タダノ		0.4	シャープ		0.2
AREホールディングス		0.1	フジテック		0.1	アンリツ		0.3
金属製品			CKD		0.2	富士通ゼネラル		0.1
トーカロ		0.2	平和		0.1	ソニーグループ		2.5

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株		株数	千株		株数	千株
TDK	0.6	0.6	NOK	0.2	0.2	中部電力	1.3	1.3
アルプスアルパイン	0.2	0.2	フタバ産業	0.3	0.3	関西電力	1.4	1.4
ティアック	1.2	1.2	プレス工業	0.2	0.2	中国電力	0.6	0.6
ヒロセ電機	0.1	0.1	アイシン	0.3	0.3	北陸電力	0.5	0.5
日本航空電子工業	0.1	0.1	マツダ	1.3	1.3	東北電力	0.6	0.6
横河電機	0.4	0.4	本田技研工業	2.9	2.9	四国電力	0.5	0.5
アズビル	0.2	0.2	スズキ	0.6	0.6	九州電力	0.8	0.8
日本光電工業	0.2	0.2	SUBARU	1.2	1.2	北海道電力	0.5	0.5
堀場製作所	0.1	0.1	ヤマハ発動機	0.6	0.6	沖縄電力	0.2	0.2
アドバンテスト	0.3	0.3	豊田合成	0.1	0.1	電源開発	0.3	0.3
キーエンス	0.4	0.4	愛三工業	0.2	0.2	イーレックス	0.1	0.1
シスメックス	0.3	0.3	シマノ	0.1	0.1	レノバ	0.1	0.1
コーセル	0.1	0.1	テイ・エス テック	0.1	0.1	東京瓦斯	0.7	0.7
オープンテックスグループ	0.1	0.1	精密機器			大阪瓦斯	0.7	0.7
レーザーテック	0.2	0.2	テルモ	1.1	1.1	東邦瓦斯	0.1	0.1
スタンレー電気	0.2	0.2	日本エム・ディ・エム	0.1	0.1	西部ガスホールディングス	0.1	0.1
ウシオ電機	0.2	0.2	島津製作所	0.4	0.4	陸運業		
岡谷電機産業	0.5	0.5	長野計器	0.1	0.1	東武鉄道	0.4	0.4
古河電池	0.1	0.1	インターアクション	0.1	0.1	相鉄ホールディングス	0.1	0.1
日本電子	0.1	0.1	オーバル	0.1	0.1	東急	0.9	0.9
カシオ計算機	0.1	0.1	東京精密	0.1	0.1	京浜急行電鉄	0.4	0.4
ファナック	1.7	1.7	マニー	0.2	0.2	小田急電鉄	0.6	0.6
ローム	0.2	0.2	ニコン	0.4	0.4	京王電鉄	0.2	0.2
浜松ホトニクス	0.3	0.3	トプコン	0.2	0.2	京成電鉄	0.2	0.2
新光電気工業	0.1	0.1	オリンパス	2.1	2.1	東日本旅客鉄道	0.6	0.6
京セラ	0.5	0.5	HOYA	0.8	0.8	西日本旅客鉄道	0.4	0.4
太陽誘電	0.2	0.2	朝日インテック	0.4	0.4	東海旅客鉄道	0.3	0.3
村田製作所	1.1	1.1	シチズン時計	0.5	0.5	西武ホールディングス	0.3	0.3
日本ケミコン	0.1	0.1	メニコン	0.1	0.1	鴻池運輸	0.1	0.1
KOA	0.1	0.1	ニプロ	0.1	0.1	西日本鉄道	0.1	0.1
小糸製作所	0.4	0.4	その他製品			近鉄グループホールディングス	0.4	0.4
ミツバ	0.2	0.2	パラマウントベッドホールディングス	0.1	0.1	阪急阪神ホールディングス	0.5	0.5
SCREENホールディングス	0.1	0.1	バンダイナムコホールディングス	0.9	0.9	南海電気鉄道	0.2	0.2
キャノン	1.9	1.9	SHOEI	0.1	0.1	京阪ホールディングス	0.2	0.2
リコー	0.7	0.7	パイロットコーポレーション	0.1	0.1	名古屋鉄道	0.4	0.4
象印マホービン	0.1	0.1	萩原工業	0.1	0.1	アルプス物流	0.2	0.2
MUTOHホールディングス	0.1	0.1	フジシールインターナショナル	0.1	0.1	ヤマトホールディングス	0.5	0.5
東京エレクトロン	0.7	0.7	タカラトミー	0.2	0.2	山九	0.1	0.1
輸送用機器			TOPPANホールディングス	0.5	0.5	ニッコンホールディングス	0.1	0.1
トヨタ紡織	0.1	0.1	大日本印刷	0.4	0.4	セイノーホールディングス	0.3	0.3
ユニプレス	0.2	0.2	NISSHA	0.1	0.1	AZ-COM丸和ホールディングス	0.1	0.1
豊田自動織機	0.3	0.3	光村印刷	0.1	0.1	C&Fロジホールディングス	0.1	0.1
モリタホールディングス	0.1	0.1	TAKARA & COMPANY	0.1	0.1	九州旅客鉄道	0.3	0.3
三櫻工業	0.1	0.1	アシックス	0.3	0.3	SGホールディングス	0.6	0.6
デンソー	0.7	0.7	小松ウオール工業	0.1	0.1	NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	0.1
東海理化電機製作所	0.2	0.2	ヤマハ	0.2	0.2	海運業		
川崎重工業	0.3	0.3	ビジョン	0.2	0.2	日本郵船	1	1
日産自動車	5.2	5.2	リンテック	0.1	0.1	商船三井	0.6	0.6
いすゞ自動車	1	1	イトーキ	0.3	0.3	川崎汽船	0.3	0.3
トヨタ自動車	19.4	19.4	任天堂	2.2	2.2	飯野海運	0.1	0.1
日野自動車	0.1	0.1	三菱鉛筆	0.1	0.1	空運業		
三菱自動車工業	1.6	1.6	タカラスタンダード	0.1	0.1	日本航空	0.8	0.8
武蔵精密工業	0.2	0.2	コクヨ	0.1	0.1	ANAホールディングス	1	1
新明和工業	0.1	0.1	電気・ガス業			倉庫・運輸関連業		
タチエス	0.2	0.2	東京電力ホールディングス	3	3	日新	0.1	0.1

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株	数		株	数		株	数
		千株			千株			千株
三菱倉庫	0.1		オービックビジネスコンサルタント	0.1		フルサト・マルカホールディングス	0.1	
住友倉庫	0.1		伊藤忠テクノソリューションズ	0.2		中山福	0.5	
澁澤倉庫	0.1		大塚商会	0.2		ナガイレーベン	0.1	
上組	0.2		サイボウズ	0.1		第一興商	0.2	
情報・通信業			デジタルガレージ	0.1		メディバルホールディングス	0.4	
NECネットエスアイ	0.1		EMシステムズ	0.1		アズワン	0.1	
システナ	0.8		C I J	0.2		ハビネット	0.1	
日鉄ソリューションズ	0.1		日本エンタープライズ	0.7		日本ライフライン	0.1	
キューブシステム	0.1		WOWOW	0.2		I D O M	0.2	
ラクーンホールディングス	0.1		ネットワンシステムズ	0.1		進和	0.1	
T I S	0.4		エイベックス	0.1		伊藤忠商事	2.3	
コーエーテックモホールディングス	0.3		B I P R O G Y	0.1		丸紅	2.8	
ボルテージ	0.3		T B S ホールディングス	0.1		長瀬産業	0.2	
ファインデックス	0.1		日本テレビホールディングス	0.2		蝶理	0.1	
K L a b	0.1		スカパーJ S A Tホールディングス	0.3		豊田通商	0.3	
ネクソン	0.9		テレビ東京ホールディングス	0.1		兼松	0.2	
アイスタイル	0.4		ビジョン	0.1		三井物産	2.6	
エニグモ	0.1		日本通信	0.6		山善	0.2	
e n i s h	0.3		日本電信電話	4.5		住友商事	2.3	
コプロ	0.4		K D D I	2.7		三菱商事	2.3	
オルトプラス	0.2		ソフトバンク	5.6		キャノンマーケティングジャパン	0.1	
ブロードリーフ	0.7		エムティーアイ	0.3		菱洋エレクトロ	0.1	
デジタルハーツホールディングス	0.1		G M O インターネットグループ	0.2		トルク	0.7	
メディアドゥ	0.1		K A D O K A W A	0.2		阪和興業	0.1	
ブイキューブ	0.1		学研ホールディングス	0.2		岩谷産業	0.1	
フィックスターズ	0.2		ゼンリン	0.1		アステナホールディングス	0.5	
ティーガイア	0.1		昭文社ホールディングス	0.5		三愛オプリー	0.1	
テクマトリックス	0.1		東宝	0.2		稲畑産業	0.1	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.1		N T T データグループ	1.1		ワキタ	0.1	
G M O ベイメントゲートウェイ	0.1		D T S	0.1		東邦ホールディングス	0.1	
ザッパラス	0.1		スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.2		サンゲツ	0.1	
インターネットイニシアティブ	0.2		カプコン	0.4		伊藤忠エネクス	0.1	
e B A S E	0.1		ジャステック	0.2		サンリオ	0.1	
コムチュア	0.1		S C S K	0.2		リョーサン	0.1	
メディカル・データ・ビジョン	0.1		T K C	0.1		新光商事	0.1	
g u m i	0.1		N S D	0.1		モスフードサービス	0.1	
ラクス	0.2		コナミグループ	0.2		P A L T A C	0.1	
チェンジホールディングス	0.1		J B C C ホールディングス	0.1		トラスコ中山	0.1	
オロ	0.1		ミロク情報サービス	0.1		オートバックスセブン	0.2	
マネーフワード	0.1		ソフトバンクグループ	1.7		加藤産業	0.1	
野村総合研究所	0.7		卸売業			イエローハット	0.1	
ソースネクスト	0.2		エレマテック	0.1		因幡電機産業	0.1	
インフォコム	0.1		円谷フィールズホールディングス	0.1		ミスミグループ本社	0.6	
ラクスル	0.2		双日	0.4		スズケン	0.1	
メルカリ	0.2		アルフレッサ ホールディングス	0.3		小売業		
S a n s a n	0.1		神栄	0.1		ローソン	0.1	
J M D C	0.1		アルコニックス	0.2		エービーシー・マート	0.1	
フジ・メディア・ホールディングス	0.5		神戸物産	0.3		くら寿司	0.1	
オービック	0.1		あい ホールディングス	0.1		エディオン	0.1	
ジャストシステム	0.1		ダイワボウホールディングス	0.1		サーラコーポレーション	0.1	
L I N E ヤフー	5.6		マクニカホールディングス	0.1		ワッツ	0.1	
トレンドマイクロ	0.2		パイタルケ-エスケ-ホールディングス	0.1		クオールホールディングス	0.2	
日本オラクル	0.1		T O K A I ホールディングス	0.3		ビックカメラ	0.3	
フューチャー	0.2		シップヘルスケアホールディングス	0.2		D C M ホールディングス	0.2	
C A C H o l d i n g s	0.1		コメダホールディングス	0.1		ベッパーフードサービス	0.5	

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株	数		株	数		株	数
MonotaRO		千株	吉野家ホールディングス		千株	いちよし証券		千株
J. フロント リテイリング	0.5		アークス	0.2		松井証券	0.2	0.2
マツキヨココカラ&カンパニー	0.5		ファーストリテイリング	0.1		マネックスグループ	0.2	0.7
ZOZO	0.2		サンドラッグ	0.2		保険業		
物語コーポレーション	0.3		銀行業	0.1		かんぽ生命保険	0.5	0.5
三越伊勢丹ホールディングス	0.1		いよぎんホールディングス	0.7		SOMPOホールディングス	0.6	0.6
ウエルシアホールディングス	0.7		しずおかフィナンシャルグループ	0.7		MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.7	0.7
クリエイトSDホールディングス	0.2		ちゅうぎんフィナンシャルグループ	0.4		第一生命ホールディングス	1.7	1.7
オイシックス・ラ・大地	0.1		じもとホールディングス	0.2		東京海上ホールディングス	3.4	3.4
ネクステージ	0.1		めぶきフィナンシャルグループ	1.7		T&Dホールディングス	1	1
ジョイフル本田	0.1		九州フィナンシャルグループ	1		その他金融業		
すかいらーくホールディングス	0.2		ゆうちょ銀行	0.9		全国保証	0.1	0.1
あさひ	0.4		富山第一銀行	0.1		ジェイリース	0.1	0.1
日本調剤	0.1		コンソルディア・フィナンシャルグループ	1.5		SBIアルヒ	0.1	0.1
セブン&アイ・ホールディングス	0.1		西日本フィナンシャルホールディングス	0.1		クレディセゾン	0.3	0.3
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1.3		第四北越フィナンシャルグループ	0.1		みずほリース	0.1	0.1
ツルハホールディングス	0.3		ひろぎんホールディングス	0.1		東京センチュリー	0.1	0.1
フェリシモ	0.1		十六フィナンシャルグループ	0.1		日本証券金融	0.2	0.2
トリドールホールディングス	0.2		SBI新生銀行	0.1		アイフル	1.1	1.1
TOKYO BASE	0.1		あおぞら銀行	0.3		イオンフィナンシャルサービス	0.3	0.3
FOOD & LIFE COMPANIES	0.2		三菱UFJフィナンシャル・グループ	21.5		オリックス	2.2	2.2
ジャパンクラフトホールディングス	0.1		りそなホールディングス	4.1		三菱HCキャピタル	1.4	1.4
良品計画	0.2		三井住友トラスト・ホールディングス	0.6		日本取引所グループ	1	1
コジマ	0.5		三井住友フィナンシャルグループ	2.5		不動産業		
コーナン商事	0.3		千葉銀行	0.9		大東建託	0.1	0.1
ワタミ	0.1		群馬銀行	0.9		いちご	0.6	0.6
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	0.1		武蔵野銀行	0.1		日本駐車場開発	1.2	1.2
西松屋チェーン	0.8		七十七銀行	0.2		ヒューリック	0.7	0.7
ゼンショーホールディングス	0.1		ふくおかフィナンシャルグループ	0.3		野村不動産ホールディングス	0.2	0.2
サイゼリヤ	0.2		スルガ銀行	0.5		三重交通グループホールディングス	0.1	0.1
YU-WA Creation Holdings	0.1		八十二銀行	0.4		サムディ	0.1	0.1
コロワイド	0.7		福井銀行	0.1		ディア・ライフ	0.3	0.3
スギホールディングス	0.1		滋賀銀行	0.1		地主	0.1	0.1
スクロール	0.1		南都銀行	0.1		フージャースホールディングス	0.2	0.2
ヨンドシーホールディングス	0.2		百五銀行	0.6		オープンハウスグループ	0.1	0.1
木曾路	0.1		京都銀行	0.1		東急不動産ホールディングス	0.9	0.9
タカキュー	2		紀陽銀行	0.1		飯田グループホールディングス	0.3	0.3
上新電機	0.1		ほくほくフィナンシャルグループ	0.1		パーク24	0.3	0.3
日本瓦斯	0.2		山陰合同銀行	0.3		三井不動産	1.5	1.5
ロイヤルホールディングス	0.1		阿波銀行	0.1		三菱地所	2.2	2.2
東天紅	0.1		大分銀行	0.1		平和不動産	0.1	0.1
ライフコーポレーション	0.2		セブン銀行	1.8		東京建物	0.3	0.3
リンガーハット	0.1		みずほフィナンシャルグループ	5		京阪神ビルディング	0.2	0.2
コメリ	0.1		山口フィナンシャルグループ	0.6		住友不動産	0.6	0.6
高島屋	0.1		北洋銀行	1.2		レオパレス21	1	1
エイチ・ツー・オー リテイリング	0.3		愛媛銀行	0.2		スターツコーポレーション	0.1	0.1
丸井グループ	0.2		証券・商品先物取引業			エスリード	0.1	0.1
イオン	0.3		FPG	0.2		イオンモール	0.1	0.1
イズミ	1.2		SBIホールディングス	0.5		カチタス	0.1	0.1
ゼビオホールディングス	0.1		ジャフコグループ	0.2		トーセイ	0.1	0.1
ケーブホールディングス	0.1		大和証券グループ本社	2.3		サンフロンティア不動産	0.2	0.2
アインホールディングス	0.1		野村ホールディングス	6		FJネクストホールディングス	0.2	0.2
ヤマダホールディングス	0.1		岡三証券グループ	0.5		日本空港ビルデング	0.1	0.1
ニトリホールディングス	1.8		丸三証券	0.3		サービス業		
愛眼	0.2		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	0.6		MI XI	0.1	0.1

銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)		銘柄	期首(前期末)	
	株数	千株		株数	千株		株数	千株
日本M&Aセンターホールディングス	0.5	0.5	オリエンタルランド	1.9	1.9	トランス・コスモス	0.1	0.1
UTグループ	0.1	0.1	ダスキン	0.1	0.1	乃村工藝社	0.2	0.2
オープンアップグループ	0.2	0.2	ラウンドワン	0.3	0.3	トーカイ	0.1	0.1
リンクアンドモチベーション	0.1	0.1	リゾートトラスト	0.2	0.2	セコム	0.4	0.4
エス・エム・エス	0.1	0.1	ビー・エム・エル	0.1	0.1	メイテックグループホールディングス	0.2	0.2
パーソルホールディングス	0.4	0.4	ユー・エス・エス	0.4	0.4	船井総研ホールディングス	0.1	0.1
エスクリ	0.4	0.4	サイバーエージェント	0.7	0.7	ベネッセホールディングス	0.2	0.2
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.1	0.1	楽天グループ	1.8	1.8	イオンディライト	0.1	0.1
総合警備保障	0.1	0.1	クリーク・アンド・リバー社	0.1	0.1	ダイセキ	0.1	0.1
カカココム	0.3	0.3	エン・ジャパン	0.1	0.1	合計	株数	428
アイロムグループ	0.1	0.1	テクノプロ・ホールディングス	0.2	0.2	銘柄数	905	
ディップ	0.1	0.1	アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	0.1			
新日本科学	0.1	0.1	ジャパンマテリアル	0.1	0.1			
ベネフィット・ワン	0.2	0.2	ベクトル	0.1	0.1			
エムスリー	0.7	0.7	アサンテ	0.1	0.1			
ツカダ・グローバルホールディング	0.1	0.1	メドピア	0.1	0.1			
アウトソーシング	0.2	0.2	リクルートホールディングス	2.7	2.7			
ディー・エヌ・エー	0.1	0.1	日本郵政	4.6	4.6			
博報堂DYホールディングス	0.5	0.5	エアトリ	0.1	0.1			
ファンコミュニケーションズ	0.1	0.1	ソラスト	0.3	0.3			
ティア	0.5	0.5	ベイカレント・コンサルティング	0.3	0.3			
アドウェイズ	0.1	0.1	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.2	0.2			
バリューコマース	0.1	0.1	カープスホールディングス	0.1	0.1			
インフォマート	0.9	0.9	リロググループ	0.2	0.2			
J Pホールディングス	0.6	0.6	TREホールディングス	0.2	0.2			
プレステージ・インターナショナル	0.3	0.3	エイチ・アイ・エス	0.2	0.2			
電通グループ	0.4	0.4	共立メンテナンス	0.1	0.1			
H. U. グループホールディングス	0.1	0.1	カナモト	0.1	0.1			

(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
TOPIX	43	—
ミニTOPIX	—	4

(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 (2024年2月15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	953,187	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	953,187	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

(2024年2月15日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	953,187,579円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	953,187,579
(B) 負 債	10,210,820
未 払 解 約 金	10,208,000
未 払 利 息	2,820
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	942,976,759
元 本	288,647,167
償 還 差 益 金	654,329,592
(D) 受 益 権 総 口 数	288,647,167口
1 万 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	32,668円84銭

(注記事項)

期首元本額	411,900,744円
期中追加設定元本額	380,985,496円
期中一部解約元本額	504,239,073円

(償還時元本の内訳)

りそな・TOPIXオープン	288,647,167円
---------------	--------------

■損益の状況

当期 (自2023年5月20日 至2024年2月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	20,623,748円
受 取 配 当 金	15,059,263
そ の 他 収 益 金	5,615,674
支 払 利 息	△ 51,189
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	188,134,758
売 買 益	229,647,378
売 買 損	△ 41,512,620
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	6,187,020
取 引 益	16,628,920
取 引 損	△ 10,441,900
(D) そ の 他 費 用 等	△ 350,894
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	214,594,632
(F) 前期繰越損益金	711,323,383
(G) 追加信託差損益金	727,711,504
(H) 解約差損益金	△999,299,927
償還差益金 (E + F + G + H)	654,329,592

(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、2024年2月15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。