

受益者の皆さまへ



平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて「GTグローバル インベストメント・オープン」は、2024年8月28日に第56期の決算を行いました。ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

GTグローバル インベストメント・オープン 追加型投信／内外／資産複合

*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／内外／資産複合
信託期間	2025年8月28日まで
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・日本を含む世界各国の株式・債券の中から、企業の収益性、成長性、安定性、割安度などを総合的に勘案して選定した銘柄に分散投資を行い、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。・インベスコ・アセット・マネジメント・ドイチェランドGmbHに運用の指図に関する権限を委託します。
主要運用対象	内外の株式（DR（預託証券）を含みます。）・債券を主要投資対象とします。
組入制限	<ul style="list-style-type: none">・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割合には制限を設けません。
分配方針	原則として年2回の毎決算時（2・8月の各28日、該当日が休業日の場合は翌営業日）に委託会社が、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して分配を行います。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。



運用報告書（全体版）

第56期
(決算日 2024年8月28日)

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

インベスコ・アセット・マネジメント株式会社
お問い合わせダイヤル

電話番号：(03) 6447-3100

受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時

インベスコ・アセット・マネジメント

東京都港区六本木六丁目10番1号六本木ヒルズ森タワー14階

<https://www.invesco.com/jp/ja/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配)	標準価額		MSCIワールド・インデックス (税引後配当込み、円ヘッジベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
		税金 分配	み 騰落	期 騰落	中 騰落				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
52期(2022年8月29日)	9,560	0	△3.8	26,864	△8.7	99.5	—	1.2	1,915
53期(2023年2月28日)	9,732	0	1.8	26,565	△1.1	98.2	—	1.3	1,906
54期(2023年8月28日)	10,134	0	4.1	28,065	5.6	100.6	—	0.2	1,894
55期(2024年2月28日)	11,690	0	15.4	30,977	10.4	99.3	—	0.1	2,077
56期(2024年8月28日)	12,642	0	8.1	32,943	6.3	94.6	—	—	2,158

(注) 基準価額は1万口当たりです。

(注) 当ファンドのベンチマークは、設定日から2023年11月21日までは「MSCIワールド・インデックス (円ヘッジベース)」、2023年11月22日以降は「MSCIワールド・インデックス (税引後配当込み、円ヘッジベース)」に変更しています。ベンチマークは指数化し、結合したものを掲載しています。以下、同じです。

(注) ベンチマークは、MSCI Inc. が公表するMSCIワールド・インデックス (税引後配当込み、円ヘッジベース) をもとに設定日を10,000として、当社が独自に指数化しています。MSCIワールド・インデックスは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に関する著作権、その他の知的財産権はMSCI Inc. に帰属しています。ベンチマークは、今後、他の指数へ変更されることがあります。以下同じです。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	標準価額		MSCIワールド・インデックス (税引後配当込み、円ヘッジベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 組入比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首) 2024年2月28日	円 11,690	% —	% —	% 30,977	% —	% 99.3	% —	% 0.1
2月末	11,677	△0.1	0.4	31,095	0.4	99.6	—	0.1
3月末	12,405	6.1	3.4	32,027	3.4	98.9	—	0.1
4月末	12,166	4.1	△0.5	30,832	△0.5	101.7	—	0.1
5月末	12,481	6.8	3.2	31,955	3.2	99.2	—	0.1
6月末	12,647	8.2	5.2	32,585	5.2	101.6	—	0.1
7月末	12,449	6.5	6.0	32,841	6.0	94.9	—	0.1
(期末) 2024年8月28日	円 12,642	% 8.1	% 6.3	% 32,943	% 6.3	% 94.6	% —	% —

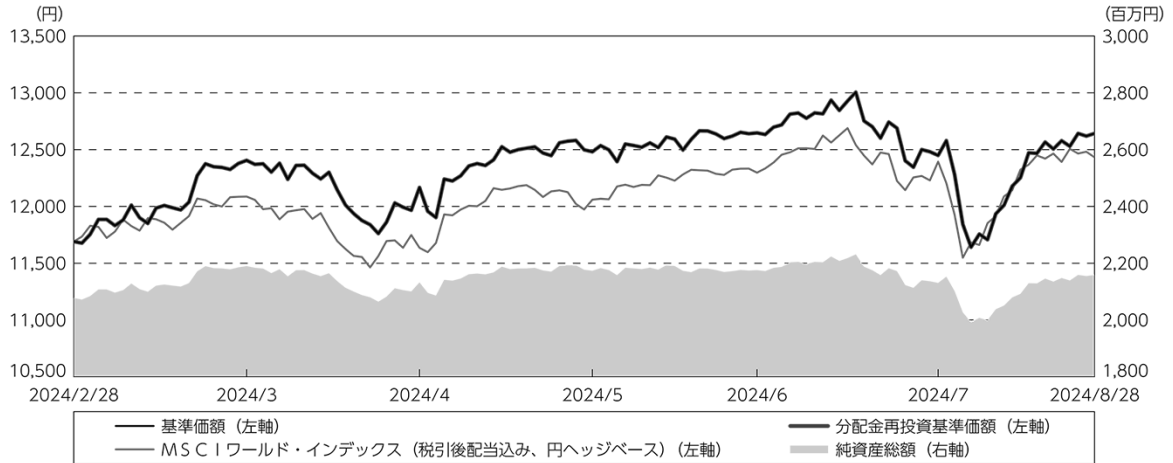
(注) 基準価額は1万口当たりです。

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

期中の基準価額等の推移

(2024年2月29日～2024年8月28日)



期 首：11,690円

期 末：12,642円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 8.1% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびMSCIワールド・インデックス(税引後配当込み、円ヘッジベース)は、期首(2024年2月28日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) MSCIワールド・インデックス(税引後配当込み、円ヘッジベース)は、ベンチマークです。ベンチマークは、今後、他の指数へ変更されることがあります。

○基準価額の主な変動要因

[上昇要因]

- ・日本を含む世界各国の株式を主要投資対象としているため、オーストリアやスペインなどの株式市場が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
- ・個別銘柄分析に基づくボトムアップ・アプローチにより株式銘柄選択を行った結果、VISTRA(米国/公益事業)、DELL TECHNOLOGIES(米国/テクノロジー・ハードウェアおよび機器)などの株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

[下落要因]

- ・日本を含む世界各国の株式を主要投資対象としているため、フランスなどの株式市場が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。
- ・BUILDERS FIRSTSOURCE (米国/資本財)、STELLANTIS (イタリア/自動車・自動車部品) などの株価が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境

TOPIX (東証株価指数) (日本)	+0.6%	S & P 500 指数 (米国)	+10.3%
FTSE 100 指数 (英国)	+9.4%	DAX 指数 (ドイツ)	+6.7%
CAC 40 指数 (フランス)	△4.7%		
米ドル/円 144円27銭 (前期末150円50銭)		ユーロ/円 161円22銭 (前期末163円20銭)	

※株価指数の騰落率は当期末時点 (対前期末比)、米ドル/円およびユーロ/円は当期末の数値です。

<株式市場>

当期の世界の株式市場は市場ごとに異なる動きとなりました。米国で2024年4月と5月の消費者物価指数(CPI)がインフレの鈍化を示唆したことなどから市場が年内の利下げを織り込んだことに加えて、米国の半導体企業の好決算などが続いたことで上昇しました。一方で大陸欧州のフランスでは、欧州議会議員選挙の結果を受け、マクロン大統領が下院の解散総選挙に踏み切ったこと、各国の右傾化が懸念されたことなどが嫌気されて株価は軟調に推移しました。

<債券市場>

当期の債券市場では、先進国で金利は低下しました。米国では、2024年7月以降、米雇用統計で雇用者数の増加ペースの鈍化が示されたことなどを背景に、景気減速や早期の利下げ開始が意識され、長期金利が低下しました。欧州ではインフレ率の鈍化や欧州中央銀行(ECB)がユーロ圏のインフレ率が2025年に目標の2%を達成すると予想していることで今後の利下げ期待が広がったことなどを背景に長期金利が低下しました。

<為替市場>

当期の為替市場は、日銀の金利引き上げへの金融政策の転換が意識されたことなどから米ドルとユーロはともに対円で下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

運用担当チームが持つ定量モデルにより資産配分の決定を行いました。当期はポートフォリオのリスク量が期を通じて低位だったことからほぼフルインベストメントとしました。株式ポートフォリオの構築に当たっては、企業の収益性、成長性、財務健全性、割安度などを総合的に判断し選定した銘柄に分散投資を行いました。株式以外の部分については、現金を保有する戦略としました。外貨建資産の投資に当たっては、運用担当チームが持つ定量モデルに従って、投資環境・ヘッジコストなどを総合的に勘案しながら機動的に為替ヘッジを行いました。当期は、米ドルについて強気シグナルが一時期出ており、一部オープンとしていたものの、おおむね高位のヘッジ比率を維持しました。

当期の主な買付銘柄は、BANK OF NEW YORK MELLON（米国／金融サービス）、CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE（カナダ／銀行）などでした。一方、主な売却銘柄は、BROADCOM（米国／半導体・半導体製造装置）、3I GROUP（英国／金融サービス）などでした。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+8.1%となり、ベンチマークであるMSCIワールド・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジベース）の騰落率+6.3%を上回る結果となりました。

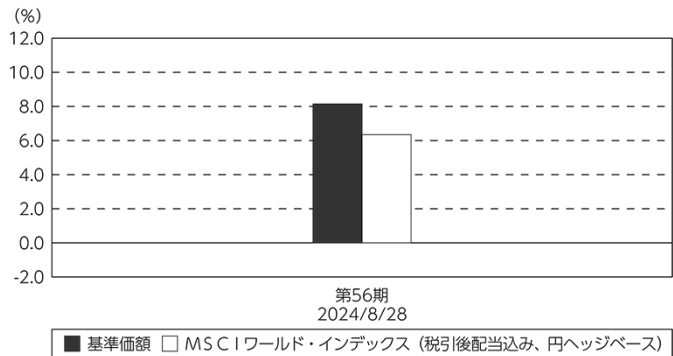
[プラス要因]

- 個別銘柄選択の積み上げの結果として「金融」をベンチマークと比較して高めの組み入れとしていたことや「情報技術」をベンチマークと比較して低めの組み入れとしていたことが対ベンチマークでの収益率のプラス要因となりました。

[マイナス要因]

- 個別銘柄選択の積み上げの結果として「素材」をベンチマークと比較して高めの組み入れとしていたことや「公益事業」をベンチマークと比較して低めの組み入れとしていたことが、対ベンチマークでの収益率のマイナス要因となりました。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注) MSCIワールド・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジベース）は、ベンチマークです。

分配金

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向および残存信託期間などを勘案し、当期は見送りとさせていただきます。収益分配金に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保して元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第56期
	2024年2月29日～ 2024年8月28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	3,132

(注) 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ります。

(注) 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。

○今後の運用方針

株式運用戦略については、株価水準や利益成長率、財務指標の健全度などの観点から個別銘柄ごとに魅力度を算定し、その魅力度が高い銘柄を中心にポートフォリオを構築する戦略とします。また、ポートフォリオにおける株式組入比率については、運用チームの株価見通しに基づき、株価の下落を予想する際には株式比率をやや引き下げ現金を保有する戦略とします。為替ヘッジ比率については原則対円でフルヘッジとしますが、運用チームの見通しに基づき外貨が対円で上昇すると予想するケースでは、ヘッジ比率をやや引き下げ外貨の上昇を享受することを狙う戦略とします。

○当ファンドのデータ

(2024年8月28日現在)

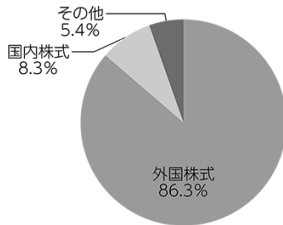
○組入上位10銘柄

	銘柄名	業種／種別等	通貨	国（地域）	比率 %
1	NVIDIA	半導体・半導体製造装置	米ドル	アメリカ	4.6
2	APPLE	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	米ドル	アメリカ	4.1
3	MICROSOFT	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	3.6
4	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	米ドル	アメリカ	2.3
5	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	米ドル	アメリカ	2.3
6	META PLATFORMS-A	メディア・娯楽	米ドル	アメリカ	1.9
7	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	米ドル	アメリカ	1.7
8	BANK OF NEW YORK MELLON	金融サービス	米ドル	アメリカ	1.2
9	VISTRA	公益事業	米ドル	アメリカ	1.2
10	QUALCOMM	半導体・半導体製造装置	米ドル	アメリカ	1.1
組入銘柄数			238銘柄		

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 国（地域）につきましては、発行体の国籍（所在国）などを表示しております。

○資産別配分

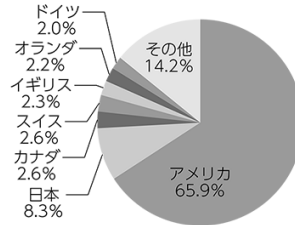


(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

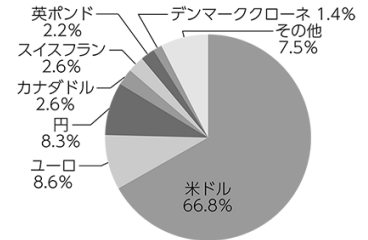
(注) 国別配分につきましては、発行体の国籍（所在国）などを表示しております。

(注) その他には現金等を含む場合があります。

○国別配分



○通貨別配分



○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年 2月29日～2024年 8月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	130	1.059	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(63)	(0.510)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(61)	(0.494)	購入後の情報提供、運用報告書等各種資料の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(7)	(0.055)	ファンドの財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	3	0.026	(b) 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 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(3)	(0.026)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.012	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(1)	(0.012)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	11	0.087	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(8)	(0.069)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(2)	(0.018)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、外国有価証券に係る税金・手数料等
合 計	145	1.184	
期中の平均基準価額は、12,304円です。			

(注) 期中の費用（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。

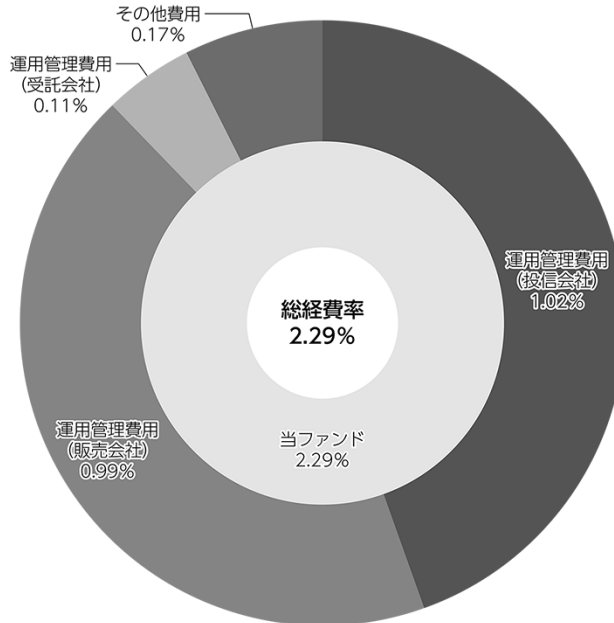
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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、項目ごとに小数点以下第4位を四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

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2.29%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2024年2月29日～2024年8月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 31 (6)	千円 77,189 (-)	千株 27	千円 90,489
	アメリカ	百株 333 (61)	千米ドル 3,327 (29)	百株 443 (0.95)	千米ドル 4,132 (30)
外	カナダ	46	千カナダドル 311	78	千カナダドル 296
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	20	53	41	172
	イタリア	120	87	59	114
	フランス	55	194	94	407
	オランダ	29	172	7	20
	スペイン	71 (6)	64 (0.77588)	129 (6)	122 (0.77588)
	ベルギー	—	—	1	8
	オーストリア	1	6	4	21
	フィンランド	16	23	—	—
	アイルランド	—	—	21 (4)	9 (17)
	イギリス	176 (4)	千英ポンド 137 (14)	137	千英ポンド 205
	スイス	8	千スイスフラン 128	1 (-)	千スイスフラン 9 (4)
	スウェーデン	23	千スウェーデンクローナ 749	43	千スウェーデンクローナ 999
ノルウェー	6	千ノルウェークローネ 192	6	千ノルウェークローネ 169	
デンマーク	12	千デンマーククローネ 612	9	千デンマーククローネ 548	
オーストラリア	85	千オーストラリアドル 91	16	千オーストラリアドル 53	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 単位未満は切捨てています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。

(注) ()内は株式分割、株式転換、増資割当、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いません。

(注) 地域は発行通貨によって区分しています。ただし、ユーロ建ての外国株式は発行体の国籍(所在国)などによって区分しています。以下同じです。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	HOST HOTELS & RESORTS	0.351	6	1	21

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 単位未満は切捨てています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。

○株式売買比率

(2024年2月29日～2024年8月28日)

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	1,794,427千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,130,368千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.84

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末のわが国の対顧客電信売買相場仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2024年2月29日～2024年8月28日)

該当事項はございません。

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8月28日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
鉱業 (1.2%)				
INPEX	1	1	2,163	
建設業 (3.7%)				
積水ハウス	1.8	1.8	6,690	
食料品 (2.8%)				
日本たばこ産業	1.9	1.2	5,038	
化学 (2.8%)				
積水化学工業	1.1	1.1	2,436	
花王	—	0.4	2,600	
医薬品 (9.0%)				
武田薬品工業	1.4	—	—	
塩野義製薬	0.7	0.9	6,021	
参天製薬	—	1.7	3,155	
大塚ホールディングス	1.2	0.8	6,911	
ガラス・土石製品 (1.4%)				
日本碍子	—	1.3	2,503	
鉄鋼 (3.5%)				
神戸製鋼所	—	1.6	2,825	
JFEホールディングス	3	1.7	3,366	
機械 (3.4%)				
アマダ	3.5	2.2	3,282	
ディスコ	0.1	—	—	
セガサミーホールディングス	1.3	—	—	
マキタ	—	0.6	2,853	
電気機器 (13.4%)				
日立製作所	0.6	3.5	12,092	
ルネサスエレクトロニクス	0.7	—	—	
パナソニック ホールディングス	2.5	—	—	
SCREENホールディングス	0.5	0.2	2,217	
キヤノン	—	0.9	4,512	
東京エレクトロン	—	0.2	5,238	
輸送用機器 (5.7%)				
本田技研工業	5.1	2	3,144	
SUBARU	2.1	2.6	7,095	
その他製品 (1.8%)				
TOPPANホールディングス	0.7	—	—	
アシックス	—	1.2	3,266	
陸運業 (6.4%)				
西日本旅客鉄道	—	1.5	4,182	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東海旅客鉄道	—	1.5	5,073	
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.3	0.3	2,239	
海運業 (2.9%)				
日本郵船	0.8	1	5,086	
情報・通信業 (1.9%)				
ソフトバンク	1.1	1.7	3,464	
卸売業 (11.2%)				
双日	1.4	1.7	5,786	
伊藤忠商事	0.3	0.5	3,658	
丸紅	0.8	—	—	
豊田通商	0.5	1.8	4,878	
三井物産	1.1	0.8	2,417	
住友商事	1	1	3,378	
三菱商事	4.5	—	—	
小売業 (—%)				
良品計画	1.1	—	—	
銀行業 (13.9%)				
ゆうちょ銀行	1.9	2.6	3,602	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.2	—	—	
三井住友フィナンシャルグループ	0.8	1	9,604	
みずほフィナンシャルグループ	3.4	3.9	11,762	
証券・商品先物取引業 (8.7%)				
大和証券グループ本社	2.4	3.2	3,400	
野村ホールディングス	—	14.5	12,133	
保険業 (1.5%)				
かんぽ生命保険	1	—	—	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	—	0.8	2,638	
その他金融業 (1.1%)				
三菱HCキャピタル	1.8	1.8	1,883	
サービス業 (3.7%)				
日本郵政	5.9	4.6	6,541	
合 計	株 数 ・ 金 額	61	71	179,145
	銘柄数 < 比率 >	37	38	< 8.3% >

(注) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 評価額欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 評価額の単位未満は切捨てています。

(注) 株数は千株単位で記載しています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。

(注) 一印は組み入れはありません。

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TD SYNNEX	—	2	24	3,547	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INTL BUSINESS MACHINES	0.93	3	63	9,231	ソフトウェア・サービス
ALLSTATE	—	2	55	7,959	保険
AMERICAN EXPRESS	—	1	30	4,415	金融サービス
AFLAC	4	—	—	—	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	5	5	42	6,099	保険
VALERO ENERGY	—	1	21	3,110	エネルギー
BERKSHIRE HATHAWAY-B	2	2	108	15,683	金融サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED RENTALS	0.22	0.58	42	6,162	資本財
FEDEX	3	2	76	11,061	運輸
AMPHENOL-A	—	2	18	2,648	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CSX	—	4	15	2,272	運輸
CARDINAL HEALTH	11	5	55	7,940	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS	—	1	61	8,891	資本財
CATERPILLAR	0.87	1	52	7,598	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	16	11	260	37,546	銀行
COCA-COLA	5	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE	—	3	34	4,905	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE	0.89	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY	—	7	65	9,455	公益事業
DR HORTON	0.64	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TARGET	1	4	66	9,637	生活必需品流通・小売り
WALT DISNEY	—	2	18	2,622	メディア・娯楽
BANK OF AMERICA	16	15	59	8,590	銀行
CITIGROUP	36	20	128	18,491	銀行
ECOLAB	1	2	64	9,291	素材
SALESFORCE	3	1	36	5,336	ソフトウェア・サービス
EOG RESOURCES	1	3	39	5,749	エネルギー
EXXON MOBIL	3	3	45	6,570	エネルギー
ASSURANT	1	4	89	12,853	保険
FREEMPORT-MCMORAN	7	4	21	3,099	素材
MCKESSON	1	0.94	51	7,468	ヘルスケア機器・サービス
HALLIBURTON	4	7	22	3,238	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP	—	0.82	41	6,000	金融サービス
UNUM GROUP	4	—	—	—	保険
HOME DEPOT	—	0.52	19	2,799	一般消費財・サービス流通・小売り
HUMANA	0.76	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JABIL CIRCUIT	2	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMCOR GROUP	2	2	99	14,396	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1	4	75	10,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	—	2	26	3,797	保険
DEVON ENERGY	—	3	17	2,473	エネルギー
KIMBERLY-CLARK	1	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	1	33	4,877	素材
LENNAR-A	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	0.26	0.38	36	5,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LOCKHEED MARTIN	—	0.31	17	2,506	資本財
LOEWS	2	4	32	4,713	保険
CARNIVAL	13	—	—	—	消費者サービス
EVEREST GROUP	0.62	—	—	—	保険
MARSH & MCLENNAN COS	0.47	—	—	—	保険
MASCO	—	5	41	6,055	資本財
MICRON TECHNOLOGY	—	1	12	1,863	半導体・半導体製造装置
3M	—	2	38	5,516	資本財
NVR	0.09	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WELLS FARGO	17	15	86	12,418	銀行
NUCOR	2	1	26	3,883	素材
CHENIERE ENERGY	1	—	—	—	エネルギー
CAPITAL ONE FINANCIAL	5	1	19	2,855	金融サービス
CONOCOPHILLIPS	2	5	66	9,553	エネルギー
ALTRIA GROUP	23	17	91	13,131	食品・飲料・タバコ
PROGRESSIVE	—	3	82	11,903	保険
PULTEGROUP	10	0.76	10	1,442	耐久消費財・アパレル
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	0.85	17	2,596	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	5	2	36	5,242	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	—	2	18	2,623	金融サービス
MERCK	4	2	33	4,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER	7	8	39	5,659	エネルギー
CENCORA	2	3	77	11,150	ヘルスケア機器・サービス
CENTENE	13	7	58	8,462	ヘルスケア機器・サービス
SNAP-ON	0.45	—	—	—	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL	—	4	47	6,872	保険
AT & T	11	9	18	2,625	電気通信サービス
TOLL BROTHERS	9	5	71	10,368	耐久消費財・アパレル
DAVITA INC	6	5	89	12,912	ヘルスケア機器・サービス
MARATHON OIL	21	—	—	—	エネルギー
UNION PACIFIC	—	3	84	12,244	運輸
UNITEDHEALTH GROUP	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	—	1	30	4,380	ヘルスケア機器・サービス
WALMART	5	10	82	11,971	生活必需品流通・小売り
WABTEC	—	4	71	10,295	資本財
WILLIAMS-SONOMA	1	5	72	10,503	一般消費財・サービス流通・小売り
DICK'S SPORTING GOODS	—	0.86	20	2,931	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COMPANIES	8	4	50	7,309	一般消費財・サービス流通・小売り
MOLSON COORS BEVERAGE-B	13	5	28	4,125	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRSTSOURCE	8	1	24	3,552	資本財
CF INDUSTRIES HOLDINGS	1	—	—	—	素材
OWENS CORNING	6	5	92	13,389	資本財
AERCAP HOLDINGS	2	3	37	5,385	資本財
AECOM	1	1	15	2,185	資本財
BANK OF NEW YORK MELLON	4	26	180	26,044	金融サービス
VISA-A	1	—	—	—	金融サービス
MARATHON PETROLEUM	5	4	73	10,637	エネルギー
KINDER MORGAN	—	13	29	4,233	エネルギー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES-A	3	1	15	2,170	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HCA HEALTHCARE	1	1	73	10,582	ヘルスケア機器・サービス
MOTOROLA SOLUTIONS	—	2	114	16,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS	11	26	129	18,694	自動車・自動車部品
SERVICENOW	0.27	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS	0.41	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BERRY GLOBAL	4	4	30	4,429	素材
TENET HEALTHCARE	—	7	122	17,660	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE	—	1	28	4,183	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAKER HUGHES	35	29	102	14,831	エネルギー
TECHNIPFMC	—	6	17	2,573	エネルギー
LEIDOS HOLDINGS	—	4	75	10,919	商業・専門サービス
SPOTIFY TECHNOLOGY	—	0.51	17	2,497	メディア・娯楽
THE CIGNA GROUP	2	2	88	12,814	ヘルスケア機器・サービス
DELL TECHNOLOGIES	13	5	57	8,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OVINTIV	—	3	14	2,145	エネルギー
TRANE TECHNOLOGIES	—	1	57	8,290	資本財
FERGUSON	1	—	—	—	資本財
EQUITABLE	3	3	16	2,390	金融サービス
VERTIV HOLDINGS	6	2	19	2,823	資本財
GENERAL ELECTRIC	5	—	—	—	資本財
RTX	—	4	54	7,878	資本財
COREBRIDGE FINANCIAL	—	11	32	4,631	金融サービス
HF SINCLAIR	3	10	48	6,998	エネルギー
PALANTIR TECHNOLOGIES-A	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BATH & BODY WORKS	3	3	11	1,617	一般消費財・サービス流通・小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	8	8	43	6,239	金融サービス
BUNGE GLOBAL	3	3	31	4,501	食品・飲料・タバコ
FERGUSON ENTERPRISES	—	0.58	12	1,748	資本財
ELEVANCE HEALTH	0.58	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GODADDY-A	—	4	67	9,767	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	9	7	59	8,597	食品・飲料・タバコ
US FOODS HOLDING	10	8	52	7,524	生活必需品流通・小売り
CLEVELAND-CLIFFS	—	17	25	3,636	素材
ENCOMPASS HEALTH	6	6	57	8,350	ヘルスケア機器・サービス
VISTRA	34	20	173	25,054	公益事業
AMAZON.COM	17	19	341	49,252	一般消費財・サービス流通・小売り
ADOBE	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
COMCAST-A	18	6	24	3,541	メディア・娯楽
APPLE	27	26	611	88,199	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	7	5	115	16,720	半導体・半導体製造装置
CASEY'S GENERAL STORES	1	—	—	—	生活必需品流通・小売り
CISCO SYSTEMS	14	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EBAY	13	10	62	8,959	一般消費財・サービス流通・小売り
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	6	3	44	6,351	運輸
FISERV	6	—	—	—	金融サービス
FLEX	8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	0.15	—	—	—	銀行
NVIDIA	6	53	687	99,157	半導体・半導体製造装置
F5	—	2	42	6,165	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
INTEL	2	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
KLA	0.9	0.6	48	7,035	半導体・半導体製造装置	
LAM RESEARCH	1	1	86	12,428	半導体・半導体製造装置	
AKAMAI TECHNOLOGIES	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
MICROSOFT	13	12	533	77,019	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY	3	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
NETAPP	2	8	117	16,939	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PACCAR	8	6	59	8,644	資本財	
QUALCOMM	4	9	167	24,114	半導体・半導体製造装置	
ARCH CAPITAL GROUP	5	1	21	3,033	保険	
ROSS STORES	1	4	72	10,396	一般消費財・サービス流通・小売り	
STEEL DYNAMICS	3	3	38	5,570	素材	
NETFLIX	0.41	0.54	37	5,420	メディア・娯楽	
TEXAS ROADHOUSE	—	1	17	2,511	消費者サービス	
SUPER MICRO COMPUTER	0.18	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VERISK ANALYTICS-A	0.94	—	—	—	商業・専門サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS	3	1	13	1,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITED AIRLINES	15	2	10	1,513	運輸	
NXP SEMICONDUCTORS	3	0.96	24	3,500	半導体・半導体製造装置	
CBOE GLOBAL MARKETS	1	—	—	—	金融サービス	
EXPEDIA GROUP	4	3	48	7,008	消費者サービス	
META PLATFORMS-A	6	5	277	39,991	メディア・娯楽	
MEDPACE HOLDINGS	—	1	40	5,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOOKING HOLDINGS	0.52	0.28	108	15,679	消費者サービス	
BROADCOM	1	7	117	16,997	半導体・半導体製造装置	
DOCUSIGN	5	12	73	10,652	ソフトウェア・サービス	
DROPBOX-CLASS A	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
AIRBNB-CLASS A	1	—	—	—	消費者サービス	
APPLOVIN-A	—	12	112	16,180	ソフトウェア・サービス	
VIATRIS	80	47	54	7,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
APA	15	3	9	1,345	エネルギー	
QORVO	—	2	26	3,853	半導体・半導体製造装置	
ALPHABET INC-CL A	21	20	345	49,845	メディア・娯楽	
ZILLOW GROUP-C	8	—	—	—	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	913	864	9,997	1,442,408	
	銘柄 数 < 比 率 >	133	138	—	< 66.8% >	
(カナダ)			千カナダドル			
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	—	26	193	20,799	銀行	
IMPERIAL OIL	3	—	—	—	エネルギー	
MANULIFE FINANCIAL	11	11	43	4,660	保険	
SUN LIFE FINANCIAL	8	—	—	—	保険	
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS	0.51	0.27	43	4,650	保険	
ROYAL BANK OF CANADA	—	3	50	5,460	銀行	
STANTEC	3	1	15	1,679	資本財	
GEORGE WESTON	1	1	29	3,168	生活必需品流通・小売り	
SUNCOR ENERGY	10	15	83	8,931	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE	—	10	59	6,345	エネルギー	
ARC RESOURCES	34	—	—	—	エネルギー	
CRESCENT POINT ENERGY	24	—	—	—	エネルギー	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千カナダドル		邦貨換算金額 千円
(カナダ)	百株	百株			
IA FINANCIAL	2	—	—	—	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	101	70	519	55,696
	銘柄 数 < 比 率 >	10	8	—	< 2.6% >
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ	
ADIDAS	—	0.74	16	2,668	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS	7	4	14	2,309	ヘルスケア機器・サービス
E.ON	9	17	22	3,662	公益事業
HENKEL-VORZUG	—	2	16	2,687	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS	9	6	56	9,107	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE	3	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ-REG	1	1	31	5,033	保険
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-REG	1	1	66	10,790	保険
SIEMENS-REG	0.95	—	—	—	資本財
DEUTSCHE BANK-REG	25	9	13	2,234	金融サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE	2	—	—	—	自動車・自動車部品
HUGO BOSS-ORD	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TALANX	3	3	24	4,021	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	67	46	263	42,514
	銘柄 数 < 比 率 >	11	9	—	< 2.0% >
(ユーロ…イタリア)					
GENERALI	46	27	66	10,683	保険
INTESA SANPAOLO	104	189	70	11,326	銀行
STELLANTIS	20	20	30	4,988	自動車・自動車部品
UNICREDIT	22	16	60	9,770	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	193	254	228	36,767
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 1.7% >
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES	—	3	10	1,757	資本財
AXA	10	—	—	—	保険
CREDIT AGRICOLE	36	22	30	4,912	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	5	—	—	—	資本財
ENGIE	—	25	40	6,526	公益事業
EIFFAGE	5	4	42	6,901	資本財
SCOR	7	—	—	—	保険
VINCI	10	3	36	5,863	資本財
DANONE	8	10	62	10,139	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE	0.86	—	—	—	素材
DASSAULT AVIATION	0.84	—	—	—	資本財
MICHELIN (CGDE)	—	4	16	2,654	自動車・自動車部品
ARCELORMITTAL	28	—	—	—	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	113	74	240	38,755
	銘柄 数 < 比 率 >	10	7	—	< 1.8% >
(ユーロ…オランダ)					
ASM INTERNATIONAL	—	0.24	14	2,294	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS	—	9	24	3,952	ヘルスケア機器・サービス
ASML HOLDING	—	0.67	53	8,578	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	7	11	34	5,548	生活必需品流通・小売り
EXOR NV	1	2	28	4,619	金融サービス

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
		株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ) NN GROUP	百株 4	百株 11	千ユーロ 48	千円 7,776	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	13 3	35 6	203 -	32,770 <1.5%>
(ユーロ…スペイン) BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA REPSOL BANCO SANTANDER ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV AENA SME	58 54 39 8 -	- 34 62 4 1	- 43 27 17 35	- 7,086 4,450 2,851 5,643	銀行 エネルギー 銀行 資本財 運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	162 4	103 4	124 -	20,031 <0.9%>
(ユーロ…ベルギー) SYENSQO	1	-	-	-	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1 1	- -	- -	- <-%>
(ユーロ…オーストリア) OMV ERSTE GROUP BANK ANDRITZ	9 5 2	9 5 -	36 28 -	5,964 4,553 -	エネルギー 銀行 資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	17 3	15 2	65 -	10,518 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド) WARTSILA	-	16	31	5,125	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	- -	16 1	31 -	5,125 <0.2%>
(ユーロ…アイルランド) SMURFIT KAPPA GROUP ATB GROUP	4 21	- -	- -	- -	素材 銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	25 2	- -	- -	- <-%>
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	595 38	544 33	1,156 -	186,483 <8.6%>
(イギリス) HSBC HOLDINGS ASTRAZENECA CENTRICA UNILEVER 3I GROUP GLENCORE SAGE GROUP-NEW NATWEST GROUP GSK SHELL PLC-NEW AVIVA	16 - 54 6 32 - 11 - 16 28 90	- 1 - 2 - 64 59 35 19 118	千英ポンド - 17 - 13 - 26 20 58 52 58	- 3,321 - 2,647 - 5,053 - 3,953 11,130 10,104 11,276	銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 公益事業 家庭用品・パーソナル用品 金融サービス 素材 ソフトウェア・サービス 銀行 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス エネルギー 保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	257 8	301 7	248 -	47,487 <2.2%>
(スイス) GIVAUDAN NOVARTIS	- 5	0.11 13	千スイスフラン 46 138	7,911 23,787	素材 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
(スイス)	百株	百株	千円			
HOLCIM	17	17	137	23,499	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23 2	30 3	322 —	55,198 <2.6%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
TRELLEBORG AB-B SHS	—	12	475	6,753	資本財	
SKF-B	—	11	215	3,063	資本財	
VOLVO-B	—	17	477	6,778	資本財	
NORDEA BANK	13	—	—	—	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	61 2	41 3	1,167 —	16,595 <0.8%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
EQUINOR	6	6	180	2,496	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6 1	6 1	180 —	2,496 <0.1%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
A P MOLLER - MAERSK-B	—	0.1	103	2,243	運輸	
DANSKE BANK	6	12	262	5,674	銀行	
ROCKWOOL -B	—	0.7	202	4,377	資本財	
PANDORA	4	5	612	13,245	耐久消費財・アパレル	
NOVO NORDISK A/S-B	7	2	242	5,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18 3	21 5	1,424 —	30,776 <1.4%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
BHP GROUP	50	57	237	23,269	素材	
WOODSIDE ENERGY GROUP	4	—	—	—	エネルギー	
SOUTH32	—	67	20	2,045	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	55 2	124 2	258 —	25,314 <1.2%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,033 199	2,006 200	— —	1,862,456 <86.3%>	

(注) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額の<>内は、当期末の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。
(注) 株数および評価額の単位未満は切捨てています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。
(注) 業種はG I C S (世界産業分類基準) に準じています。
(注) 期中に銘柄コード等の変更があった場合は、当該銘柄は期首とは別銘柄として記載しています。
(注) 一印は組み入れはありません。

外国投資信託証券

2024年8月28日現在の組入れはございません。

銘柄	口数	期首(前期末)	
		口数	口数
(アメリカ)			千口
HOST HOTELS & RESORTS			0.888
合計	口数 銘柄数		0.888
			1

(注) 単位未満は切捨てています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。

○投資信託財産の構成

(2024年8月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	2,041,602	93.5
コール・ローン等、その他	141,161	6.5
投資信託財産総額	2,182,763	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てています。

(注) 当期末における外貨建純資産 (1,873,203千円) の投資信託財産総額 (2,182,763千円) に対する比率は85.8%です。

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年8月28日における邦貨換算レートは1米ドル=144.27円、1カナダドル=107.31円、1ユーロ=161.22円、1英ポンド=191.24円、1スイスフラン=171.32円、1スウェーデンクローナ=14.21円、1ノルウェークローネ=13.80円、1デンマーククローネ=21.61円、1オーストラリアドル=97.92円、1シンガポールドル=110.84円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,977,512,233
コール・ローン等	110,761,978
株式(評価額)	2,041,602,530
未収入金	1,823,013,332
未収配当金	2,134,087
未収利息	306
(B) 負債	1,819,116,696
未払金	1,796,065,679
未払信託報酬	22,655,017
その他未払費用	396,000
(C) 純資産総額(A-B)	2,158,395,537
元本	1,707,384,295
次期繰越損益金	451,011,242
(D) 受益権総口数	1,707,384,295口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,642円

<注記事項> (当運用報告書作成時点では監査未了です。)

(貸借対照表関係)

期首元本額	1,777,032,379円
期中追加設定元本額	755,660円
期中一部解約元本額	70,403,744円

○損益の状況 (2024年2月29日～2024年8月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	23,365,158
受取配当金	23,328,420
受取利息	38,388
その他収益金	185
支払利息	△ 1,835
(B) 有価証券売買損益	163,319,798
売買益	405,936,101
売買損	△242,616,303
(C) 信託報酬等	△ 24,435,241
(D) 当期損益金(A+B+C)	162,249,715
(E) 前期繰越損益金	364,731,469
(F) 追加信託差損益金	△ 75,969,942
(配当等相当額)	(7,890,386)
(売買損益相当額)	(△ 83,860,328)
(G) 計(D+E+F)	451,011,242
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	451,011,242
追加信託差損益金	△ 75,969,942
(配当等相当額)	(7,890,386)
(売買損益相当額)	(△ 83,860,328)
分配準備積立金	526,981,184

(注) (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) (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) (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) 運用の指図に係る権限を委託するための費用として、委託者が受ける報酬の40%の金額を、(C)信託報酬等の中の委託者報酬の中から支払っています。

(注) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。

計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,305,866円)、費用控除後の有価証券売買等損益(141,943,849円)、信託約款に規定する収益調整金(7,890,386円)および分配準備積立金(364,731,469円)より分配対象収益は534,871,570円(1万口当たり3,132円)となりましたが、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案し、当期の分配を見合わせました。

○分配金のお知らせ

当期の収益分配は見送らせていただきました。