

■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／株式 | |
| 信託期間とクローズド期間 | 信託期間は約6年9ヵ月程度（2018年7月27日～2025年4月18日） クローズド期間はありません。 | |
| 運用方針 | この投資信託は、主に投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）に投資を行うことを通じて、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行うことを基本とします。 | |
| 主要投資対象 | ルクセンブルグ籍建て外国投資法人「Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY」投資証券 | 主として先進国の株式に投資を行います。 株式のバリュエーション、クオリティ、モメンタム等を考慮し銘柄選定を行い、ESG（環境・社会・ガバナンス）評価を考慮した運用を行います。 |
| | 証券投資信託「Shinseiショートターム・マザー・ファンド」受益証券 | 残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により安定した運用の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことにより流動性の確保を図ります。 |
| 投資制限 | <p>①投資信託証券、短期社債等（「社債、株式等の振替に関する法律」以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー以外の有価証券への直接投資は行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。</p> <p>③株式への直接投資は行いません。</p> <p>④外資建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>⑤外資建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。</p> <p>⑥同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会の規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑦一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> | |
| 分配方針 | <p>毎決算期末に、原則として、以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた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。</p> <p>②収益分配金額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の範囲で、委託者が基準価額水準、市場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、委託者の判断で分配を行わないことがあります。</p> <p>③収益分配に充てず信託財産内に留保した利益（無分配期の利益を含みます。）については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p> | |

オリックス 先進国株式 マーケット・プラス・ファンド

運用報告書（全体版）

第5期（決算日 2023年4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御礼申し上げます。

さて、ご購入いただいております「オリックス 先進国株式マーケット・プラス・ファンド」は、去る2023年4月20日に第5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。

今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SBIアセットマネジメント株式会社

東京都港区六本木1-6-1

お問い合わせ先

電話番号 03-6229-0097

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページから、ファンドの商品概要、レポート等をご覧いただけます。

<http://www.sbiasset.co.jp/>

（2023年4月1日の合併により「SBIアセットマネジメント株式会社」に商号変更しております）

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配落) | 標準価額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 投 資 組 入 比 | 信 託 券 率 | 純 資 産 額 |
|---------------------|-------------|--------|--------|--------|------------------|--------|-----------------------|------------------|------------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 | | | | | |
| (設定日) 2018年7月27日 | 円 10,000 | | 円 — | | % — | | % — | 百万円 897 | |
| 1期(2019年4月22日) | 10,053 | | 0 | | 0.0 | | 98.9 | 949 | |
| 2期(2020年4月20日) | 8,508 | | 0 | | △15.4 | | 98.2 | 841 | |
| 3期(2021年4月20日) | 12,967 | | 0 | | 52.4 | | 98.4 | 1,364 | |
| 4期(2022年4月20日) | 15,373 | | 0 | | 18.6 | | 97.3 | 1,780 | |
| 5期(2023年4月20日) | 15,842 | | 0 | | 3.1 | | 98.4 | 1,840 | |

(注) 設定日の基準価額は、当初設定価額を表示しています。

(注) 設定日の純資産総額は、当初設定元本を表示しています。

(注) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注) 各組入比率は純資産総額に対する組入比率です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 純資産総額は単位未満を切捨て、騰落率、各組入比率は小数点第2位を四捨五入して表示しています。

(注) 当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | 債 組 入 比 | 券 率 | 投 証 組 入 比 | 信 託 券 率 |
|----------------------|-------------|--------|---------|----------|-----------|-----------|
| | | | | | | |
| (期 首) 2022年 4月20日 | 円 15,373 | % — | | % 0.0 | | % 97.3 |
| 4月末 | 14,825 | △3.6 | | 0.0 | | 97.2 |
| 5月末 | 14,884 | △3.2 | | 0.0 | | 97.5 |
| 6月末 | 14,652 | △4.7 | | 0.0 | | 96.5 |
| 7月末 | 15,269 | △0.7 | | 0.0 | | 96.8 |
| 8月末 | 15,405 | 0.2 | | 0.0 | | 97.5 |
| 9月末 | 14,758 | △4.0 | | 0.0 | | 97.3 |
| 10月末 | 15,466 | 0.6 | | 0.0 | | 98.6 |
| 11月末 | 15,495 | 0.8 | | 0.0 | | 98.6 |
| 12月末 | 14,457 | △6.0 | | 0.0 | | 97.6 |
| 2023年 1月末 | 15,081 | △1.9 | | 0.0 | | 97.6 |
| 2月末 | 15,420 | 0.3 | | 0.0 | | 98.5 |
| 3月末 | 15,163 | △1.4 | | 0.0 | | 98.7 |
| (期 末) 2023年 4月20日 | 15,842 | 3.1 | | 0.0 | | 98.4 |

(注) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注) 騰落率は期首比で表示しています。

(注) 各組入比率は純資産総額に対する組入比率です。

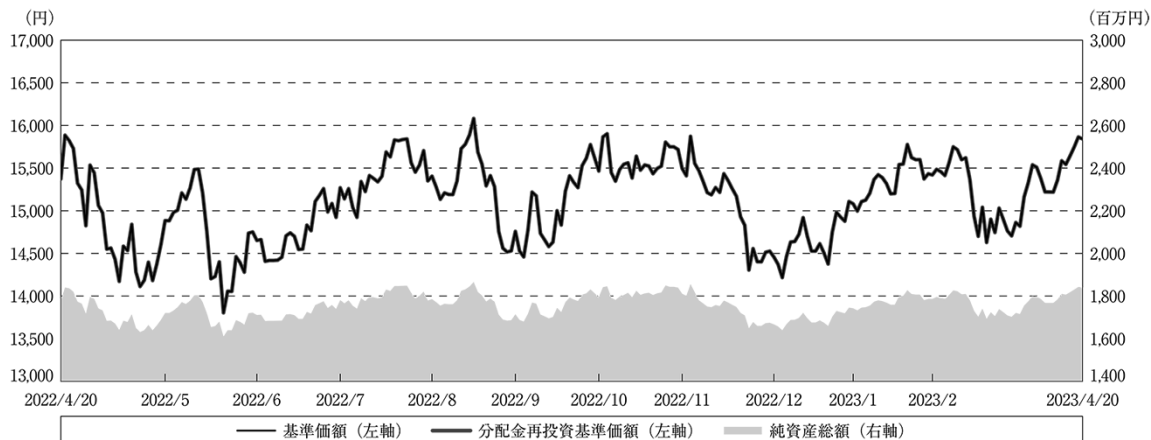
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 騰落率、各組入比率は小数点第2位を四捨五入して表示しています。

(注) 当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。

○運用経過

期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（課税前）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は、期首（2022年4月20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。なお、上記表示期間に収益分配が行われなかった場合、基準価額と分配金再投資基準価額の推移は同一のものとします。
- (注) 当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。
- (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。

○基準価額の変動要因

当期における基準価額の変動要因は、以下の通りとなります。

当ファンドの基準価額に対するプラス要因

- ・2022年7月に、世界経済見通しの改善期待や米国長期金利の低下、好調な企業決算などを受け、先進国株式市場が上昇したこと
- ・10月に、欧米の中央銀行による金融引き締め姿勢の鈍化観測が強まったことや好調な企業決算の発表などを背景にリスク選好度が改善し、先進国株式市場が上昇したこと
- ・2023年1月～当期末には、欧州でのインフレ率の鈍化や欧米の一部金融機関における経営問題の表面化などを背景に、欧米の中央銀行による金融引き締め政策の転換期待が高まったことや中国経済の回復期待などから、先進国株式市場が上昇したこと
- ・為替市場で、米ドルやユーロなどに対して円安が進んだこと

当ファンドの基準価額に対するマイナス要因

- ・ 当期首～2022年6月下旬に、欧米の中央銀行による金融引き締め姿勢を受け、欧米の株式市場が軟調な動きとなったこと
- ・ 9月に、米国でのインフレ圧力の強さや米国での金融引き締め姿勢の継続、欧州経済の後退見通しなどから、先進国株式市場が下落したこと
- ・ 12月に、欧米の中央銀行による金融引き締め姿勢の継続や世界経済の後退観測の強まり、日本での金融緩和政策の転換の見通しなどを受け、先進国株式市場が下落したこと

投資環境

<先進国株式市場>

当期首～2022年6月の先進国株式市場は、国／地域によってばらつきが見られる局面もあったものの、全体としては軟調な動きとなりました。米国株式市場は、C P I（消費者物価指数）の上昇に加え、F R B（米国連邦準備制度理事会）による利上げや保有資産の削減などの決定を受け、軟調な展開となりました。欧州株式市場も、米国株式市場の軟調な動きやE C B（欧州中央銀行）による7月からの利上げ開始の決定、欧州でのインフレ率の上昇などを受け、下落基調となりました。一方、日本株式市場は、欧米株式市場の軟調な動きにつれて下落する局面もありましたが、5月には月間で上昇するなど相対的に堅調な動きとなりました。

7月に上昇した先進国株式市場は、8月には再びばらつきのある動きとなり、9月には下落する展開となりました。7月の米国株式市場は、中国の景気支援政策による世界経済見通しの改善期待や米国長期金利の低下、大型ハイテク企業などの好決算などを好感して上昇しましたが、8月に入り、F R Bによる金融引き締め姿勢の見通しが強まったことなどから下落に転じ、9月も、米国のC P Iが市場予想を上回ったことやF R Bのタカ派姿勢の強まりなどから、米国株式市場は下落する展開となりました。欧州株式市場も、7月には米国株式市場の上昇や好調な企業決算などが下支えとなり上昇しましたが、8月に入ってBoE（イングランド銀行）による利上げやウクライナ情勢の膠着化を背景としたエネルギーの供給不安の高まりなどから、下落基調に転じました。9月には、米国のインフレ圧力の強さとそれに伴うF R Bの利上げ継続、英国金利の急騰、欧州経済の後退懸念などからリスク回避の動きが強まり、欧州株式市場は引き続き下落しました。日本株式市場は、7月には参議院選挙での与党勝利や海外株式市場の上昇などが支えとなり、上昇しました。8月には、欧米の景気減速懸念が重しとなる場面もありましたが、国内主要企業の好決算や円安／米ドル高が好感されたことなどから、7月に続いて上昇する展開となりました。日本株式市場は、9月上旬まで堅調な動きとなっていました。その後は、米国株式市場の下落やF R Bの利上げ継続、英国の金利急騰などの影響から、下落する展開となりました。

10月～11月の先進国株式市場は上昇したものの、12月には反落しました。米国株式市場は、市場予想を上回る米国企業の決算が多かったことやF R Bの利上げペースの鈍化期待が出たことなどから、10月～11月には上昇しました。その後、12月には、F R Bの金融引き締め継続とそれに伴う景気減速懸念から、米国株式市場は下落に転じました。欧州株式市場も、英国での財源なき減税政策の大部分が撤回されたことによるリスク選好度の改善や欧州企業の良好な決算、E C Bによる利上げペース減速に対する期待感などから、10月～11月には上昇しました。12月の欧州株式市場は、

世界経済の先行き懸念の燻りやECBのインフレ対策重視のタカ派的姿勢が嫌気されたことで、下落しました。日本株式市場も、10月～11月には、海外株式市場の上昇や英国の減税政策見直しによるリスク選好度の改善、FRBによる利上げペース減速の期待感などから、上昇する展開となりました。12月に入ると、FRBの金融引き締め姿勢の継続見通しが再び強まったことや日銀（日本銀行）によるイールドカーブ・コントロールのタカ派方向への修正、円高／米ドル安の進行などを受け、日本株式市場は下落しました。

2023年1月～3月の先進国株式市場は、2月にばらつきのある動きとなりましたが、全体としては堅調な動きとなりました。米国株式市場は、一部経済指標の軟化を受けてFRBによるインフレ対応強化の可能性が低下したとの観測が強まったことやCPIの伸び率の鈍化基調などを受け、1月には上昇しましたが、2月には米国雇用統計やCPIの伸び率が市場予想を上回ったことなどから再びFRBの金融引き締め継続見通しが強まり、米国株式市場は下落に転じました。3月上旬～中旬に欧米の銀行の経営問題が表面化したものの、政策当局の迅速な対応を受けて金融不安が徐々に後退したことに加え、ハイテク・セクターへの買いが下支えとなったことなどから、米国株式市場は上昇しました。欧州株式市場は、ECBによる追加利上げの懸念が燻るなか、ゼロコロナ政策終了による中国経済の回復期待や欧州でのエネルギー危機の緩和などを受け、1月には上昇しました。2月に入っても、CPIが市場予想を下回ったことや欧州企業の良好な決算、中国経済の回復期待などを背景に、欧州株式市場は上昇を続け、3月上旬～中旬に一時的に軟調となる場面もありましたが、金融不安の後退を受けて3月も上昇しました。日本株式市場は、1月上旬～中旬には日銀のさらなる金融政策の修正見通しから弱含む場面がありましたが、日銀が金融政策を据え置いたことや米国株式市場の上昇などを受け、1月には上昇しました。2月に入っても、円安／米ドル高の進行や日銀の金融緩和維持の見通しなどを受けて日本株式市場は上昇基調を続け、3月には欧米の銀行の経営問題で下落する場面があったものの、金融不安の後退を受けて月間では上昇しました。4月上旬の株式市場は世界的にやや軟調な動きを見せていましたが、その後は回復基調となるなかで当期末を迎えました。

<為替市場>

当期首に129円台半ばだった円／米ドルレートは、一時的に円高／米ドル安に振れる場面があったものの、FRBが利上げを継続する一方で日銀が金融緩和姿勢を崩さなかったことで日米の金利差が意識され、2022年10月下旬に150円台前半を付けるなど、概ね円安／米ドル高基調が続きました。10月以降は、日本政府・日銀による為替介入の思惑やFRBによる利上げペース減速の見通しなどもあり、円／米ドルレートは円高／米ドル安の動きとなり、2023年1月末には130円台半ばとなりました。3月上旬には137円台半ばまで円安／米ドル高が進む場面もありましたが、その後はやや円高／米ドル安となり135円程度で当期末を迎えました。また、当期首に139円台後半だった円／ユーロレートは、2022年10月下旬に147円台半ばまで円安／ユーロ高が進みましたが、その後、2023年1月には138円台半ばまで円高／ユーロ安の動きとなりました。その後は再び円安／ユーロ高の動きとなり、147円台後半で当期末を迎えました。

<日本短期金融市場>

国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、断続的な日銀の買入オペの影響等から、期を通じて0%を下

回る水準で推移し、日銀による長短金利操作付き量的・質的金融緩和の影響もあり、期末時点においては-0.1647%程度的水準となりました。

当ファンドのポートフォリオ

主として投資先ファンドであるルクセンブルグ籍外国投資法人「Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY」投資証券への投資を通じて、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を行いました。

投資先ファンドを高位で組入れる一方、「Shinseiショートターム・マザー・ファンド」を一部組入れた運用を行いました。

※以下、「Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY」を「投資先ファンド」、「Shinseiショートターム・マザー・ファンド」を「マザーファンド」ということがあります。

投資先ファンド：Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY

運用方針に則り、先進国の株式を中心とした運用を行いました。当期を通じて、米国株式に2/3程度を投資したほか、カナダに3~4%程度を投資するなど、北米地域の株式に70%以上を投資しました。また、日本株式への配分は、概ね6%程度を維持しました。残りの部分については、英国のほか、フランスやドイツなどの欧州地域を中心に組入れた運用を行いました。当期を通じて主要国/地域の中央銀行による利上げが継続したことなどから、セクター別では、情報技術や一般消費財・サービスなどへの投資をやや抑制する一方で、ヘルスケアや生活必需品などのセクターへの配分を引き上げるなど、ややディフェンシブな運用を強める場面もありました。

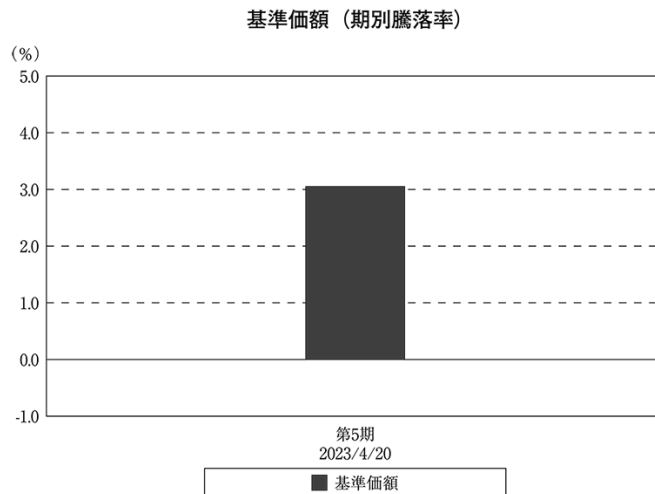
Shinseiショートターム・マザー・ファンド

Shinseiショートターム・マザー・ファンドでは、主として国庫短期証券等を組入れました。国庫短期証券等の利回りがマイナスとなっている状況から、当期の基準価額は小幅に下落しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。

右記のグラフは、期中の期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金（課税前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準や市場動向等を勘案し、当期の収益分配は見送ることとしました。収益分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行いました。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項 目 | 第5期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2022年4月21日～ 2023年4月20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 | 5,841 |

- (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。
- (注) 分配金は原則として決算日(原則、4月20日。当該日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始しております。
- (注) 分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、「普通分配金」と「元本払戻金(特別分配金)」にわかれます。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。
- (注) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

○今後の運用方針

当ファンドは、引き続き、投資先ファンドを主要投資対象とし、Shinseiショートターム・マザー・ファンドを一部組入れ、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行います。

投資先ファンド：Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY

投資先ファンドは、将来の見通しに依存しない銘柄選択モデルによるクオンツ運用を行っています。投資先ファンドの投資対象としている合計で約2,000銘柄の中から、バリュエーションやクオリティ、モメンタム、業績修正ファクターに基づいた銘柄選択モデルを利用して各銘柄をランク付けします。投資妙味があると判断される上位銘柄をオーバーウェイトとする一方で、下位銘柄をアンダーウェイトとすることにより、世界の株式市場の動きとの乖離を限定的に止めつつ、それを上回るリターンを獲得をめざして運用していく方針です。

Shinseiショートターム・マザー・ファンド

世界的なインフレ圧力の高まりから主要国／地域の中央銀行による利上げが相次いでいます。日銀は、物価上昇率（前年比）2%の「物価安定の目標」の実現をめざし、金融緩和を継続していましたが、2022年12月の金融政策決定会合で、長期金利の許容変動幅を拡大するなど今後の正常化への布石とも取れる修正を行ったため、市場では日銀の金融政策の先行きに関する思惑も広がり、金利の変動が大きくなる局面も予想されます。このような環境の中、Shinseiショートターム・マザー・ファンドでは、引き続き当初の運用方針に基づき、国庫短期証券等に投資していく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年4月21日～2023年4月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 101 | 0.671 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (33) | (0.220) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (63) | (0.418) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (5) | (0.033) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 21 | 0.139 | (b)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 費 用 ） | (6) | (0.039) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ 印 刷 ） | (15) | (0.100) | 法定開示資料の印刷にかかる費用 |
| 合 計 | 122 | 0.810 | |
| 期中の平均基準価額は、15,072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) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含まず。

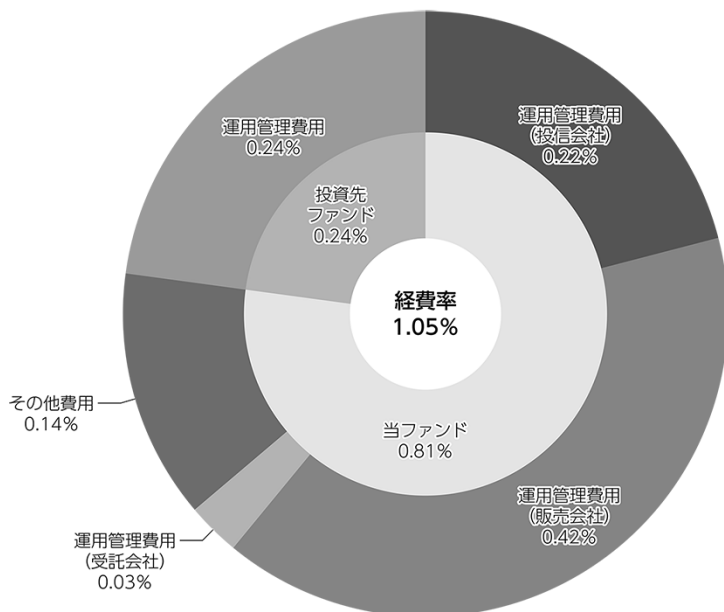
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く）が支払った費用を含まず。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は1.05%です。



(単位:%)

| 経費率 (①+②) | 1.05 |
|--------------------|------|
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.81 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.24 |

(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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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

(2022年4月21日～2023年4月20日)

投資信託証券

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------|--|-------|--------|-------|--------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| (邦 外 国 建) | Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | | 3,081 | 50,000 | 2,436 | 40,000 |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 単位未满是切捨てて表示しています。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

当期中における売買及び取引はありません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年4月21日～2023年4月20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

(2023年4月20日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|---|--|---------|---------|-----------|------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 口 | 口 | 千円 | % |
| | Robeco Capital Growth Funds - Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities - I JPY | 106,744 | 107,389 | 1,811,535 | 98.4 |
| | 合 計 | 106,744 | 107,389 | 1,811,535 | 98.4 |

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨てて表示しています。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合で、小数点第2位を四捨五入して表示しています。

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---|-------------------------|---------|-------|-------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| | Shinseiショートターム・マザー・ファンド | 90 | 90 | 89 |

(注) 口数・評価額の単位未满是切捨てて表示しています。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 1,811,535 | % 98.0 |
| Shinseiショートターム・マザー・ファンド | 89 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 36,781 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,848,405 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨てて表示しています。

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合で、小数点第2位を四捨五入して表示しています。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年4月20日現在)

○損益の状況 (2022年4月21日～2023年4月20日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,848,405,816 |
| コール・ローン等 | 36,780,562 |
| 投資証券(評価額) | 1,811,535,677 |
| Shinseiショートターム・マザー・ファンド(評価額) | 89,577 |
| (B) 負債 | 8,205,333 |
| 未払解約金 | 1,090,894 |
| 未払信託報酬 | 5,894,865 |
| 未払利息 | 110 |
| その他未払費用 | 1,219,464 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,840,200,483 |
| 元本 | 1,161,604,875 |
| 次期繰越損益金 | 678,595,608 |
| (D) 受益権総口数 | 1,161,604,875口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,842円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 31,000 |
| 支払利息 | △ 31,000 |
| (B) 有価証券売買損益 | 69,593,004 |
| 売買益 | 70,785,685 |
| 売買損 | △ 1,192,681 |
| (C) 信託報酬等 | △ 14,198,860 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 55,363,144 |
| (E) 前期繰越損益金 | 504,448,014 |
| (F) 追加信託差損益金 | 118,784,450 |
| (配当等相当額) | (93,397,923) |
| (売買損益相当額) | (25,386,527) |
| (G) 計(D+E+F) | 678,595,608 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 678,595,608 |
| 追加信託差損益金 | 118,784,450 |
| (配当等相当額) | (93,397,923) |
| (売買損益相当額) | (25,386,527) |
| 分配準備積立金 | 559,842,158 |
| 繰越損益金 | △ 31,000 |

(注) 当期運用報告書作成時点では監査未了です。

(注) 当ファンドの期首元本額は1,158,345,898円、期中追加設定元本額は73,132,259円、期中一部解約元本額は69,873,282円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,5842円です。

(注) 当期運用報告書作成時点では監査未了です。

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0.0円)、費用控除後の有価証券等損益額(55,367,658円)、収益調整金(118,753,450円)および分配準備積立金(504,474,500円)より分配対象収益は678,595,608円(10,000口当たり5,841円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○お知らせ

新生インベストメント・マネジメント株式会社は、2023年4月1日にSBIアセットマネジメント株式会社を存続会社として合併し、SBIアセットマネジメント株式会社となりました。

投資先ファンドの概要

| | | |
|---------|---|--|
| ファンド名 | Robeco Capital Growth Funds – Robeco QI Global Developed Enhanced Index Equities – I JPY | |
| 形態 | ルクセンブルグ籍円建て外国投資法人（会社型投資信託） | |
| 主な投資対象 | <p>①総資産のうち3分の2以上を先進国の株式に投資します。</p> <p>②銘柄選定では、株式のバリュエーション、クオリティ、モメンタム等を考慮します。</p> <p>③ESG（環境・社会・ガバナンス）評価を考慮した運用を行います。</p> <p>市況動向、資金動向その他の要因等によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。</p> | |
| 運用管理報酬等 | <p>純資産総額に対して年率0.25%が管理・投資運用等の対価として支払われます。</p> <p>※上記以外に、投資先ファンドの純資産総額に対して年率0.08%を上限として、管理事務代行報酬、監査報酬、法定書類作成費用等が別途投資先ファンドから支払われます。</p> <p>また、保管受託銀行報酬、組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料等についても別途投資先ファンドより支払われます。その他の費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p> | |
| その他 | 管理会社 | Robeco Institutional Asset Management B.V. |

保有有価証券

(2022年12月末現在)

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|-----------------------------------|--------|--------|------------------|-------------|
| 公的な取引所への上場が認められた有価証券ならびに短期金融商品 | | | | |
| 株式 | | | | |
| <i>オーストラリア</i> | | | | |
| Aristocrat Leisure Ltd. | 豪ドル | 994 | 19,277 | 0.03 |
| BHP Group Ltd. | 英ポンド | 3,147 | 91,158 | 0.13 |
| BHP Group Ltd. | 豪ドル | 4,389 | 127,255 | 0.19 |
| Brambles Ltd. | 豪ドル | 2,519 | 19,319 | 0.03 |
| Coles Group Ltd. | 豪ドル | 1,756 | 18,656 | 0.03 |
| Commonwealth Bank of Australia | 豪ドル | 2,322 | 151,380 | 0.22 |
| Fortescue Metals Group Ltd. | 豪ドル | 12,208 | 159,100 | 0.24 |
| Mineral Resources Ltd. | 豪ドル | 235 | 11,528 | 0.02 |
| National Australia Bank Ltd. | 豪ドル | 11,009 | 210,279 | 0.31 |
| Nufarm Ltd. | 豪ドル | 6,959 | 27,106 | 0.04 |
| Origin Energy Ltd. | 豪ドル | 2,792 | 13,696 | 0.02 |
| Qantas Airways Ltd. | 豪ドル | 2,652 | 10,128 | 0.02 |
| Rio Tinto Ltd. | 豪ドル | 622 | 46,009 | 0.07 |
| Santos Ltd. | 豪ドル | 4,415 | 20,030 | 0.03 |
| Scentre Group, REIT | 豪ドル | 6,655 | 12,179 | 0.02 |
| Stockland, REIT | 豪ドル | 33,156 | 76,476 | 0.11 |
| Telstra Group Ltd. | 豪ドル | 8,197 | 20,782 | 0.03 |
| Westpac Banking Corp. | 豪ドル | 13,811 | 204,914 | 0.30 |
| WiseTech Global Ltd. | 豪ドル | 295 | 9,513 | 0.01 |
| Woodside Energy Group Ltd. | 英ポンド | 568 | 12,740 | 0.02 |
| Woodside Energy Group Ltd. | 豪ドル | 2,205 | 49,655 | 0.07 |
| | | | <u>1,311,180</u> | <u>1.94</u> |
| <i>オーストリア</i> | | | | |
| OMV AG | ユーロ | 477 | 22,944 | 0.03 |
| | | | <u>22,944</u> | <u>0.03</u> |
| <i>ベルギー</i> | | | | |
| Solvay SA | ユーロ | 48 | 4,534 | 0.01 |
| UCB SA | ユーロ | 174 | 12,799 | 0.02 |
| Umicore SA | ユーロ | 296 | 10,159 | 0.01 |
| | | | <u>27,492</u> | <u>0.04</u> |
| <i>バミューダ</i> | | | | |
| Arch Capital Group Ltd. | 米ドル | 2,559 | 150,531 | 0.22 |
| Everest Re Group Ltd. | 米ドル | 399 | 123,848 | 0.19 |
| | | | <u>274,379</u> | <u>0.41</u> |
| <i>カナダ</i> | | | | |
| Agnico Eagle Mines Ltd. | カナダ・ドル | 641 | 31,189 | 0.05 |
| Algonquin Power & Utilities Corp. | カナダ・ドル | 934 | 5,697 | 0.01 |
| ARC Resources Ltd. | カナダ・ドル | 1,782 | 22,490 | 0.03 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--|------------|---------|------------------|-------------|
| Brookfield Asset Management Ltd. 'A' | カナダ・ドル | 512 | 13,727 | 0.02 |
| Brookfield Corp. | カナダ・ドル | 6,533 | 192,366 | 0.28 |
| Canadian National Railway Co. | カナダ・ドル | 337 | 37,483 | 0.05 |
| Canadian Utilities Ltd. 'A' | カナダ・ドル | 4,710 | 119,373 | 0.18 |
| CGI, Inc. | カナダ・ドル | 634 | 51,169 | 0.08 |
| CI Financial Corp. | カナダ・ドル | 12,924 | 120,743 | 0.18 |
| Dollarama, Inc. | カナダ・ドル | 2,740 | 150,048 | 0.22 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | カナダ・ドル | 285 | 158,077 | 0.23 |
| Franco-Nevada Corp. | カナダ・ドル | 170 | 21,698 | 0.03 |
| George Weston Ltd. | カナダ・ドル | 130 | 15,102 | 0.02 |
| Hydro One Ltd., Reg. S | カナダ・ドル | 5,592 | 140,257 | 0.21 |
| Loblaws Cos. Ltd. | カナダ・ドル | 1,847 | 152,913 | 0.23 |
| Magna International, Inc. | カナダ・ドル | 534 | 28,087 | 0.04 |
| Manulife Financial Corp. | カナダ・ドル | 10,948 | 182,836 | 0.27 |
| Metro, Inc. | カナダ・ドル | 341 | 17,679 | 0.03 |
| Northland Power, Inc. | カナダ・ドル | 4,564 | 117,187 | 0.17 |
| Nutrien Ltd. | カナダ・ドル | 731 | 49,969 | 0.07 |
| Onex Corp. | カナダ・ドル | 1,825 | 82,399 | 0.12 |
| Open Text Corp. | カナダ・ドル | 381 | 10,571 | 0.02 |
| Power Corp. of Canada | カナダ・ドル | 1,151 | 25,351 | 0.04 |
| Restaurant Brands International, Inc. | カナダ・ドル | 494 | 29,915 | 0.04 |
| Rogers Communications, Inc. 'B' | カナダ・ドル | 478 | 20,947 | 0.03 |
| Royal Bank of Canada | カナダ・ドル | 280 | 24,649 | 0.04 |
| Saputo, Inc. | カナダ・ドル | 443 | 10,269 | 0.01 |
| Sun Life Financial, Inc. | カナダ・ドル | 882 | 38,334 | 0.06 |
| Teck Resources Ltd. 'B' | カナダ・ドル | 1,123 | 39,738 | 0.06 |
| TFI International, Inc. | カナダ・ドル | 236 | 22,132 | 0.03 |
| Thomson Reuters Corp. | カナダ・ドル | 278 | 29,694 | 0.04 |
| TMX Group Ltd. | カナダ・ドル | 250 | 23,429 | 0.03 |
| Toromont Industries Ltd. | カナダ・ドル | 116 | 7,838 | 0.01 |
| Toronto-Dominion Bank (The) | カナダ・ドル | 1,998 | 121,131 | 0.18 |
| Tourmaline Oil Corp. | カナダ・ドル | 1,377 | 65,057 | 0.10 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | カナダ・ドル | 879 | 59,430 | 0.09 |
| | | | <u>2,238,974</u> | <u>3.30</u> |
| ケイマン諸島 | | | | |
| CK Asset Holdings Ltd. | 香港ドル | 23,802 | 137,300 | 0.20 |
| Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd. | 香港ドル | 224,000 | 32,807 | 0.05 |
| Wharf Real Estate Investment Co. Ltd. | 香港ドル | 5,000 | 27,312 | 0.04 |
| | | | <u>197,419</u> | <u>0.29</u> |
| キュラソー | | | | |
| Schlumberger Ltd. | 米ドル | 4,037 | 202,219 | 0.30 |
| | | | <u>202,219</u> | <u>0.30</u> |
| デンマーク | | | | |
| AP Moller - Maersk A/S 'A' | デンマーク・クローネ | 43 | 88,874 | 0.13 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|-------------------------------------|-------------|--------|----------------|-------------|
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | デンマーク・クローネ | 36 | 75,617 | 0.11 |
| Genmab A/S | デンマーク・クローネ | 426 | 168,477 | 0.25 |
| Novo Nordisk A/S 'B' | デンマーク・クローネ | 3,175 | 400,481 | 0.59 |
| Novozymes A/S 'B' | デンマーク・クローネ | 439 | 20,774 | 0.03 |
| | | | <u>754,223</u> | <u>1.11</u> |
| フィンランド | | | | |
| Neste OYJ | ユーロ | 870 | 37,427 | 0.06 |
| Nokia OYJ | ユーロ | 36,819 | 159,316 | 0.23 |
| Nordea Bank Abp | ユーロ | 968 | 9,709 | 0.01 |
| Nordea Bank Abp | スウェーデン・クローナ | 17,542 | 176,174 | 0.26 |
| Sampo OYJ 'A' | ユーロ | 682 | 33,295 | 0.05 |
| | | | <u>415,921</u> | <u>0.61</u> |
| フランス | | | | |
| Aeroports de Paris | ユーロ | 82 | 10,266 | 0.02 |
| AXA SA | ユーロ | 2,768 | 72,120 | 0.11 |
| BioMerieux | ユーロ | 1,440 | 141,005 | 0.21 |
| BNP Paribas SA | ユーロ | 2,885 | 153,626 | 0.23 |
| Bureau Veritas SA | ユーロ | 406 | 9,992 | 0.01 |
| Capgemini SE | ユーロ | 324 | 50,528 | 0.07 |
| Carrefour SA | ユーロ | 5,838 | 91,306 | 0.13 |
| Cie de Saint-Gobain | ユーロ | 790 | 36,064 | 0.05 |
| Danone SA | ユーロ | 1,012 | 49,821 | 0.07 |
| Dassault Systemes SE | ユーロ | 2,174 | 72,818 | 0.11 |
| Edenred | ユーロ | 378 | 19,233 | 0.03 |
| Eiffage SA | ユーロ | 257 | 23,623 | 0.03 |
| Engie SA | ユーロ | 3,944 | 52,802 | 0.08 |
| EssilorLuxottica SA | ユーロ | 246 | 41,623 | 0.06 |
| Getlink SE | ユーロ | 1,258 | 18,839 | 0.03 |
| Hermes International | ユーロ | 131 | 189,295 | 0.28 |
| Klepierre SA, REIT | ユーロ | 1,339 | 28,829 | 0.04 |
| La Francaise des Jeux SAEM, Reg. S | ユーロ | 561 | 21,082 | 0.03 |
| Legrand SA | ユーロ | 383 | 28,656 | 0.04 |
| L'Oreal SA | ユーロ | 374 | 124,766 | 0.18 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | ユーロ | 378 | 257,002 | 0.38 |
| Pernod Ricard SA | ユーロ | 313 | 57,514 | 0.09 |
| Publicis Groupe SA | ユーロ | 2,275 | 135,181 | 0.20 |
| Rexel SA | ユーロ | 4,928 | 90,872 | 0.13 |
| Safran SA | ユーロ | 503 | 58,811 | 0.09 |
| Sanofi | ユーロ | 2,414 | 216,874 | 0.32 |
| Schneider Electric SE | ユーロ | 810 | 105,883 | 0.16 |
| Societe Generale SA | ユーロ | 4,567 | 107,233 | 0.16 |
| TotalEnergies SE | ユーロ | 173 | 10,146 | 0.02 |
| Veolia Environnement SA | ユーロ | 903 | 21,672 | 0.03 |
| Vinci SA | ユーロ | 742 | 69,221 | 0.10 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|---|------|--------|------------------|-------------|
| Vivendi SE | ユーロ | 1,353 | 12,061 | 0.02 |
| | | | <u>2,378,764</u> | <u>3.51</u> |
| <i>ドイツ</i> | | | | |
| BASF SE | ユーロ | 777 | 36,045 | 0.05 |
| Bayer AG | ユーロ | 2,615 | 126,370 | 0.19 |
| Bayerische Motoren Werke AG | ユーロ | 451 | 37,604 | 0.05 |
| Beiersdorf AG | ユーロ | 178 | 19,082 | 0.03 |
| Carl Zeiss Meditec AG | ユーロ | 205 | 24,169 | 0.03 |
| Daimler Truck Holding AG | ユーロ | 636 | 18,409 | 0.03 |
| Deutsche Bank AG | ユーロ | 3,626 | 38,392 | 0.06 |
| Deutsche Boerse AG | ユーロ | 287 | 46,322 | 0.07 |
| Deutsche Lufthansa AG | ユーロ | 4,332 | 33,638 | 0.05 |
| Deutsche Post AG | ユーロ | 1,474 | 51,855 | 0.08 |
| Deutsche Telekom AG | ユーロ | 4,692 | 87,449 | 0.13 |
| Dr Ing hc F Porsche AG | ユーロ | 157 | 14,876 | 0.02 |
| GEA Group AG | ユーロ | 3,612 | 137,978 | 0.20 |
| Henkel AG & Co. KGaA | ユーロ | 66 | 3,976 | 0.01 |
| Henkel AG & Co. KGaA Preference | ユーロ | 246 | 15,995 | 0.02 |
| HUGO BOSS AG | ユーロ | 1,567 | 84,869 | 0.12 |
| Infineon Technologies AG | ユーロ | 2,864 | 81,424 | 0.12 |
| Mercedes-Benz Group AG | ユーロ | 2,082 | 127,835 | 0.19 |
| Merck KGaA | ユーロ | 173 | 31,296 | 0.05 |
| MTU Aero Engines AG | ユーロ | 136 | 27,499 | 0.04 |
| Porsche Automobil Holding SE Preference | ユーロ | 97 | 4,970 | 0.01 |
| Rheinmetall AG | ユーロ | 113 | 21,024 | 0.03 |
| SAP SE | ユーロ | 264 | 25,447 | 0.04 |
| Sartorius AG Preference | ユーロ | 51 | 18,839 | 0.03 |
| Scout24 SE, Reg. S | ユーロ | 933 | 43,786 | 0.06 |
| Siemens Energy AG | ユーロ | 570 | 10,018 | 0.01 |
| Volkswagen AG Preference | ユーロ | 276 | 32,132 | 0.05 |
| | | | <u>1,201,299</u> | <u>1.77</u> |
| <i>ガーンジー</i> | | | | |
| Amdocs Ltd. | 米ドル | 1,047 | 89,175 | 0.13 |
| | | | <u>89,175</u> | <u>0.13</u> |
| <i>香港</i> | | | | |
| Bank of East Asia Ltd. (The) | 香港ドル | 16,400 | 18,625 | 0.03 |
| BOC Hong Kong Holdings Ltd. | 香港ドル | 7,000 | 22,353 | 0.03 |
| Sino Land Co. Ltd. | 香港ドル | 70,302 | 82,372 | 0.12 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd. | 香港ドル | 12,000 | 153,857 | 0.23 |
| Swire Properties Ltd. | 香港ドル | 13,600 | 32,393 | 0.05 |
| | | | <u>309,600</u> | <u>0.46</u> |
| <i>アイルランド</i> | | | | |
| Accenture plc 'A' | 米ドル | 284 | 71,007 | 0.10 |
| CRH plc | ユーロ | 871 | 32,236 | 0.05 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--|-------------|--------|----------------|------------|
| Eaton Corp. plc | 米ドル | 543 | 79,854 | 0.12 |
| Jazz Pharmaceuticals plc | 米ドル | 83 | 12,389 | 0.02 |
| Johnson Controls International plc | 米ドル | 989 | 59,308 | 0.09 |
| Linde plc | 米ドル | 703 | 214,855 | 0.31 |
| Smurfit Kappa Group plc | ユーロ | 341 | 11,785 | 0.02 |
| Trane Technologies plc | 米ドル | 1,128 | 177,658 | 0.26 |
| Willis Towers Watson plc | 米ドル | 354 | 81,126 | 0.12 |
| | | | <hr/> | |
| | | | 740,218 | 1.09 |
| <i>イスラエル</i> | | | | |
| Bank Hapoalim BM | イスラエル・新シェケル | 1,753 | 14,766 | 0.02 |
| Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd. | イスラエル・新シェケル | 44,777 | 72,116 | 0.11 |
| Check Point Software Technologies Ltd. | 米ドル | 824 | 97,405 | 0.14 |
| Nice Ltd. | イスラエル・新シェケル | 93 | 16,793 | 0.03 |
| | | | <hr/> | |
| | | | 201,080 | 0.30 |
| <i>イタリア</i> | | | | |
| Eni SpA | ユーロ | 4,048 | 53,782 | 0.08 |
| Intesa Sanpaolo SpA | ユーロ | 24,883 | 51,707 | 0.08 |
| Prysmian SpA | ユーロ | 822 | 28,490 | 0.04 |
| Terna - Rete Elettrica Nazionale | ユーロ | 1,942 | 13,400 | 0.02 |
| UniCredit SpA | ユーロ | 5,370 | 71,271 | 0.10 |
| | | | <hr/> | |
| | | | 218,650 | 0.32 |
| <i>日本</i> | | | | |
| Advantest Corp. | 日本円 | 400 | 24,088 | 0.04 |
| Ajinomoto Co., Inc. | 日本円 | 3,900 | 111,640 | 0.17 |
| Astellas Pharma, Inc. | 日本円 | 2,600 | 37,047 | 0.05 |
| Bandai Namco Holdings, Inc. | 日本円 | 500 | 29,520 | 0.04 |
| Canon Marketing Japan, Inc. | 日本円 | 1,900 | 40,329 | 0.06 |
| Cosmo Energy Holdings Co. Ltd. | 日本円 | 1,200 | 29,740 | 0.04 |
| Dai Nippon Printing Co. Ltd. | 日本円 | 1,200 | 22,582 | 0.03 |
| Daiichi Sankyo Co. Ltd. | 日本円 | 3,900 | 117,705 | 0.17 |
| Daito Trust Construction Co. Ltd. | 日本円 | 200 | 19,230 | 0.03 |
| Fuji Electric Co. Ltd. | 日本円 | 1,800 | 64,296 | 0.10 |
| Hitachi Ltd. | 日本円 | 1,500 | 71,273 | 0.11 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 日本円 | 7,300 | 157,178 | 0.23 |
| Ibiden Co. Ltd. | 日本円 | 3,800 | 129,124 | 0.19 |
| Idemitsu Kosan Co. Ltd. | 日本円 | 3,200 | 69,764 | 0.10 |
| Inpex Corp. | 日本円 | 3,300 | 32,715 | 0.05 |
| Japan Post Bank Co. Ltd. | 日本円 | 11,200 | 89,716 | 0.13 |
| Japan Post Holdings Co. Ltd. | 日本円 | 2,400 | 18,909 | 0.03 |
| Japan Post Insurance Co. Ltd. | 日本円 | 5,400 | 89,004 | 0.13 |
| Kamigumi Co. Ltd. | 日本円 | 1,900 | 36,255 | 0.05 |
| KDDI Corp. | 日本円 | 2,500 | 70,694 | 0.10 |
| Kewpie Corp. | 日本円 | 4,800 | 81,467 | 0.12 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 日本円 | 1,200 | 17,137 | 0.03 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユ一口) | 構成比 (%) |
|---------------------------------------|-----|--------|----------------|------------|
| Komatsu Ltd. | 日本円 | 1,200 | 24,508 | 0.04 |
| Marubeni Corp. | 日本円 | 2,500 | 26,896 | 0.04 |
| Maruichi Steel Tube Ltd. | 日本円 | 1,900 | 36,470 | 0.05 |
| Mazda Motor Corp. | 日本円 | 1,600 | 11,419 | 0.02 |
| Mitsubishi Corp. | 日本円 | 2,000 | 60,830 | 0.09 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 日本円 | 3,000 | 27,983 | 0.04 |
| Mitsubishi Estate Co. Ltd. | 日本円 | 1,600 | 19,441 | 0.03 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 日本円 | 600 | 22,301 | 0.03 |
| Mitsubishi Logistics Corp. | 日本円 | 5,900 | 126,951 | 0.19 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 日本円 | 18,200 | 114,898 | 0.17 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 日本円 | 2,000 | 54,723 | 0.08 |
| Mitsui Fudosan Co. Ltd. | 日本円 | 1,300 | 22,313 | 0.03 |
| Nexon Co. Ltd. | 日本円 | 1,200 | 25,241 | 0.04 |
| NGK Spark Plug Co. Ltd. | 日本円 | 3,300 | 57,157 | 0.08 |
| Nikon Corp. | 日本円 | 6,400 | 53,448 | 0.08 |
| Nintendo Co. Ltd. | 日本円 | 4,800 | 188,566 | 0.28 |
| Nippon Steel Corp. | 日本円 | 1,200 | 19,532 | 0.03 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 日本円 | 2,400 | 64,117 | 0.09 |
| Nishi-Nippon Financial Holdings, Inc. | 日本円 | 7,300 | 49,922 | 0.07 |
| Nitto Denko Corp. | 日本円 | 400 | 21,730 | 0.03 |
| Nomura Real Estate Holdings, Inc. | 日本円 | 2,600 | 52,252 | 0.08 |
| Olympus Corp. | 日本円 | 1,900 | 31,735 | 0.05 |
| Ono Pharmaceutical Co. Ltd. | 日本円 | 1,300 | 28,462 | 0.04 |
| ORIX Corp. | 日本円 | 2,000 | 30,088 | 0.04 |
| Recruit Holdings Co. Ltd. | 日本円 | 1,900 | 56,358 | 0.08 |
| Rohm Co. Ltd. | 日本円 | 200 | 13,535 | 0.02 |
| Roho Pharmaceutical Co. Ltd. | 日本円 | 5,600 | 92,261 | 0.14 |
| Sankyu, Inc. | 日本円 | 800 | 27,440 | 0.04 |
| SCREEN Holdings Co. Ltd. | 日本円 | 1,100 | 66,085 | 0.10 |
| Secom Co. Ltd. | 日本円 | 400 | 21,426 | 0.03 |
| Sega Sammy Holdings, Inc. | 日本円 | 5,500 | 77,998 | 0.12 |
| Shimamura Co. Ltd. | 日本円 | 1,100 | 102,330 | 0.15 |
| Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. | 日本円 | 600 | 69,132 | 0.10 |
| SMC Corp. | 日本円 | 100 | 39,469 | 0.06 |
| SoftBank Group Corp. | 日本円 | 4,700 | 188,376 | 0.28 |
| Sompo Holdings, Inc. | 日本円 | 1,400 | 58,259 | 0.09 |
| Subaru Corp. | 日本円 | 900 | 12,958 | 0.02 |
| Sumitomo Corp. | 日本円 | 1,800 | 28,070 | 0.04 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 日本円 | 4,000 | 150,435 | 0.22 |
| Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. | 日本円 | 500 | 16,290 | 0.02 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 日本円 | 2,307 | 67,350 | 0.10 |
| TDK Corp. | 日本円 | 500 | 15,392 | 0.02 |
| TIS, Inc. | 日本円 | 4,300 | 106,265 | 0.16 |
| Tokyo Gas Co. Ltd. | 日本円 | 1,200 | 22,028 | 0.03 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|-------------------------------|------------|--------|------------------|-------------|
| Tokyo Ohka Kogyo Co. Ltd. | 日本円 | 3,100 | 131,865 | 0.19 |
| TOPPAN, Inc. | 日本円 | 400 | 5,550 | 0.01 |
| Toyo Suisan Kaisha Ltd. | 日本円 | 1,400 | 50,704 | 0.08 |
| Trend Micro, Inc. | 日本円 | 400 | 17,441 | 0.03 |
| Ushio, Inc. | 日本円 | 7,100 | 82,033 | 0.12 |
| Yakult Honsha Co. Ltd. | 日本円 | 2,400 | 145,890 | 0.22 |
| Z Holdings Corp. | 日本円 | 4,900 | 11,552 | 0.02 |
| | | | <u>4,206,888</u> | <u>6.21</u> |
| <i>ジャージー</i> | | | | |
| Ancor plc | 米ドル | 2,709 | 30,231 | 0.04 |
| Ferguson plc | 米ドル | 296 | 35,215 | 0.05 |
| Glencore plc | 英ポンド | 20,290 | 126,328 | 0.19 |
| | | | <u>191,774</u> | <u>0.28</u> |
| <i>オランダ</i> | | | | |
| AerCap Holdings NV | 米ドル | 187 | 10,218 | 0.01 |
| Argenx SE | ユーロ | 119 | 41,448 | 0.06 |
| ASML Holding NV | ユーロ | 490 | 246,862 | 0.36 |
| CNH Industrial NV | ユーロ | 10,310 | 154,289 | 0.23 |
| EXOR NV | ユーロ | 150 | 10,245 | 0.01 |
| Ferrari NV | ユーロ | 204 | 40,841 | 0.06 |
| Heineken Holding NV | ユーロ | 73 | 5,260 | 0.01 |
| ING Groep NV | ユーロ | 5,343 | 60,846 | 0.09 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | ユーロ | 4,799 | 128,805 | 0.19 |
| Koninklijke DSM NV | ユーロ | 246 | 28,118 | 0.04 |
| Koninklijke Philips NV | ユーロ | 1,430 | 20,026 | 0.03 |
| NN Group NV | ユーロ | 2,233 | 85,211 | 0.13 |
| NXP Semiconductors NV | 米ドル | 953 | 141,113 | 0.21 |
| QIAGEN NV | ユーロ | 662 | 31,120 | 0.05 |
| Randstad NV | ユーロ | 776 | 44,201 | 0.07 |
| Signify NV, Reg. S | ユーロ | 1,840 | 57,739 | 0.08 |
| Stellantis NV | ユーロ | 12,829 | 170,164 | 0.25 |
| STMicroelectronics NV | ユーロ | 4,668 | 154,021 | 0.23 |
| Wolters Kluwer NV | ユーロ | 1,665 | 162,770 | 0.24 |
| | | | <u>1,593,297</u> | <u>2.35</u> |
| <i>ノルウェー</i> | | | | |
| Aker BP ASA | ノルウェー・クローネ | 267 | 7,723 | 0.01 |
| Equinor ASA | ノルウェー・クローネ | 5,056 | 169,183 | 0.25 |
| Norsk Hydro ASA | ノルウェー・クローネ | 3,518 | 24,534 | 0.03 |
| Yara International ASA | ノルウェー・クローネ | 284 | 11,632 | 0.02 |
| | | | <u>213,072</u> | <u>0.31</u> |
| <i>ポルトガル</i> | | | | |
| EDP - Energias de Portugal SA | ユーロ | 3,881 | 18,070 | 0.03 |
| Jeronimo Martins SGPS SA | ユーロ | 6,894 | 139,121 | 0.20 |
| | | | <u>157,191</u> | <u>0.23</u> |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--------------------------------------|-------------|--------|----------------|-------------|
| シンガポール | | | | |
| City Developments Ltd. | シンガポール・ドル | 4,800 | 27,598 | 0.04 |
| DBS Group Holdings Ltd. | シンガポール・ドル | 2,538 | 60,144 | 0.09 |
| Hutchison Port Holdings Trust | 米ドル | 81,700 | 14,851 | 0.02 |
| Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. | シンガポール・ドル | 14,663 | 124,770 | 0.19 |
| Singapore Airlines Ltd. | シンガポール・ドル | 3,000 | 11,590 | 0.02 |
| United Overseas Bank Ltd. | シンガポール・ドル | 1,600 | 34,316 | 0.05 |
| UOL Group Ltd. | シンガポール・ドル | 7,400 | 34,741 | 0.05 |
| | | | 308,010 | 0.46 |
| スペイン | | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | ユーロ | 28,693 | 161,656 | 0.24 |
| Banco Santander SA | ユーロ | 12,742 | 35,709 | 0.05 |
| Corp. ACCIONA Energias Renovables SA | ユーロ | 630 | 22,768 | 0.03 |
| Endesa SA | ユーロ | 6,757 | 119,160 | 0.18 |
| Iberdrola SA | ユーロ | 20,969 | 229,191 | 0.34 |
| Industria de Diseno Textil SA | ユーロ | 1,656 | 41,152 | 0.06 |
| Red Electrica Corp. SA | ユーロ | 1,397 | 22,715 | 0.03 |
| Repsol SA | ユーロ | 2,095 | 31,111 | 0.05 |
| Telefonica SA | ユーロ | 33,285 | 112,670 | 0.17 |
| | | | 776,132 | 1.15 |
| 多国籍 | | | | |
| Unibail-Rodamco-Westfield, REIT | ユーロ | 197 | 9,580 | 0.01 |
| | | | 9,580 | 0.01 |
| スウェーデン | | | | |
| Assa Abloy AB 'B' | スウェーデン・クローナ | 1,552 | 31,221 | 0.05 |
| Atlas Copco AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 15,049 | 166,591 | 0.25 |
| Atlas Copco AB 'B' | スウェーデン・クローナ | 2,195 | 21,930 | 0.03 |
| Industrivarden AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 35 | 798 | - |
| Investor AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 701 | 12,220 | 0.02 |
| Nibe Industrier AB 'B' | スウェーデン・クローナ | 2,488 | 21,725 | 0.03 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 2,425 | 26,158 | 0.04 |
| Svenska Handelsbanken AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 1,076 | 10,169 | 0.02 |
| Swedbank AB 'A' | スウェーデン・クローナ | 1,250 | 19,930 | 0.03 |
| Swedish Orphan Biovitrum AB | スウェーデン・クローナ | 3,579 | 69,422 | 0.10 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | スウェーデン・クローナ | 3,871 | 21,200 | 0.03 |
| Trelleborg AB 'B' | スウェーデン・クローナ | 4,397 | 95,214 | 0.14 |
| Volvo AB 'B' | スウェーデン・クローナ | 8,119 | 137,611 | 0.20 |
| | | | 634,189 | 0.94 |
| スイス | | | | |
| ABB Ltd. | スイス・フラン | 2,245 | 63,797 | 0.09 |
| Alcon, Inc. | スイス・フラン | 705 | 45,109 | 0.07 |
| Chubb Ltd. | 米ドル | 1,224 | 253,000 | 0.37 |
| Cie Financiere Richemont SA | スイス・フラン | 1,846 | 224,155 | 0.33 |
| Clariant AG | スイス・フラン | 2,140 | 31,750 | 0.05 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--|---------|--------|------------------|-------------|
| Coca-Cola HBC AG | 英ポンド | 885 | 19,680 | 0.03 |
| Holcim AG | スイス・フラン | 832 | 40,344 | 0.06 |
| Julius Baer Group Ltd. | スイス・フラン | 336 | 18,328 | 0.03 |
| Nestle SA | スイス・フラン | 3,694 | 400,818 | 0.59 |
| Novartis AG | スイス・フラン | 3,037 | 257,097 | 0.38 |
| Partners Group Holding AG | スイス・フラン | 35 | 28,952 | 0.04 |
| PSP Swiss Property AG | スイス・フラン | 1,302 | 143,067 | 0.21 |
| Roche Holding AG | スイス・フラン | 38 | 13,793 | 0.02 |
| Roche Holding AG | スイス・フラン | 957 | 281,551 | 0.42 |
| Sonova Holding AG | スイス・フラン | 207 | 45,973 | 0.07 |
| Swatch Group AG (The) | スイス・フラン | 57 | 15,182 | 0.02 |
| UBS Group AG | スイス・フラン | 2,361 | 41,139 | 0.06 |
| | | | <u>1,923,735</u> | <u>2.84</u> |
| <i>英国</i> | | | | |
| 3i Group plc | 英ポンド | 9,511 | 143,807 | 0.21 |
| abrdn plc | 英ポンド | 5,092 | 10,861 | 0.01 |
| Anglo American plc | 英ポンド | 2,437 | 88,899 | 0.13 |
| AstraZeneca plc | 英ポンド | 603 | 76,242 | 0.11 |
| Aviva plc | 英ポンド | 4,465 | 22,284 | 0.03 |
| Barclays plc | 英ポンド | 98,810 | 176,542 | 0.26 |
| BP plc | 英ポンド | 36,281 | 194,198 | 0.29 |
| Bunzl plc | 英ポンド | 3,142 | 97,706 | 0.14 |
| Burberry Group plc | 英ポンド | 672 | 15,375 | 0.02 |
| Centrica plc | 英ポンド | 97,421 | 105,982 | 0.16 |
| Coca-Cola Europacific Partners plc | 米ドル | 475 | 24,621 | 0.04 |
| Compass Group plc | 英ポンド | 2,499 | 54,009 | 0.08 |
| Diageo plc | 英ポンド | 3,121 | 128,396 | 0.19 |
| GSK plc | 英ポンド | 11,167 | 180,941 | 0.27 |
| Haleon plc | 英ポンド | 7,142 | 26,351 | 0.04 |
| HSBC Holdings plc | 英ポンド | 27,391 | 159,209 | 0.23 |
| Inchcape plc | 英ポンド | 10,095 | 93,300 | 0.14 |
| InterContinental Hotels Group plc | 英ポンド | 458 | 24,489 | 0.04 |
| International Distributions Services plc | 英ポンド | 14,109 | 33,872 | 0.05 |
| Investec plc | 英ポンド | 18,531 | 106,813 | 0.16 |
| Johnson Matthey plc | 英ポンド | 419 | 10,045 | 0.01 |
| Legal & General Group plc | 英ポンド | 8,775 | 24,676 | 0.04 |
| Liberty Global plc 'A' | 米ドル | 891 | 15,804 | 0.02 |
| Liberty Global plc 'C' | 米ドル | 2,251 | 40,981 | 0.06 |
| NatWest Group plc | 英ポンド | 51,632 | 154,332 | 0.23 |
| Pearson plc | 英ポンド | 954 | 10,099 | 0.01 |
| Reckitt Benckiser Group plc | 英ポンド | 1,638 | 106,230 | 0.16 |
| Rio Tinto plc | 英ポンド | 3,317 | 216,764 | 0.32 |
| Sage Group plc (The) | 英ポンド | 12,052 | 101,281 | 0.15 |
| Shell plc | 英ポンド | 497 | 13,030 | 0.02 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|---------------------------------------|------|--------|------------------|-------------|
| Shell plc | ユーロ | 2,479 | 65,644 | 0.10 |
| Smiths Group plc | 英ポンド | 638 | 11,495 | 0.02 |
| SSE plc | 英ポンド | 1,653 | 31,896 | 0.05 |
| Standard Chartered plc | 英ポンド | 4,211 | 29,540 | 0.04 |
| Tesco plc | 英ポンド | 42,283 | 106,848 | 0.16 |
| Unilever plc | ユーロ | 6,539 | 306,483 | 0.45 |
| Vodafone Group plc | 英ポンド | 37,768 | 35,860 | 0.05 |
| | | | <u>3,044,905</u> | <u>4.49</u> |
| 米国 | | | | |
| 3M Co. | 米ドル | 704 | 79,104 | 0.12 |
| Abbott Laboratories | 米ドル | 564 | 58,020 | 0.09 |
| AbbVie, Inc. | 米ドル | 3,125 | 473,208 | 0.70 |
| Activision Blizzard, Inc. | 米ドル | 1,136 | 81,481 | 0.12 |
| Acuity Brands, Inc. | 米ドル | 602 | 93,415 | 0.14 |
| Adobe, Inc. | 米ドル | 1,073 | 338,343 | 0.50 |
| Aflac, Inc. | 米ドル | 2,831 | 190,829 | 0.28 |
| AGCO Corp. | 米ドル | 886 | 115,136 | 0.17 |
| Agilent Technologies, Inc. | 米ドル | 1,323 | 185,511 | 0.27 |
| Airbnb, Inc. 'A' | 米ドル | 1,933 | 154,857 | 0.23 |
| Albemarle Corp. | 米ドル | 176 | 35,762 | 0.05 |
| Alcoa Corp. | 米ドル | 481 | 20,493 | 0.03 |
| Ally Financial, Inc. | 米ドル | 2,640 | 60,481 | 0.09 |
| Alnylam Pharmaceuticals, Inc. | 米ドル | 180 | 40,082 | 0.06 |
| Alphabet, Inc. 'A' | 米ドル | 9,770 | 807,690 | 1.19 |
| Alphabet, Inc. 'C' | 米ドル | 8,027 | 667,356 | 0.98 |
| Amazon.com, Inc. | 米ドル | 12,842 | 1,010,755 | 1.49 |
| American Electric Power Co., Inc. | 米ドル | 2,163 | 192,436 | 0.28 |
| American Financial Group, Inc. | 米ドル | 183 | 23,539 | 0.03 |
| American International Group, Inc. | 米ドル | 3,370 | 199,690 | 0.29 |
| American Tower Corp., REIT | 米ドル | 141 | 27,990 | 0.04 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 米ドル | 158 | 46,096 | 0.07 |
| AmerisourceBergen Corp. | 米ドル | 885 | 137,412 | 0.20 |
| AMETEK, Inc. | 米ドル | 1,306 | 170,976 | 0.25 |
| Amgen, Inc. | 米ドル | 994 | 244,614 | 0.36 |
| Analog Devices, Inc. | 米ドル | 664 | 102,053 | 0.15 |
| Annaly Capital Management, Inc., REIT | 米ドル | 518 | 10,231 | 0.02 |
| APA Corp. | 米ドル | 559 | 24,450 | 0.04 |
| Apollo Global Management, Inc. | 米ドル | 566 | 33,830 | 0.05 |
| Apple, Inc. | 米ドル | 21,568 | 2,625,749 | 3.87 |
| Applied Materials, Inc. | 米ドル | 1,187 | 108,306 | 0.16 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 米ドル | 2,269 | 197,401 | 0.29 |
| Arista Networks, Inc. | 米ドル | 1,444 | 164,188 | 0.24 |
| Arrow Electronics, Inc. | 米ドル | 810 | 79,364 | 0.12 |
| AT&T, Inc. | 米ドル | 17,947 | 309,585 | 0.46 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|-------------------------------------|-----|-------|----------------|------------|
| Atlassian Corp. 'A' | 米ドル | 607 | 73,187 | 0.11 |
| Autodesk, Inc. | 米ドル | 992 | 173,694 | 0.26 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 米ドル | 1,141 | 255,366 | 0.38 |
| AutoZone, Inc. | 米ドル | 69 | 159,444 | 0.24 |
| AvalonBay Communities, Inc., REIT | 米ドル | 219 | 33,144 | 0.05 |
| Avery Dennison Corp. | 米ドル | 138 | 23,404 | 0.03 |
| Avnet, Inc. | 米ドル | 2,140 | 83,374 | 0.12 |
| Baker Hughes Co. | 米ドル | 1,437 | 39,761 | 0.06 |
| Bank of America Corp. | 米ドル | 4,576 | 142,007 | 0.21 |
| Bank of New York Mellon Corp. (The) | 米ドル | 4,398 | 187,582 | 0.28 |
| Bath & Body Works, Inc. | 米ドル | 361 | 14,254 | 0.02 |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'B' | 米ドル | 1,147 | 331,982 | 0.49 |
| Best Buy Co., Inc. | 米ドル | 783 | 58,847 | 0.09 |
| Biogen, Inc. | 米ドル | 708 | 183,705 | 0.27 |
| Bio-Rad Laboratories, Inc. 'A' | 米ドル | 32 | 12,608 | 0.02 |
| BlackRock, Inc. | 米ドル | 208 | 138,107 | 0.20 |
| Booking Holdings, Inc. | 米ドル | 56 | 105,744 | 0.16 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 米ドル | 258 | 25,267 | 0.04 |
| BorgWarner, Inc. | 米ドル | 638 | 24,061 | 0.04 |
| Brighthouse Financial, Inc. | 米ドル | 2,188 | 105,110 | 0.16 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 米ドル | 4,276 | 288,272 | 0.43 |
| Brixmor Property Group, Inc., REIT | 米ドル | 654 | 13,892 | 0.02 |
| Broadcom, Inc. | 米ドル | 732 | 383,493 | 0.57 |
| Brown-Forman Corp. 'B' | 米ドル | 484 | 29,786 | 0.04 |
| Cadence Design Systems, Inc. | 米ドル | 1,305 | 196,426 | 0.29 |
| Campbell Soup Co. | 米ドル | 713 | 37,913 | 0.06 |
| Capital One Financial Corp. | 米ドル | 1,815 | 158,091 | 0.23 |
| Cardinal Health, Inc. | 米ドル | 2,039 | 146,862 | 0.22 |
| Carlyle Group, Inc. (The) | 米ドル | 281 | 7,857 | 0.01 |
| Carrier Global Corp. | 米ドル | 1,233 | 47,656 | 0.07 |
| Caterpillar, Inc. | 米ドル | 588 | 131,985 | 0.19 |
| Cboe Global Markets, Inc. | 米ドル | 200 | 23,513 | 0.03 |
| CBRE Group, Inc. 'A' | 米ドル | 2,304 | 166,143 | 0.25 |
| Celanese Corp. | 米ドル | 166 | 15,902 | 0.02 |
| Centene Corp. | 米ドル | 2,516 | 193,335 | 0.29 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 米ドル | 910 | 25,571 | 0.04 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 米ドル | 421 | 33,609 | 0.05 |
| CH Robinson Worldwide, Inc. | 米ドル | 240 | 20,590 | 0.03 |
| Cheniere Energy, Inc. | 米ドル | 1,080 | 151,752 | 0.22 |
| Chevron Corp. | 米ドル | 2,631 | 442,481 | 0.65 |
| Chewy, Inc. 'A' | 米ドル | 3,513 | 122,054 | 0.18 |
| Chipotle Mexican Grill, Inc. | 米ドル | 133 | 172,908 | 0.26 |
| Cigna Corp. | 米ドル | 841 | 261,098 | 0.39 |
| Cintas Corp. | 米ドル | 436 | 184,499 | 0.27 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--------------------------------|-----|-------|----------------|------------|
| Cisco Systems, Inc. | 米ドル | 5,824 | 259,972 | 0.38 |
| Citigroup, Inc. | 米ドル | 5,926 | 251,144 | 0.37 |
| Clorox Co. (The) | 米ドル | 662 | 87,045 | 0.13 |
| Coca-Cola Co. (The) | 米ドル | 5,621 | 335,022 | 0.49 |
| Colgate-Palmolive Co. | 米ドル | 2,214 | 163,449 | 0.24 |
| Comcast Corp. 'A' | 米ドル | 6,237 | 204,364 | 0.30 |
| Conagra Brands, Inc. | 米ドル | 684 | 24,803 | 0.04 |
| ConocoPhillips | 米ドル | 1,964 | 217,149 | 0.32 |
| Consolidated Edison, Inc. | 米ドル | 1,993 | 177,983 | 0.26 |
| Constellation Energy Corp. | 米ドル | 453 | 36,592 | 0.05 |
| Corteva, Inc. | 米ドル | 2,396 | 131,962 | 0.19 |
| CoStar Group, Inc. | 米ドル | 2,392 | 173,206 | 0.26 |
| Costco Wholesale Corp. | 米ドル | 200 | 85,547 | 0.13 |
| CrowdStrike Holdings, Inc. 'A' | 米ドル | 1,273 | 125,588 | 0.19 |
| Cummins, Inc. | 米ドル | 778 | 176,624 | 0.26 |
| CVS Health Corp. | 米ドル | 3,110 | 271,559 | 0.40 |
| Danaher Corp. | 米ドル | 927 | 230,541 | 0.34 |
| Darden Restaurants, Inc. | 米ドル | 210 | 27,219 | 0.04 |
| Datadog, Inc. 'A' | 米ドル | 801 | 55,164 | 0.08 |
| Deere & Co. | 米ドル | 292 | 117,309 | 0.17 |
| Dell Technologies, Inc. 'C' | 米ドル | 387 | 14,584 | 0.02 |
| Dick's Sporting Goods, Inc. | 米ドル | 931 | 104,933 | 0.15 |
| Discover Financial Services | 米ドル | 1,407 | 128,973 | 0.19 |
| DocuSign, Inc. | 米ドル | 2,803 | 145,554 | 0.21 |
| DoorDash, Inc. 'A' | 米ドル | 205 | 9,377 | 0.01 |
| Dow, Inc. | 米ドル | 1,023 | 48,301 | 0.07 |
| Dropbox, Inc. 'A' | 米ドル | 6,794 | 142,469 | 0.21 |
| DTE Energy Co. | 米ドル | 1,474 | 162,323 | 0.24 |
| Duke Energy Corp. | 米ドル | 922 | 88,973 | 0.13 |
| DuPont de Nemours, Inc. | 米ドル | 719 | 46,236 | 0.07 |
| DXC Technology Co. | 米ドル | 1,681 | 41,740 | 0.06 |
| eBay, Inc. | 米ドル | 4,413 | 171,475 | 0.25 |
| Electronic Arts, Inc. | 米ドル | 1,559 | 178,476 | 0.26 |
| Elevance Health, Inc. | 米ドル | 380 | 182,646 | 0.27 |
| Eli Lilly & Co. | 米ドル | 586 | 200,874 | 0.30 |
| Enphase Energy, Inc. | 米ドル | 627 | 155,662 | 0.23 |
| Entergy Corp. | 米ドル | 332 | 34,997 | 0.05 |
| EQT Corp. | 米ドル | 1,800 | 57,057 | 0.08 |
| Equitable Holdings, Inc. | 米ドル | 2,698 | 72,553 | 0.11 |
| Equity Residential, REIT | 米ドル | 2,736 | 151,252 | 0.22 |
| Etsy, Inc. | 米ドル | 1,383 | 155,217 | 0.23 |
| Eversource Energy | 米ドル | 546 | 42,892 | 0.06 |
| Exelon Corp. | 米ドル | 4,666 | 189,001 | 0.28 |
| Expedia Group, Inc. | 米ドル | 203 | 16,662 | 0.02 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|---|-----|-------|----------------|------------|
| Expeditors International of Washington, Inc. | 米ドル | 1,532 | 149,174 | 0.22 |
| Exxon Mobil Corp. | 米ドル | 7,008 | 724,275 | 1.07 |
| F5, Inc. | 米ドル | 102 | 13,716 | 0.02 |
| FactSet Research Systems, Inc. | 米ドル | 71 | 26,691 | 0.04 |
| Fair Isaac Corp. | 米ドル | 264 | 148,068 | 0.22 |
| Fidelity National Financial, Inc. | 米ドル | 1,358 | 47,869 | 0.07 |
| First Citizens BancShares, Inc. 'A' | 米ドル | 17 | 12,080 | 0.02 |
| FMC Corp. | 米ドル | 251 | 29,351 | 0.04 |
| Ford Motor Co. | 米ドル | 5,514 | 60,087 | 0.09 |
| Fortinet, Inc. | 米ドル | 3,988 | 182,688 | 0.27 |
| Fortive Corp. | 米ドル | 482 | 29,017 | 0.04 |
| Gartner, Inc. | 米ドル | 418 | 131,653 | 0.19 |
| Gen Digital, Inc. | 米ドル | 853 | 17,128 | 0.03 |
| General Mills, Inc. | 米ドル | 2,494 | 195,945 | 0.29 |
| General Motors Co. | 米ドル | 1,964 | 61,906 | 0.09 |
| Genuine Parts Co. | 米ドル | 1,002 | 162,902 | 0.24 |
| Gilead Sciences, Inc. | 米ドル | 3,390 | 272,693 | 0.40 |
| Global Payments, Inc. | 米ドル | 446 | 41,505 | 0.06 |
| GoDaddy, Inc. 'A' | 米ドル | 226 | 15,844 | 0.02 |
| Goldman Sachs Group, Inc. (The) | 米ドル | 847 | 272,516 | 0.40 |
| H&R Block, Inc. | 米ドル | 2,079 | 71,121 | 0.10 |
| Halliburton Co. | 米ドル | 1,401 | 51,656 | 0.08 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. (The) | 米ドル | 2,362 | 167,824 | 0.25 |
| Hershey Co. (The) | 米ドル | 208 | 45,131 | 0.07 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 米ドル | 8,397 | 125,571 | 0.19 |
| HF Sinclair Corp. | 米ドル | 267 | 12,982 | 0.02 |
| Hilton Worldwide Holdings, Inc. | 米ドル | 395 | 46,767 | 0.07 |
| Hologic, Inc. | 米ドル | 2,156 | 151,127 | 0.22 |
| Home Depot, Inc. (The) | 米ドル | 965 | 285,598 | 0.42 |
| Host Hotels & Resorts, Inc., REIT | 米ドル | 5,865 | 88,202 | 0.13 |
| HP, Inc. | 米ドル | 2,399 | 60,399 | 0.09 |
| Hubbell, Inc. | 米ドル | 74 | 16,272 | 0.02 |
| HubSpot, Inc. | 米ドル | 63 | 17,067 | 0.03 |
| Humana, Inc. | 米ドル | 460 | 220,761 | 0.33 |
| IDEX Corp. | 米ドル | 703 | 150,401 | 0.22 |
| Incyte Corp. | 米ドル | 1,527 | 114,920 | 0.17 |
| Intel Corp. | 米ドル | 2,931 | 72,585 | 0.11 |
| International Business Machines Corp. | 米ドル | 1,361 | 179,669 | 0.27 |
| International Flavors & Fragrances, Inc. | 米ドル | 362 | 35,561 | 0.05 |
| IQVIA Holdings, Inc. | 米ドル | 257 | 49,339 | 0.07 |
| Iron Mountain, Inc., REIT | 米ドル | 544 | 25,410 | 0.04 |
| J M Smucker Co. (The) | 米ドル | 164 | 24,350 | 0.04 |
| Jefferies Financial Group, Inc. | 米ドル | 2,739 | 87,977 | 0.13 |
| Johnson & Johnson | 米ドル | 2,600 | 430,349 | 0.64 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|--|-----|--------|----------------|------------|
| Jones Lang LaSalle, Inc. | 米ドル | 294 | 43,902 | 0.06 |
| JPMorgan Chase & Co. | 米ドル | 2,637 | 331,339 | 0.49 |
| Juniper Networks, Inc. | 米ドル | 1,182 | 35,396 | 0.05 |
| Kellogg Co. | 米ドル | 1,329 | 88,712 | 0.13 |
| Keurig Dr Pepper, Inc. | 米ドル | 1,951 | 65,189 | 0.10 |
| Keysight Technologies, Inc. | 米ドル | 1,077 | 172,633 | 0.25 |
| Kimberly-Clark Corp. | 米ドル | 1,497 | 190,413 | 0.28 |
| KLA Corp. | 米ドル | 209 | 73,834 | 0.11 |
| Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. | 米ドル | 530 | 26,027 | 0.04 |
| Kraft Heinz Co. (The) | 米ドル | 4,550 | 173,559 | 0.26 |
| Kroger Co. (The) | 米ドル | 4,172 | 174,268 | 0.26 |
| Kyndryl Holdings, Inc. | 米ドル | 1 | 10 | - |
| L3Harris Technologies, Inc. | 米ドル | 309 | 60,283 | 0.09 |
| Laboratory Corp. of America Holdings | 米ドル | 476 | 105,026 | 0.16 |
| Lam Research Corp. | 米ドル | 185 | 72,856 | 0.11 |
| Las Vegas Sands Corp. | 米ドル | 483 | 21,755 | 0.03 |
| Leidos Holdings, Inc. | 米ドル | 257 | 25,330 | 0.04 |
| Lennar Corp. 'A' | 米ドル | 351 | 29,764 | 0.04 |
| Liberty Broadband Corp. 'C' | 米ドル | 144 | 10,291 | 0.02 |
| Live Nation Entertainment, Inc. | 米ドル | 1,800 | 117,622 | 0.17 |
| LKQ Corp. | 米ドル | 642 | 32,129 | 0.05 |
| Lockheed Martin Corp. | 米ドル | 337 | 153,616 | 0.23 |
| Loews Corp. | 米ドル | 419 | 22,900 | 0.03 |
| Lowe's Cos., Inc. | 米ドル | 963 | 179,778 | 0.27 |
| LPL Financial Holdings, Inc. | 米ドル | 645 | 130,644 | 0.19 |
| Lululemon Athletica, Inc. | 米ドル | 425 | 127,582 | 0.19 |
| Lumen Technologies, Inc. | 米ドル | 2,395 | 11,714 | 0.02 |
| ManpowerGroup, Inc. | 米ドル | 1,297 | 101,123 | 0.15 |
| Marathon Oil Corp. | 米ドル | 4,215 | 106,910 | 0.16 |
| Marathon Petroleum Corp. | 米ドル | 1,874 | 204,371 | 0.30 |
| Marriott International, Inc. 'A' | 米ドル | 395 | 55,106 | 0.08 |
| Mastercard, Inc. 'A' | 米ドル | 626 | 203,963 | 0.30 |
| Match Group, Inc. | 米ドル | 391 | 15,200 | 0.02 |
| McDonald's Corp. | 米ドル | 293 | 72,349 | 0.11 |
| McKesson Corp. | 米ドル | 541 | 190,152 | 0.28 |
| Medical Properties Trust, Inc., REIT | 米ドル | 12,334 | 128,743 | 0.19 |
| MercadoLibre, Inc. | 米ドル | 67 | 53,125 | 0.08 |
| Merck & Co., Inc. | 米ドル | 3,388 | 352,212 | 0.52 |
| Meta Platforms, Inc. 'A' | 米ドル | 3,558 | 401,190 | 0.59 |
| MetLife, Inc. | 米ドル | 2,777 | 188,308 | 0.28 |
| Mettler-Toledo International, Inc. | 米ドル | 39 | 52,820 | 0.08 |
| Microchip Technology, Inc. | 米ドル | 2,026 | 133,358 | 0.20 |
| Micron Technology, Inc. | 米ドル | 1,596 | 74,742 | 0.11 |
| Microsoft Corp. | 米ドル | 9,345 | 2,099,900 | 3.10 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|---|-----|-------|----------------|------------|
| Mid-America Apartment Communities, Inc., REIT | 米ドル | 256 | 37,657 | 0.06 |
| Moderna, Inc. | 米ドル | 785 | 132,117 | 0.19 |
| Molina Healthcare, Inc. | 米ドル | 267 | 82,613 | 0.12 |
| Molson Coors Beverage Co. 'B' | 米ドル | 715 | 34,516 | 0.05 |
| Morgan Stanley | 米ドル | 1,917 | 152,713 | 0.23 |
| Mosaic Co. (The) | 米ドル | 232 | 9,537 | 0.01 |
| Motorola Solutions, Inc. | 米ドル | 239 | 57,712 | 0.09 |
| MSCI, Inc. | 米ドル | 111 | 48,380 | 0.07 |
| Nasdaq, Inc. | 米ドル | 564 | 32,421 | 0.05 |
| Netflix, Inc. | 米ドル | 649 | 179,318 | 0.26 |
| Neurocrine Biosciences, Inc. | 米ドル | 262 | 29,321 | 0.04 |
| NextEra Energy, Inc. | 米ドル | 225 | 17,625 | 0.03 |
| NRG Energy, Inc. | 米ドル | 695 | 20,721 | 0.03 |
| Nucor Corp. | 米ドル | 1,017 | 125,604 | 0.19 |
| NVIDIA Corp. | 米ドル | 2,228 | 305,083 | 0.45 |
| ON Semiconductor Corp. | 米ドル | 1,075 | 62,823 | 0.09 |
| O'Reilly Automotive, Inc. | 米ドル | 94 | 74,340 | 0.11 |
| Ovintiv, Inc. | 米ドル | 351 | 16,678 | 0.02 |
| Owens Corning | 米ドル | 1,285 | 102,704 | 0.15 |
| PACCAR, Inc. | 米ドル | 1,921 | 178,141 | 0.26 |
| Palo Alto Networks, Inc. | 米ドル | 784 | 102,506 | 0.15 |
| Paychex, Inc. | 米ドル | 439 | 47,534 | 0.07 |
| Paycom Software, Inc. | 米ドル | 464 | 134,911 | 0.20 |
| Paylocity Holding Corp. | 米ドル | 57 | 10,375 | 0.02 |
| PayPal Holdings, Inc. | 米ドル | 1,627 | 108,573 | 0.16 |
| PepsiCo, Inc. | 米ドル | 2,735 | 462,970 | 0.68 |
| Pfizer, Inc. | 米ドル | 9,593 | 460,572 | 0.68 |
| Phillips 66 | 米ドル | 1,061 | 103,471 | 0.15 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 米ドル | 1,876 | 133,662 | 0.20 |
| Pinterest, Inc. 'A' | 米ドル | 1,391 | 31,645 | 0.05 |
| PNC Financial Services Group, Inc. (The) | 米ドル | 657 | 97,228 | 0.14 |
| PPL Corp. | 米ドル | 1,118 | 30,609 | 0.05 |
| Principal Financial Group, Inc. | 米ドル | 1,845 | 145,076 | 0.21 |
| Procter & Gamble Co. (The) | 米ドル | 2,052 | 291,404 | 0.43 |
| Prudential Financial, Inc. | 米ドル | 586 | 54,611 | 0.08 |
| Public Storage, REIT | 米ドル | 650 | 170,647 | 0.25 |
| Qorvo, Inc. | 米ドル | 153 | 12,994 | 0.02 |
| QUALCOMM, Inc. | 米ドル | 2,199 | 226,524 | 0.33 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 米ドル | 808 | 118,439 | 0.17 |
| Raymond James Financial, Inc. | 米ドル | 276 | 27,632 | 0.04 |
| Raytheon Technologies Corp. | 米ドル | 2,096 | 198,199 | 0.29 |
| Regency Centers Corp., REIT | 米ドル | 314 | 18,388 | 0.03 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. | 米ドル | 358 | 242,018 | 0.36 |
| Regions Financial Corp. | 米ドル | 3,857 | 77,917 | 0.11 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|-------------------------------------|-----|-------|----------------|------------|
| Rivian Automotive, Inc. 'A' | 米ドル | 236 | 4,075 | 0.01 |
| Robert Half International, Inc. | 米ドル | 155 | 10,723 | 0.02 |
| Rollins, Inc. | 米ドル | 318 | 10,888 | 0.02 |
| Roper Technologies, Inc. | 米ドル | 154 | 62,349 | 0.09 |
| RPM International, Inc. | 米ドル | 184 | 16,801 | 0.02 |
| S&P Global, Inc. | 米ドル | 480 | 150,641 | 0.22 |
| Salesforce, Inc. | 米ドル | 2,571 | 319,409 | 0.47 |
| SBA Communications Corp., REIT 'A' | 米ドル | 163 | 42,811 | 0.06 |
| Seagen, Inc. | 米ドル | 811 | 97,654 | 0.14 |
| Sealed Air Corp. | 米ドル | 1,822 | 85,155 | 0.13 |
| Sempra Energy | 米ドル | 435 | 62,989 | 0.09 |
| ServiceNow, Inc. | 米ドル | 259 | 94,225 | 0.14 |
| Simon Property Group, Inc., REIT | 米ドル | 464 | 51,076 | 0.08 |
| Snap, Inc. 'A' | 米ドル | 7,709 | 64,648 | 0.10 |
| Snap-on, Inc. | 米ドル | 103 | 22,052 | 0.03 |
| Southwest Airlines Co. | 米ドル | 1,252 | 39,499 | 0.06 |
| Splunk, Inc. | 米ドル | 1,891 | 152,538 | 0.23 |
| Starbucks Corp. | 米ドル | 1,729 | 160,709 | 0.24 |
| State Street Corp. | 米ドル | 522 | 37,940 | 0.06 |
| Steel Dynamics, Inc. | 米ドル | 1,710 | 156,540 | 0.23 |
| Synchrony Financial | 米ドル | 3,243 | 99,850 | 0.15 |
| Synopsys, Inc. | 米ドル | 642 | 192,068 | 0.28 |
| Take-Two Interactive Software, Inc. | 米ドル | 260 | 25,368 | 0.04 |
| Teladoc Health, Inc. | 米ドル | 2,776 | 61,515 | 0.09 |
| Tesla, Inc. | 米ドル | 2,815 | 324,902 | 0.48 |
| Textron, Inc. | 米ドル | 1,907 | 126,508 | 0.19 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | 米ドル | 341 | 175,952 | 0.26 |
| T-Mobile US, Inc. | 米ドル | 1,304 | 171,056 | 0.25 |
| Trade Desk, Inc. (The) 'A' | 米ドル | 1,409 | 59,185 | 0.09 |
| TransDigm Group, Inc. | 米ドル | 69 | 40,708 | 0.06 |
| Travelers Cos., Inc. (The) | 米ドル | 369 | 64,824 | 0.10 |
| Truist Financial Corp. | 米ドル | 1,895 | 76,404 | 0.11 |
| Uber Technologies, Inc. | 米ドル | 1,836 | 42,543 | 0.06 |
| Ulta Beauty, Inc. | 米ドル | 388 | 170,531 | 0.25 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 米ドル | 1,027 | 167,284 | 0.25 |
| United Rentals, Inc. | 米ドル | 516 | 171,840 | 0.25 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 米ドル | 1,285 | 638,352 | 0.94 |
| Vail Resorts, Inc. | 米ドル | 101 | 22,556 | 0.03 |
| Valero Energy Corp. | 米ドル | 1,586 | 188,522 | 0.28 |
| Veeva Systems, Inc. 'A' | 米ドル | 1,043 | 157,713 | 0.23 |
| Ventas, Inc., REIT | 米ドル | 594 | 25,074 | 0.04 |
| VeriSign, Inc. | 米ドル | 149 | 28,682 | 0.04 |
| Verisk Analytics, Inc. | 米ドル | 213 | 35,210 | 0.05 |
| Verizon Communications, Inc. | 米ドル | 750 | 27,688 | 0.04 |

| | 通貨 | 株数 | 時価評価額 (ユーロ) | 構成比 (%) |
|---|-----|-------|--------------------------|----------------------|
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. | 米ドル | 854 | 231,078 | 0.34 |
| Viatis, Inc. | 米ドル | 1,730 | 18,042 | 0.03 |
| VICI Properties, Inc., REIT | 米ドル | 1,354 | 41,105 | 0.06 |
| Visa, Inc. 'A' | 米ドル | 1,328 | 258,520 | 0.38 |
| VMware, Inc. 'A' | 米ドル | 295 | 33,932 | 0.05 |
| W R Berkley Corp. | 米ドル | 439 | 29,851 | 0.04 |
| Walmart, Inc. | 米ドル | 672 | 89,279 | 0.13 |
| Walt Disney Co. (The) | 米ドル | 676 | 55,030 | 0.08 |
| Warner Bros Discovery, Inc. | 米ドル | 3,340 | 29,668 | 0.04 |
| Webster Financial Corp. | 米ドル | 250 | 11,089 | 0.02 |
| WEC Energy Group, Inc. | 米ドル | 1,943 | 170,696 | 0.25 |
| Wells Fargo & Co. | 米ドル | 264 | 10,214 | 0.02 |
| Western Union Co. (The) | 米ドル | 836 | 10,786 | 0.02 |
| Westinghouse Air Brake Technologies Corp. | 米ドル | 292 | 27,308 | 0.04 |
| Westrock Co. | 米ドル | 351 | 11,564 | 0.02 |
| Weyerhaeuser Co., REIT | 米ドル | 4,119 | 119,643 | 0.18 |
| Williams Cos., Inc. (The) | 米ドル | 1,978 | 60,976 | 0.09 |
| Workday, Inc. 'A' | 米ドル | 1,130 | 177,168 | 0.26 |
| WP Carey, Inc., REIT | 米ドル | 262 | 19,185 | 0.03 |
| WW Grainger, Inc. | 米ドル | 290 | 151,148 | 0.22 |
| Xcel Energy, Inc. | 米ドル | 776 | 50,977 | 0.08 |
| Xylem, Inc. | 米ドル | 1,533 | 158,823 | 0.23 |
| Yum! Brands, Inc. | 米ドル | 472 | 56,644 | 0.08 |
| Zillow Group, Inc. 'C' | 米ドル | 1,752 | 52,876 | 0.08 |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc. | 米ドル | 301 | 35,959 | 0.05 |
| Zoom Video Communications, Inc. 'A' | 米ドル | 562 | 35,671 | 0.05 |
| Zscaler, Inc. | 米ドル | 133 | 13,945 | 0.02 |
| | | | <u>43,973,692</u> | <u>64.89</u> |
| 株式合計 | | | <u>67,616,002</u> | <u>99.77</u> |
| 公的な取引所への上場が認められた有価証券ならびに短期金融商品の合計 | | | <u>67,616,002</u> | <u>99.77</u> |
| 保有有価証券 | | | <u>67,616,002</u> | <u>99.77</u> |
| 現金 | | | <u>99,900</u> | <u>0.15</u> |
| その他資産／(負債) | | | <u>54,836</u> | <u>0.08</u> |
| 純資産総額 | | | <u>67,770,738</u> | <u>100.00</u> |

2022年12月31日までの1年間

ユーロ

| | |
|----------------------------------|---------------------|
| 当期初における純資産総額 | 75,978,666 |
| 収入 | |
| 配当収入（源泉税徴収後） | 1,279,892 |
| 有価証券貸付収入 | 1,661 |
| 銀行金利 | 2,736 |
| 収入合計 | 1,284,289 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 176,055 |
| サービス報酬 | 84,345 |
| 税金等 | 7,013 |
| 銀行その他支払金利 | 4763 |
| 費用合計 | 272,176 |
| 純投資収益／（損失） | 1,012,113 |
| 純実現利益／（損失）： | |
| 保有有価証券の売却 | 4,515,822 |
| 金融先物契約 為替先渡契約 | (74,445) |
| 為替取引 | (3,417) |
| 為替取引 | 48,233 |
| 当期に係る実現利益（損失） | 4,486,193 |
| 未実現利益（損失）の変動： | |
| 保有有価証券 | (13,993,264) |
| 金融先物契約 | (2,715) |
| 為替取引 | (576) |
| 未実現利益（損失） | (13,996,555) |
| ファンド運営に係る結果としての純資産の増加（減少） | (8,498,249) |
| 取得 | 5,474,952 |
| 換金 | (5,184,631) |
| 資本勘定の変動に係る純資産総額の増減 | 290,321 |
| 当期末における純資産総額 | 67,770,738 |

Shinseiショートターム・マザー・ファンド

運用報告書

第5期

決算日 2023年4月20日

(計算期間：2022年4月21日から2023年4月20日まで)

当マザーファンドの仕組みは次のとおりです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 安定運用と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 本邦通貨表示の短期有価証券等を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | <p>①株式への直接投資は行いません。株式への投資は転換社債を転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り）を行使したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>②外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>③有価証券先物取引等は、価格変動リスクを回避するために行うことができます。</p> <p>④スワップ取引は、価格変動リスクを回避するために行うことができます。</p> <p>⑤金利先渡取引は、価格変動リスクを回避するために行うことができます。</p> <p>⑥同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑧デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>⑨一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> |

 **SBI Asset Management**

SBIアセットマネジメント株式会社

東京都港区六本木 1-6-1

○設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | 騰 落 中 率 | 債 組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|----------------|---------|---------|-----------|-----------|
| | | | | |
| (設定日) | 円 | % | % | 百万円 |
| 2018年7月27日 | 10,000 | — | — | 0.34 |
| 1期(2019年4月22日) | 9,988 | △0.1 | 73.6 | 0.33958 |
| 2期(2020年4月20日) | 9,977 | △0.1 | 73.7 | 0.339232 |
| 3期(2021年4月20日) | 9,969 | △0.1 | 59.0 | 0.338949 |
| 4期(2022年4月20日) | 9,962 | △0.1 | 59.1 | 0.338711 |
| 5期(2023年4月20日) | 9,953 | △0.1 | 59.1 | 0.338399 |

(注) 設定日の基準価額は、当初設定価額を表示しています。

(注) 設定日の純資産総額は、当初設定元本を表示しています。

(注) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注) 組入比率は純資産総額に対する組入比率です。

(注) 騰落率、組入比率は小数点第2位を四捨五入して表示しています。

(注) 当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 券 率 |
|------------|---------|-------|-----------|------|
| | | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % |
| 2022年4月20日 | 9,962 | — | 59.1 | 59.1 |
| 4月末 | 9,962 | 0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 5月末 | 9,961 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 6月末 | 9,962 | 0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 7月末 | 9,961 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 8月末 | 9,960 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 9月末 | 9,960 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 10月末 | 9,959 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 11月末 | 9,958 | △0.0 | 59.1 | 59.1 |
| 12月末 | 9,957 | △0.1 | 59.1 | 59.1 |
| 2023年1月末 | 9,956 | △0.1 | 59.1 | 59.1 |
| 2月末 | 9,955 | △0.1 | 59.1 | 59.1 |
| 3月末 | 9,953 | △0.1 | 59.1 | 59.1 |
| (期 末) | | | | |
| 2023年4月20日 | 9,953 | △0.1 | 59.1 | 59.1 |

(注) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注) 騰落率は期首比で表示しています。

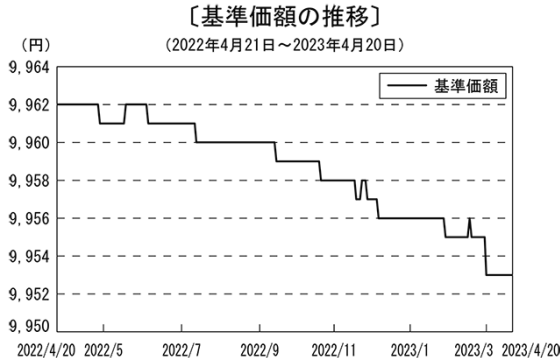
(注) 組入比率は純資産総額に対する組入比率です。

(注) 騰落率、組入比率は小数点第2位を四捨五入して表示しています。

(注) 当ファンドは、特定のベンチマーク（運用成果の目標基準）や参考指数を設けておりません。

○当期の運用経過

(2022年4月21日～2023年4月20日)



Shinseiショートターム・マザー・ファンドの基準価額は、当期首の9,962円から当期末には9,953円となりました。

【投資環境】

＜日本短期金融市場＞

国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、断続的な日銀（日本銀行）の買入オペの影響等から、期を通じて0%を下回る水準で推移し、日銀による長短金利操作付き量的・質的金融緩和の影響もあり、期末時点においては-0.1647%程度の水準となりました。

【当ファンドのポートフォリオ】

Shinseiショートターム・マザー・ファンドでは、主として国庫短期証券等を組み入れました。国庫短期証券等の利回りがマイナスとなっている状況から、当期の基準価額は小幅に下落しました。

【今後の運用方針】

世界的なインフレ圧力の高まりから主要国／地域の中央銀行による利上げが相次いでいます。日銀は、物価上昇率（前年比）2%の「物価安定の目標」の実現をめざし、金融緩和を継続していましたが、2022年12月の金融政策決定会合で、長期金利の許容変動幅を拡大するなど今後の正常化への布石とも取れる修正を行ったため、市場では日銀の金融政策の先行きに関する思惑も広がり、金利の変動が大きくなる局面も予想されま。このような環境の中、Shinseiショートターム・マザー・ファンドでは、引き続き当初の運用方針に基づき、国庫短期証券等に投資していく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年4月21日～2023年4月20日)

当期中に発生した費用はありません。

○売買及び取引の状況

(2022年4月21日～2023年4月20日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|-----------|------------------|
| 国内 | 国債証券 | 千円 800 | 千円 — (800) |

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨てて表示しています。

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年4月21日～2023年4月20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

(2023年4月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|------|--------------------|--------------------|---------------------|-----------------|---------------|---------------|---------------------|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 千円 200 (200) | 千円 200 (200) | % 59.1 (59.1) | % — (—) | % — (—) | % — (—) | % 59.1 (59.1) |
| 合 計 | 200 (200) | 200 (200) | 59.1 (59.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 59.1 (59.1) |

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 単位未満は切捨てて表示しています。

(注) 一印は組入なしです。

(注) 評価については価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建) 公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------|---|-------|---------|-------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 第1146回国庫短期証券 | | — | 200 | 200 | 2023/6/26 |
| 合 計 | | | 200 | 200 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てて表示しています。

○投資信託財産の構成

(2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 200 | 59.1 |
| コール・ローン等、その他 | 138 | 40.9 |
| 投資信託財産総額 | 338 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨てて表示しています。

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合で、小数点第2位を四捨五入して表示しています。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 338,399 |
| コール・ローン等 | 138,334 |
| 公社債(評価額) | 200,065 |
| (B) 負債 | 0 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 338,399 |
| 元本 | 340,000 |
| 次期繰越損益金 | △ 1,601 |
| (D) 受益権総口数 | 340,000口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,953円 |

〈注記事項〉

| | |
|--|----------|
| 期首元本額 | 340,000円 |
| 期中追加設定元本額 | 0円 |
| 期中一部解約元本額 | 0円 |
| 1口当たり純資産額 | 0.9953円 |
| 期末における元本の内訳 | |
| オリックス 世界債券ファンド(グローバル・ダイミック・デュレーション)(為替ヘッジあり) | 140,000円 |
| オリックス 世界社債アクティブファンド(為替ヘッジあり) | 110,000円 |
| オリックス 先進国株式マーケット・プラス・ファンド | 90,000円 |

○損益の状況

(2022年4月21日～2023年4月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|--------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 2 |
| 支払利息 | △ 2 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 310 |
| 売買損 | △ 310 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 312 |
| (D) 前期繰越損益金 | △1,289 |
| (E) 計(C+D) | △1,601 |
| 次期繰越損益金(E) | △1,601 |

(注) 損益の状況の中で(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。

○お知らせ

新生インベストメント・マネジメント株式会社は、2023年4月1日にSBIアセットマネジメント株式会社を存続会社として合併し、SBIアセットマネジメント株式会社となりました。