

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/海外/株式/インデックス型	
信託期間	信託期間は2022年3月29日から無期限です。	
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	My SMT S&P500インデックス(ノーロード)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	S&P500インデックスマザーファンド	米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	My SMT S&P500インデックス(ノーロード)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	S&P500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割合には制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

My SMT S&P500 インデックス(ノーロード)

運用報告書(全体版)

第2期(決算日 2024年3月26日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	投資信託証券組入率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
設定日(2022年3月29日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期(2023年3月27日)	9,256	0	△7.4	9,285	△7.1	90.3	5.5	2.2	4,778
第2期(2024年3月26日)	14,231	0	53.7	14,357	54.6	90.6	8.8	1.9	28,687

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	投資信託証券組入率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(当期首)	円	%		%	%	%	%
2023年 3月27日	9,256	—	9,285	—	90.3	5.5	2.2
3月末	9,647	4.2	9,682	4.3	89.8	7.9	2.2
4月末	9,897	6.9	9,938	7.0	94.8	2.9	2.3
5月末	10,501	13.5	10,550	13.6	92.1	6.3	2.1
6月末	11,395	23.1	11,457	23.4	88.7	8.8	2.1
7月末	11,550	24.8	11,621	25.2	94.8	3.2	2.2
8月末	11,820	27.7	11,895	28.1	86.3	11.5	2.0
9月末	11,530	24.6	11,605	25.0	89.2	9.0	2.0
10月末	11,177	20.8	11,251	21.2	89.7	8.7	1.9
11月末	12,022	29.9	12,108	30.4	84.6	13.3	1.9
12月末	12,199	31.8	12,291	32.4	89.6	8.3	2.1
2024年 1月末	13,071	41.2	13,177	41.9	88.5	10.3	1.9
2月末	13,755	48.6	13,871	49.4	93.1	5.5	2.0
(当期末)							
2024年 3月26日	14,231	53.7	14,357	54.6	90.6	8.8	1.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、S&P500（配当込み、円換算ベース）です。

S&P500[®]は、S&P Dow Jones Indices LLCが公表している米国の代表的な株価指数で、米国の主要産業を代表する約500銘柄を時価総額で加重平均して算出されます。

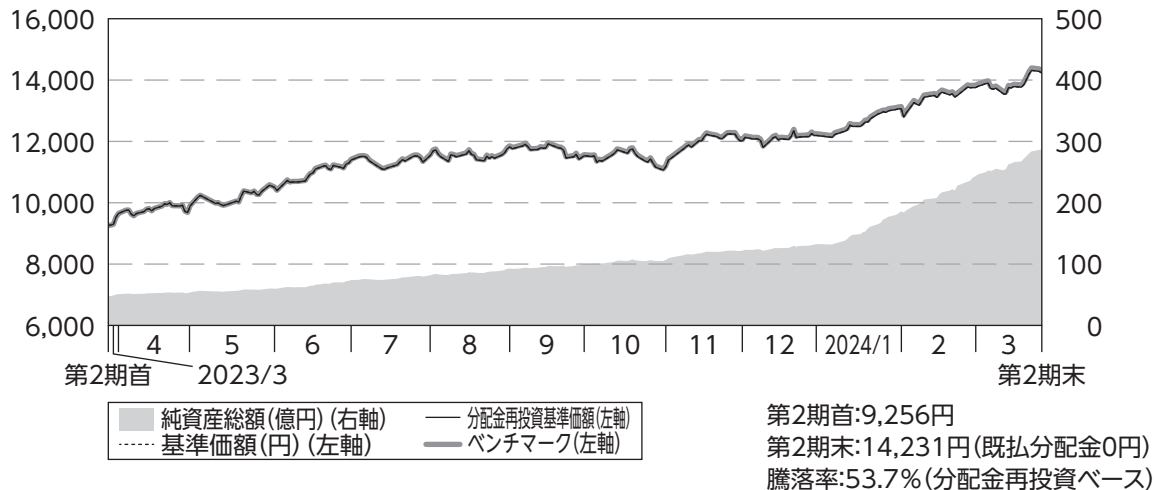
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

S&P500[®]（以下「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC又はその関連会社（以下「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、又は中断に対しても一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。

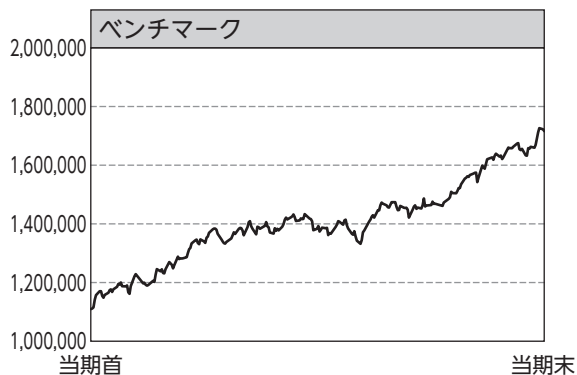
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2023年3月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



米国株式市場は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことでFRB(米連邦準備理事会)による利上げの休止が期待されたことや、米国景気の軟着陸期待の高まりなどから2023年7月にかけて上昇しましたが、その後は大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRBが政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、労働需給の軟化、インフレ鈍化を示す指標を受けて長期金利が低下したことや、FRBによる早期の利下げ転換への期待が高まったことなどから上昇しました。外国為替市場では、日本と米国との金融政策姿勢の違いが意識され、米ドルに対して円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

【S&P500インデックスマザーファンド】受益証券を高位に組み入れ運用しました。

【S&P500インデックスマザーファンド】の運用経過

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

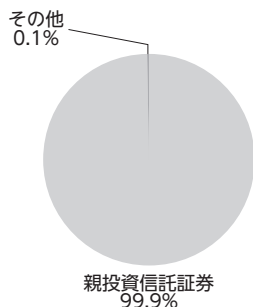
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

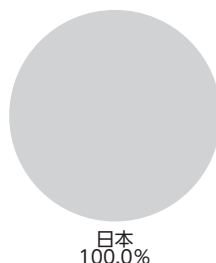
	当期末
	2024年3月26日
S&P500インデックスマザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

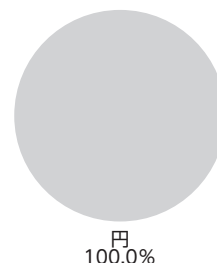
○資産別配分



○国別配分



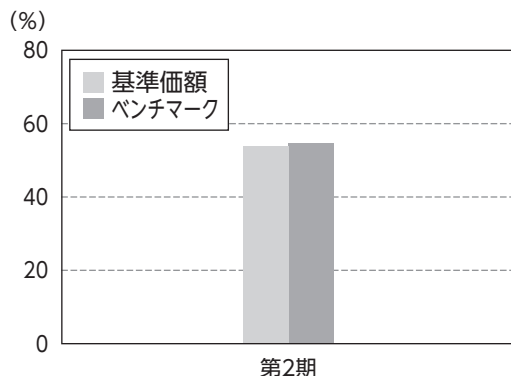
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因^(※)、取引コスト要因および信託報酬要因(いずれもマイナス要因)です。

※ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第2期	
	2023年3月28日～2024年3月26日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	4,230	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)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3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

S&P500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、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P500(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてS&P500への連動を目指す上場投資信託証券に実質投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年3月28日～2024年3月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	11円	0.097%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は11,547円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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
(投信会社)	(4)	(0.037)	
(販売会社)	(4)	(0.037)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	6	0.052	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0.024)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(3)	(0.027)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	9	0.079	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(8)	(0.073)	
(監査費用)	(1)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	26	0.228	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み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。

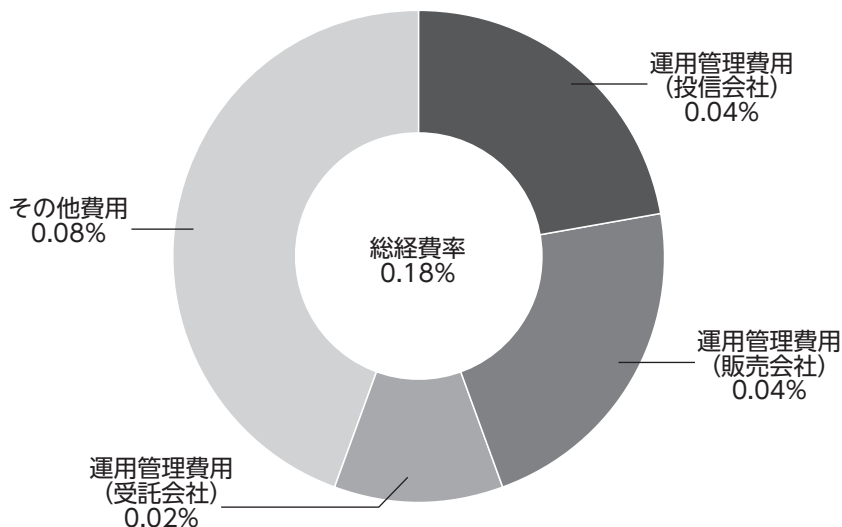
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

<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、売買委託手数料及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0.18%です。



(注1)各費用は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2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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)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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
S&P500インデックスマザーファンド	千口 9,638,794	千円 19,069,458	千口 156,874	千円 260,803

株式売買比率

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<S&P500インデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	22,784,962千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	13,359,419千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.70

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.125956	百万円 0.125956	% 100.0	百万円 0.125956	百万円 0.125956	% 100.0
コールド・ローン	8,991	602	6.7	8,872	582	6.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<S&P500インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 21,070	百万円 21,070	% 100.0	百万円 18,713	百万円 18,713	% 100.0
為替直物取引	23,535	23,535	100.0	650	650	100.0
金 銭 信 託	12	12	100.0	12	12	100.0
コールド・ローン	185,274	2,201	1.2	183,456	1,893	1.0

<平均保有割合 73.2%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
S&P500インデックスマザーファンド	千口 3,270,299	千口 12,752,219	千円 28,673,365

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、17,187,842千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド	千円 28,673,365	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	122,672	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	28,796,037	100.0

(注1)S&P500インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(36,765,523千円)の投資信託財産総額(38,651,096千円)に対する比率は95.1%です。

(注2)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の仲値により邦貨換算したものです。
1米ドル=151.33円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2024年3月26日現在
(A) 資 産	28,796,037,883円
コール・ローン等	122,672,021
S&P500インデックス マザーファンド(評価額)	28,673,365,646
未 収 利 息	216
(B) 負 債	108,274,580
未 払 解 約 金	100,276,609
未 払 信 託 報 酬	7,568,024
そ の 他 未 払 費 用	429,947
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,687,763,303
元 本	20,158,915,641
次 期 繰 越 損 益 金	8,528,847,662
(D) 受 益 権 総 口 数	20,158,915,641口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,231円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月28日 至 2024年3月26日
(A) 配 当 等 収 益	△9,959円
受 取 利 息	1,198
支 払 利 息	△11,157
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,610,102,566
売 買 損 益	5,086,749,474
売 買 損 益	△476,646,908
(C) 信 託 報 酬 等	△11,655,895
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	4,598,436,712
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△123,467,333
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,053,878,283
(配 当 等 相 当 額)	(145,180,852)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,908,697,431)
(G) 計 算 (D+E+F)	8,528,847,662
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	8,528,847,662
追 加 信 託 差 損 益 金	4,053,878,283
(配 当 等 相 当 額)	(167,400,130)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,886,478,153)
分 配 準 備 積 立 金	4,474,969,379

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は5,163,372,652円、期中追加設定元本額は18,197,206,732円、期中一部解約元本額は3,201,663,743円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	170,318,562円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	4,281,418,611円
(C) 収益調整金額	4,053,878,283円
(D) 分配準備積立金額	23,232,206円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	8,528,847,662円
(F) 期末残存口数	20,158,915,641口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	4,230円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

お知らせ

該当事項はありません。

S&P500インデックスマザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2024年3月11日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2020年8月25日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
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。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
設定日(2020年8月25日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 499
第1期(2021年3月10日)	11,547	15.5	11,576	15.8	—	—	99.6	576
第2期(2022年3月10日)	13,773	19.3	13,847	19.6	—	—	99.7	787
第3期(2023年3月10日)	14,992	8.9	15,125	9.2	92.0	6.0	2.4	6,724
第4期(2024年3月11日)	21,412	42.8	21,692	43.4	87.7	11.2	1.9	33,879

(注) 株式先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2023年 3月10日	14,992	—	15,125	—	92.0	6.0	2.4
3月末	15,225	1.6	15,366	1.6	89.8	7.9	2.2
4月末	15,620	4.2	15,771	4.3	94.9	2.9	2.3
5月末	16,576	10.6	16,742	10.7	92.1	6.3	2.1
6月末	17,989	20.0	18,182	20.2	88.8	8.9	2.1
7月末	18,236	21.6	18,443	21.9	94.9	3.2	2.2
8月末	18,664	24.5	18,876	24.8	86.4	11.5	2.0
9月末	18,206	21.4	18,416	21.8	89.3	9.0	2.0
10月末	17,650	17.7	17,855	18.1	89.7	8.7	1.9
11月末	18,987	26.6	19,215	27.0	84.6	13.3	1.9
12月末	19,268	28.5	19,506	29.0	89.7	8.3	2.1
2024年 1月末	20,649	37.7	20,912	38.3	88.5	10.3	1.9
2月末	21,731	45.0	22,013	45.5	93.1	5.5	2.0
(当期末) 2024年 3月11日	21,412	42.8	21,692	43.4	87.7	11.2	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、S&P500（配当込み、円換算ベース）です。

S&P500[®]は、S&P Dow Jones Indices LLCが公表している米国の代表的な株価指数で、米国の主要産業を代表する約500銘柄を時価総額で加重平均して算出されます。

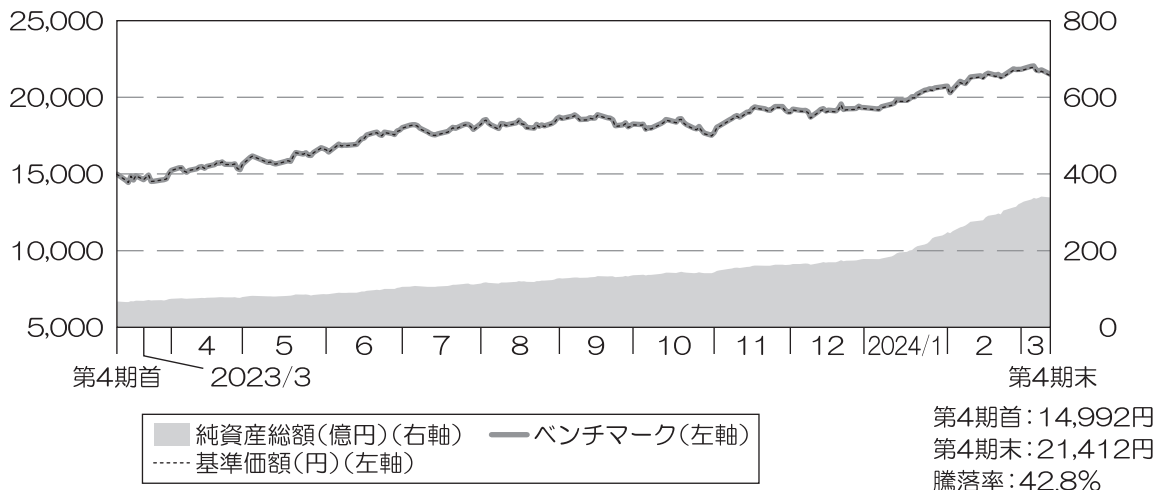
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

S&P500[®]（以下「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC又はその関連会社（以下「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、又は中断に対しても一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

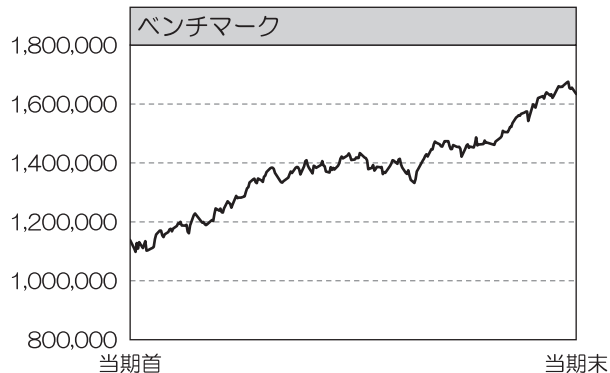


(注)ベンチマークは、2023年3月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



米国株式市場は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことでFRB(米連邦準備理事会)による利上げの休止が期待されたことや、米国景気の軟着陸期待の高まりなどから2023年7月にかけて上昇しましたが、その後は大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRBが政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、労働需給の軟化、インフレ鈍化を示す指標を受けて長期金利が低下したことや、FRBによる早期の利下げ転換への期待が高まったことなどから上昇しました。

外国為替市場では、日本と米国との金融政策姿勢の違いが意識され、米ドルに対して円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

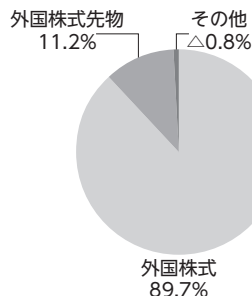
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	SP500 MIC EM 2403	アメリカ	11.2%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	6.3%
3	APPLE INC	アメリカ	5.2%
4	NVIDIA CORP	アメリカ	4.5%
5	AMAZON.COM	アメリカ	3.3%
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	2.3%

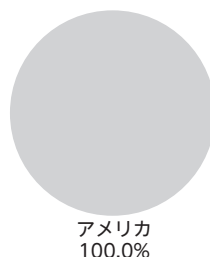
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.7%
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	1.5%
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
10	ELI LILLY & CO	アメリカ	1.3%
組入銘柄数			504

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

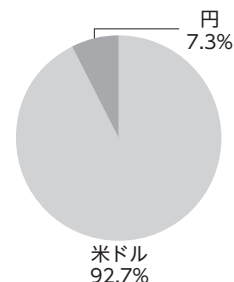
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

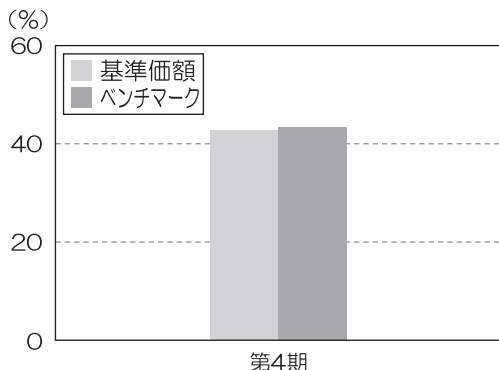


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して11.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因^(※)および取引コスト要因(いずれもマイナス要因)です。

※ ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

今後の運用方針

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P500(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてS&P500への連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年3月11日～2024年3月11日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	8円	0.043%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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)	(4)	(0.020)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(4)	(0.022)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	11	0.062	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(11)	(0.062)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	19	0.105	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(18,233円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 10,489 (170)	千米ドル 132,012 (22)	百株 65 (1)	千米ドル 349 (28)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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。

<投資信託受益証券、投資証券>

			当 期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
	ア メ リ カ		千口 千米ドル		千口 千米ドル	
外	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.451	53	—	—	
	BOSTON PROPERTIES	0.283	18	—	—	
	PROLOGIS INC	3	406	—	—	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.482	84	—	—	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.232	23	—	—	
	CROWN CASTLE INC	1	159	—	—	
	ESSEX PROPERTY TRUST	0.253	57	—	—	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	0.944	57	—	—	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.223	22	—	—	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3	54	—	—	
	WELLTOWER INC	2	178	—	—	
	KIMCO REALTY CORP	2	53	—	—	
	IRON MOUNTAIN INC	0.696	45	—	—	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1	33	—	—	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.337	45	—	—	
	REALTY INCOME CORP	3	181	—	—	
	REGENCY CENTERS CORP	0.79	47	—	—	
	UDR INC	0.577	21	—	—	
	SIMON PROPERTY GROUP	1	154	—	—	
	PUBLIC STORAGE	0.574	162	—	—	
国	VENTAS INC	1	73	—	—	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.767	109	—	—	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1	152	—	—	
	AMERICAN TOWER CORPORATION	1	317	—	—	
	INVITATION HOMES INC	1	53	—	—	
	EQUINIX INC	0.336	270	—	—	
	VICI PROPERTIES INC	3	106	—	—	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.368	83	—	—	
	小 計	35	3,026	—	—	

(注) 金額は受渡代金です。

〈先物取引の種類別取引状況〉

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 株 式 先 物 取 引	百万円 25,821	百万円 22,893	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

〈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	19,454,847千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	13,359,419千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.45

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	18,276	18,276	100.0	15,484	15,484	100.0
為替直物取引	20,404	20,404	100.0	766	766	100.0
金銭信託	12	12	100.0	12	12	100.0
コール・ローン	168,967	1,526	0.9	166,486	1,532	0.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

〈外国株式〉

銘柄	当期首(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	
AMAZON.COM	126	438	7,683	1,128,115	一般消費財・サービス流通・小売り
ABBOTT LABORATORIES	24	83	1,009	148,272	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	12	23	38	5,649	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12	44	873	128,253	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	22	77	1,612	236,680	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	6	21	1,208	177,388	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	5	20	500	73,425	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	3	11	270	39,765	素材
ALASKA AIR GROUP INC	1	—	—	—	運輸
RALPH LAUREN CORPORATION	0.43	2	44	6,487	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	3	11	183	26,909	保険
HONEYWELL INTL INC	9	31	636	93,491	資本財
AMGEN	7	25	704	103,494	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	4	13	192	28,290	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	8	28	631	92,646	金融サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	7	26	224	32,976	公益事業
AFLAC	8	23	193	28,378	保険
AMERICAN INT'L GROUP	10	33	251	36,893	保険
ANALOG DEVICES	7	24	482	70,797	半導体・半導体製造装置
VALERO ENERGY CORP	5	17	257	37,782	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	61	196	834	122,562	メディア・娯楽
ANSYS INC	1	3	126	18,499	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	212	703	12,019	1,764,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	12	40	827	121,445	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	1	5	60	8,825	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	8	23	126	18,540	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	1	3	23	3,410	公益事業
AMEREN CORPORATION	3	11	84	12,348	公益事業
AUTODESK INC	3	10	266	39,122	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	5	20	491	72,103	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	0.28	0.85	261	38,431	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	1	3	85	12,606	素材
BALL CORP	4	13	86	12,716	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25	87	3,528	518,094	金融サービス
BANK NEW YORK CO	11	34	190	27,901	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL	7	24	108	15,937	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	4	14	346	50,931	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	2	11	213	31,380	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	59	205	811	119,091	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	3	9	84	12,379	保険
BEST BUY COMPANY INC	3	9	76	11,271	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.23	0.72	24	3,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	4	12	176	25,899	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	8	28	107	15,748	公益事業
BOEING CO	7	27	554	81,481	資本財
ROBERT HALF INC	1	3	29	4,335	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	4	13	43	6,336	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	20	72	488	71,772	ヘルスケア機器・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1	4	31	4,605	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	7	105	15,468	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.35	1	132	19,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	30	100	539	79,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	5	26	201	29,533	エネルギー
UNITED RENTALS INC	0.89	3	203	29,880	資本財
SEMPRA	4	31	227	33,369	公益事業
FEDEX CORP	3	11	288	42,291	運輸
VERISIGN INC	1	3	70	10,404	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	8	29	330	48,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1	7	40	5,992	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	2	6	160	23,633	資本財
CSX CORP	29	98	375	55,078	運輸
COTERRA ENERGY INC	11	30	81	11,900	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	2	10	46	6,792	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2	8	208	30,569	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	3	11	131	19,378	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	7	24	832	122,208	資本財
LUMEN TECHNOLOGIES INC	9	—	—	—	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	41	139	2,630	386,163	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	3	10	110	16,280	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	4	14	481	70,655	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2	6	77	11,399	保険
CINTAS CORP	1	4	268	39,389	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	58	194	964	141,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	1	5	84	12,455	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	55	189	1,125	165,319	食品・飲料・タバコ
COPART INC	5	38	213	31,324	商業・専門サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	11	39	348	51,217	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	3	11	297	43,617	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	0.94	2	112	16,486	ヘルスケア機器・サービス
COMERICA INC	1	5	29	4,355	銀行
NRG ENERGY INC	2	13	79	11,725	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	7	24	70	10,320	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	4	18	162	23,829	公益事業
CMS ENERGY CORP	4	13	81	11,970	公益事業
COOPER COS INC/THE	0.81	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	9	34	113	16,645	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	1	—	—	—	素材
CUMMINS INC	2	7	189	27,802	資本財
DR HORTON INC	4	14	222	32,695	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	9	32	814	119,636	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	2	7	294	43,297	金融サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6	24	185	27,186	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	6	22	376	55,343	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	3	12	482	70,798	資本財
MORGAN STANLEY	18	60	529	77,697	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	2	10	193	28,367	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	5	18	159	23,363	不動産管理・開発
THE WALT DISNEY CO	25	89	983	144,397	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	2	10	159	23,410	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	2	6	118	17,376	資本財
OMNICOM GROUP	3	8	79	11,725	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	2	9	106	15,620	公益事業
DUKE ENERGY CORP	10	38	364	53,540	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	1	5	89	13,123	消費者サービス
EBAY	7	20	104	15,345	一般消費財・サービス流通・小売り
BANK OF AMERICA CORP	99	334	1,191	175,003	銀行
CITIGROUP	27	94	542	79,589	銀行

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1	5	50	7,477	素材
EATON CORP	5	19	571	83,904	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	3	13	403	59,309	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	2	—	—	—	メディア・娯楽
ECOLAB INC	3	12	275	40,518	素材
REVVITY INC	2	6	72	10,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	3	11	150	22,045	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	14	46	1,429	209,808	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	8	27	307	45,201	資本財
ATMOS ENERGY CORP	2	6	76	11,206	公益事業
ENTERGY CORP	3	10	103	15,264	公益事業
EOG RESOURCES INC	8	28	333	48,892	エネルギー
EQUIFAX INC	1	6	165	24,300	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	3	18	68	10,069	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	3	11	174	25,615	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	2	6	75	11,109	運輸
EXXON MOBIL	58	192	2,088	306,646	エネルギー
FMC CORP	2	8	52	7,639	素材
NEXTERA ENERGY INC	28	100	583	85,640	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.62	1	75	11,155	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	—	1	146	21,575	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	0.55	1	31	4,638	保険
FASTENAL CO	7	27	211	31,080	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	8	27	101	14,919	銀行
M & T BANK CORP	2	8	124	18,211	銀行
FISERV INC	9	28	436	64,105	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	2	9	27	4,101	金融サービス
FREEMPORT-MCMORAN INC	20	72	287	42,219	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3	10	273	40,205	保険
DENTSPLY SIRONA INC	2	7	24	3,617	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	3	11	300	44,058	資本財
GENERAL MILLS INC	8	28	188	27,709	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	2	6	101	14,938	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	17	59	450	66,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	1	3	173	25,522	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	2	6	349	51,338	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	35	118	10,414	1,528,995	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	15	53	892	131,042	資本財
GRAINGER (WW) INC	0.58	1	191	28,065	資本財
HALLIBURTON CO	11	40	145	21,366	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4	15	607	89,147	金融サービス
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2	9	195	28,734	資本財
HASBRO INC	1	3	20	3,016	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	1	6	48	7,156	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY FOODS CORPORATION	1	6	126	18,510	食品・飲料・タバコ
HP INC	11	38	119	17,542	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	0.63	3	65	9,574	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUNIPER NETWORKS INC	3	12	47	6,999	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	3	10	82	12,126	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	14	48	1,796	263,716	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	3	11	40	5,914	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	9	27	78	11,588	公益事業
HUMANA INC	1	5	200	29,495	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1	3	79	11,721	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21	59	80	11,858	銀行
BIOPEN INC	2	6	155	22,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千円ドル	千円	
IDEX CORP	1	3	80	11,840	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	3	13	356	52,304	資本財
INTUIT INC	4	13	878	128,986	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	1	4	224	32,970	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	58	202	892	131,029	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3	10	85	12,544	素材
INT'L PAPER CO	3	12	44	6,560	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	6	13	42	6,304	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	0.77	2	49	7,256	金融サービス
JABIL INC	—	6	91	13,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	3	6	41	6,071	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON & JOHNSON	37	116	1,859	272,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	4	15	152	22,383	保険
KLA CORP	2	6	457	67,138	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORPORATION	10	30	142	20,887	エネルギー
KELLANOVA	4	12	69	10,171	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	14	53	79	11,677	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	5	16	204	29,996	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	2	6	575	84,458	金融サービス
KROGER CO	8	29	164	24,118	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	1	6	618	90,874	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.71	1	79	11,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PACKAGING CORP OF AMERICA	0.97	5	93	13,687	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	1	7	78	11,538	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	3	12	198	29,120	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	11	38	2,923	429,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATH & BODY WORKS INC	2	13	58	8,661	一般消費財・サービス流通・小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	1	—	—	—	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	10	34	535	78,640	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	4	13	193	28,418	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	3	10	459	67,498	資本財
LOEWS CORP	2	6	52	7,669	保険
CARNIVAL CORPORATION	13	42	69	10,236	消費者サービス
LOWES COMPANIES	8	28	684	100,494	一般消費財・サービス流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	12	42	205	30,197	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5	10	44	6,522	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3	9	65	9,575	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	10	34	1,020	149,903	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	4	15	676	99,276	金融サービス
EVEREST GROUP LTD	0.65	1	68	10,095	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9	30	278	40,895	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	7	23	486	71,444	保険
MASCO CORP	2	11	91	13,420	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.91	2	167	24,623	素材
METLIFE INC	9	31	224	32,976	保険
MEDTRONIC PLC	18	65	557	81,804	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	10	—	—	—	メディア・娯楽
CVS HEALTH CORP	18	63	475	69,845	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	36	122	1,517	222,754	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR CORP	5	21	166	24,492	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER	1	3	78	11,527	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	106	357	14,524	2,132,531	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	15	52	515	75,704	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8	27	242	35,621	半導体・半導体製造装置
3 M COMPANY	7	27	261	38,450	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.55	3	39	5,840	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
CHARLES RIVER LABORATORIES	0.53	2	56	8,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2	8	280	41,119	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	2	7	97	14,276	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	8	23	122	17,925	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	57	189	230	33,828	自動車・自動車部品
NETAPP INC	3	10	104	15,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	12	59	201	29,608	素材
NVR INC	0.05	0.15	114	16,858	耐久消費財・アパレル
NIKE B	17	58	583	85,736	耐久消費財・アパレル
NORDSON CORP	0.56	2	74	10,923	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	3	11	288	42,335	運輸
EVERSOURCE ENERGY	4	18	113	16,671	公益事業
NISOURCE INC	4	16	43	6,384	公益事業
TAPESTRY INC	2	12	60	8,833	耐久消費財・アパレル
NORTHERN TRUST CORP	3	9	78	11,554	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	2	6	314	46,145	資本財
WELLS FARGO & CO	54	174	997	146,389	銀行
NUCOR CORP	3	10	202	29,764	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5	19	261	38,341	金融サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10	32	196	28,815	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1	4	184	27,039	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.9	2	311	45,685	一般消費財・サービス流通・小売り
ORACLE CORP	21	76	859	126,168	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	7	25	288	42,351	資本財
EXELON CORP	14	51	189	27,826	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	1	6	344	50,570	資本財
PAYCHEX INC	4	14	173	25,543	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	3	110	16,195	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	11	40	108	15,990	公益事業
PEPSICO INC	19	66	1,078	158,332	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	1	8	71	10,541	資本財
PFIZER	79	276	751	110,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	17	57	645	94,765	エネルギー
PG&E CORP	20	91	152	22,363	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	3	11	281	41,366	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	24	85	356	52,307	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5	19	293	43,105	銀行
BROWN & BROWN INC	2	9	83	12,269	保険
GARMIN LTD	2	6	91	13,462	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	3	10	150	22,108	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	6	21	1,549	227,541	生活必需品流通・小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	2	10	123	18,096	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS	1	5	72	10,704	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	33	114	1,830	268,715	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	8	28	570	83,808	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	6	22	145	21,350	公益事業
PULTE GROUP INC	4	9	103	15,154	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	3	13	174	25,560	金融サービス
QUALCOMM	15	53	913	134,080	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2	9	113	16,606	金融サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	1	5	498	73,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RESMED INC	1	7	143	21,054	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	18	77	336	49,452	銀行
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5	18	161	23,654	保険
ROSS STORES INC	5	17	248	36,482	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
ROLLINS INC	2	9	45	6,612	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	5	285	41,921	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	1	5	168	24,783	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2	11	146	21,578	消費者サービス
ACCENTURE PLC-CL A	8	30	1,141	167,623	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19	65	470	69,043	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1	4	130	19,128	保険
TRAVELERS COS INC/THE	3	11	252	37,012	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	8	29	203	29,880	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	0.55	1	585	85,977	消費者サービス
SCHLUMBERGER	20	68	346	50,850	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	21	73	493	72,455	金融サービス
POOL CORP	0.68	2	85	12,553	一般消費財・サービス流通・小売り
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2	8	112	16,561	ヘルスケア機器・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	3	11	580	85,218	ヘルスケア機器・サービス
CENCORA INC	2	7	177	26,044	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3	9	74	11,001	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3	11	398	58,523	素材
CENTENE CORP	8	25	200	29,484	ヘルスケア機器・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	0.95	—	—	—	銀行
SMITH (A.O.) CORP	1	4	34	5,065	資本財
SNAP-ON INC	0.94	2	82	12,180	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5	16	180	26,473	保険
ADVANCE AUTO PARTS	0.63	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	4	16	117	17,248	公益事業
SOUTHERN CO	15	54	374	55,006	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	18	64	240	35,268	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3	10	313	45,962	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	9	31	107	15,824	運輸
AT&T INC	101	351	604	88,703	電気通信サービス
CHEVRON CORP	25	84	1,265	185,857	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	2	8	77	11,349	資本財
STATE STREET CORP	4	12	90	13,356	金融サービス
STARBUCKS CORP	16	54	500	73,491	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	2	7	96	14,226	素材
STRYKER CORP	4	16	585	85,959	ヘルスケア機器・サービス
NETFLIX INC	6	21	1,285	188,788	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	6	21	47	7,031	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	2	7	418	61,397	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	7	24	195	28,694	生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	5	16	663	97,458	ヘルスケア機器・サービス
TELEFLEX INC	0.49	1	41	6,095	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	2	7	80	11,825	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	12	44	765	112,394	半導体・半導体製造装置
TEXTRON	3	9	88	12,998	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5	18	1,123	164,953	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	0.95	4	54	7,967	保険
DAVITA INC	0.58	2	35	5,159	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1	5	125	18,498	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE IMS HOLDINGS	2	12	78	11,541	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.73	1	76	11,235	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	4	13	73	10,740	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORP	10	29	74	10,886	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	8	29	748	109,837	運輸
RTX CORP	20	70	640	94,094	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	13	44	2,120	311,366	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	0.67	3	58	8,538	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	3	15	24	3,616	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	5	9	10	1,558	メディア・娯楽
VERTEXX PHARMACEUTICALS INC	3	12	512	75,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VULCAN MATERIALS CO	1	6	161	23,768	素材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9	34	72	10,628	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	20	205	1,237	181,726	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	5	18	375	55,086	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.92	2	88	12,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1	3	139	20,500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	1	5	71	10,514	食品・飲料・タバコ
WESTERN DIGITAL CORP	3	13	88	12,940	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	2	8	123	18,141	資本財
WEYERHAEUSER CO	9	37	129	18,987	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
WHIRLPOOL CORP	0.57	1	20	3,065	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2	6	73	10,802	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	1	4	49	7,225	消費者サービス
NASDAQ INC	5	13	81	11,912	金融サービス
CME GROUP INC	5	17	380	55,878	金融サービス
WILLIAMS COS	18	59	214	31,481	エネルギー
LKQ CORP	4	13	71	10,448	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLIANT ENERGY CORPORATION	4	8	41	6,128	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	4	13	107	15,805	公益事業
CARMAX INC	1	6	51	7,599	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COMPANIES INC	16	55	527	77,504	一般消費財・サービス流通・小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.86	2	80	11,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	1	6	28	4,155	銀行
SIGNATURE BANK	0.66	—	—	—	銀行
CBRE GROUP INC-A	4	13	129	18,995	不動産管理・開発
REGIONS FINL CORP	13	38	75	11,155	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	0.37	1	84	12,348	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	0.67	2	168	24,725	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	5	18	97	14,270	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	5	11	35	5,199	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.39	1	32	4,769	金融サービス
CELANESE CORP-SERIES A	1	5	87	12,829	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	1	7	47	7,014	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	5	17	230	33,896	ヘルスケア機器・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	5	103	15,257	資本財
EXPEDIA GROUP INC	2	6	86	12,678	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3	9	80	11,887	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1	4	204	30,064	金融サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7	28	393	57,837	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT	1	5	54	7,966	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.41	1	354	52,057	消費者サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	4	12	54	8,061	運輸
TRANSDIGM GROUP INC	0.78	2	311	45,668	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	12	39	1,869	274,484	金融サービス
LEIDOS HOLDINGS	2	6	86	12,647	商業・専門サービス
FIRST SOLAR INC	1	4	72	10,683	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	2	5	115	17,004	商業・専門サービス
DELTA AIR LINES INC	8	29	126	18,536	運輸
INSULET CORP	—	2	48	7,066	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3	11	134	19,761	金融サービス
TE CONNECTIVITY LTD	4	15	212	31,134	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LULULEMON ATHLETICA INC	—	5	255	37,447	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(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		
	百株	百株	千米ドル	千円		
ULTA BEAUTY INC	0.66	2	128	18,797	一般消費財・サービス流通・小売り	
INVESCO LTD	4	17	27	4,094	金融サービス	
MSCI INC	1	3	211	31,011	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	22	74	692	101,619	食品・飲料・タバコ	
VISA INC-CLASS A SHARES	23	77	2,159	317,041	金融サービス	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2	8	101	14,902	公益事業	
MARATHON PETROLEUM CORP	6	18	340	50,007	エネルギー	
KINDER MORGAN INC	25	99	177	26,130	エネルギー	
XYLEM INC	2	11	140	20,672	資本財	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3	12	122	18,041	素材	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	0.42	1	37	5,512	資本財	
EPAM SYSTEMS INC	0.91	2	78	11,492	ソフトウェア・サービス	
HCA HEALTHCARE INC	3	9	310	45,525	ヘルスケア機器・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	2	6	165	24,239	商業・専門サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	2	83	12,303	金融サービス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2	—	—	—	銀行	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3	12	316	46,438	半導体・半導体製造装置	
TARGA RESOURCES CORP	3	9	94	13,872	エネルギー	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1	4	82	12,087	金融サービス	
DOLLAR GENERAL CORP	3	11	176	25,983	生活必需品流通・小売り	
FORTINET INC	9	27	199	29,300	ソフトウェア・サービス	
TESLA INC	38	133	2,332	342,516	自動車・自動車部品	
GENERAC HOLDINGS INC	0.66	2	23	3,438	資本財	
ENPHASE ENERGY INC	1	5	75	11,094	半導体・半導体製造装置	
GENERAL MOTORS CO	20	68	268	39,441	自動車・自動車部品	
APTIV PLC	3	13	103	15,222	自動車・自動車部品	
PHILLIPS 66	6	21	328	48,193	エネルギー	
META PLATFORMS INC-CLASS A	32	107	5,415	795,057	メディア・娯楽	
IQVIA HOLDINGS INC	2	8	210	30,962	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2	8	151	22,255	エネルギー	
SERVICENOW INC	2	10	757	111,242	ソフトウェア・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	14	418	61,502	ソフトウェア・サービス	
ABBVIE INC	25	85	1,531	224,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
T-MOBILE US INC	8	25	413	60,722	電気通信サービス	
PTC INC	1	4	87	12,795	ソフトウェア・サービス	
ZOETIS INC	6	22	413	60,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4	16	32	4,701	消費者サービス	
NEWS CORP-CLASS A	4	12	34	4,996	メディア・娯楽	
NEWS CORP-CLASS B	1	1	3	497	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	1	6	165	24,281	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6	37	55	8,172	運輸	
HOWMET AEROSPACE INC	6	18	127	18,767	資本財	
KEURIG DR PEPPER INC	10	51	150	22,046	食品・飲料・タバコ	
HUBBELL INC	—	2	86	12,640	資本財	
BAKER HUGHES CO	12	45	140	20,648	エネルギー	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2	7	74	10,904	食品・飲料・タバコ	
AXON ENTERPRISE INC	—	3	96	14,098	資本財	
BROADCOM INC	5	21	2,764	405,812	半導体・半導体製造装置	
EVERGY INC	3	7	40	6,018	公益事業	
ALLEGION PLC	0.92	4	53	7,799	資本財	
DAYFORCE INC	1	7	47	7,044	商業・専門サービス	
STERIS PLC	1	4	111	16,401	ヘルスケア機器・サービス	
MODERNA INC	4	14	147	21,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4	12	263	38,749	消費者サービス	
DOW INC	10	31	178	26,172	素材	
AMCOR PLC	24	77	72	10,644	素材	

S&P500インデックスマザーファンド ー第4期ー

銘柄	当期中(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		
	百株	百株	千円ドル	千円		
FOX CORP - CLASS A	3	6	17	2,601	メディア・娯楽	
FOX CORP- CLASS B	1	1	3	564	メディア・娯楽	
CARRIER GLOBAL CORP	12	37	215	31,705	資本財	
OTIS WORLDWIDE CORP	6	18	179	26,345	資本財	
UBER TECHNOLOGIES INC	—	99	779	114,391	運輸	
CORTEVA INC	10	36	197	28,989	素材	
BLACKSTONE INC	—	35	442	65,019	金融サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2	9	88	12,996	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND INC	5	18	165	24,333	資本財	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	4	17	167	24,545	ヘルスケア機器・サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	0.83	1	26	3,937	商業・専門サービス	
ORGANON & CO	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AON PLC	2	9	307	45,203	保険	
WARNER BROS DISCOVERY INC	34	104	91	13,428	メディア・娯楽	
AIRBNB INC-CLASS A	—	21	346	50,869	消費者サービス	
CONSTELLATION ENERGY	4	16	277	40,745	公益事業	
VIATRIS INC	12	64	78	11,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2	13	55	8,140	消費者サービス	
ARISTA NETWORKS INC	3	12	331	48,598	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JACOBS SOLUTIONS INC	2	6	90	13,245	商業・専門サービス	
APA CORP	3	16	52	7,635	エネルギー	
LINDE PLC	6	23	1,091	160,271	素材	
CATALENT INC	1	7	42	6,247	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SYNCHRONY FINANCIAL	7	21	88	13,066	金融サービス	
VERALTO CORP	—	11	103	15,175	商業・専門サービス	
BUNGE GLOBAL SA	—	7	68	10,017	食品・飲料・タバコ	
KENVUE INC	—	82	166	24,381	家庭用品・パーソナル用品	
COOPER COS INC/THE	—	8	87	12,817	ヘルスケア機器・サービス	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7	24	82	12,183	銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2	9	140	20,619	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QORVO INC	1	5	62	9,134	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	1	5	44	6,508	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	0.91	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ETSY INC	2	4	33	4,862	一般消費財・サービス流通・小売り	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	10	33	207	30,416	資本財	
DUPONT DE NEMOURS INC	7	21	152	22,339	素材	
WESTROCK CO	2	8	40	6,000	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	10	36	126	18,506	食品・飲料・タバコ	
FORTIVE CORP	5	17	151	22,226	資本財	
MATCH GROUP INC	5	11	37	5,494	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	85	285	3,867	567,758	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19	66	118	17,435	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	16	51	306	44,939	金融サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL C	75	240	3,277	481,222	メディア・娯楽	
MONSTER BEVERAGE CORP	5	35	210	30,880	食品・飲料・タバコ	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1	5	148	21,873	メディア・娯楽	
合 計	株数・金額	4,347	14,939	202,465	29,726,056	
	銘柄数<比率>	475	475	—	<87.7%>	

(注1) 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の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) <>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

〈外国投資信託受益証券、投資証券〉

銘 柄	当 期 首 (前 期 末)		当 期		末	
	口 数	口 数	口 数	口 数	評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千口	千口	千米ドル	千円
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.194	0.645	0.645	0.645	82	12,042
BOSTON PROPERTIES	0.15	0.433	0.433	0.433	27	4,064
PROLOGIS INC	1	4	4	4	612	89,953
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.181	0.663	0.663	0.663	123	18,198
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.193	0.425	0.425	0.425	42	6,312
CROWN CASTLE INC	0.616	2	2	2	236	34,749
ESSEX PROPERTY TRUST	0.109	0.362	0.362	0.362	88	13,044
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	0.442	1	1	1	87	12,903
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.077	0.3	0.3	0.3	30	4,500
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.949	4	4	4	72	10,621
WELLTOWER INC	0.729	2	2	2	256	37,591
KIMCO REALTY CORP	1	3	3	3	74	10,902
IRON MOUNTAIN INC	0.486	1	1	1	96	14,121
HOST HOTELS AND RESORTS INC	0.75	2	2	2	53	7,909
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.179	0.516	0.516	0.516	69	10,220
REALTY INCOME CORP	0.941	4	4	4	223	32,867
REGENCY CENTERS CORP	0.162	0.952	0.952	0.952	58	8,647
UDR INC	0.538	1	1	1	42	6,237
SIMON PROPERTY GROUP	0.492	1	1	1	247	36,348
PUBLIC STORAGE	0.231	0.805	0.805	0.805	235	34,645
VENTAS INC	0.609	2	2	2	98	14,452
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.2	0.967	0.967	0.967	145	21,381
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.368	1	1	1	230	33,907
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.663	2	2	2	478	70,218
INVITATION HOMES INC	0.909	2	2	2	87	12,859
EQUINIX INC	0.129	0.465	0.465	0.465	423	62,133
VICI PROPERTIES INC	1	4	4	4	137	20,192
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.138	0.506	0.506	0.506	113	16,618
合 計	口 数 ・ 金 額	14	49	49	4,479	657,647
	銘 柄 数 <比 率>	28	28	28	—	<1.9%>

(注1) 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の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

〈先物取引の銘柄別期末残高〉

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
SP500 MIC EM	3,780	—

(注) 外貨建の評価額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	29,726,056	87.6
投 資 証 券	657,647	1.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,548,064	10.5
投 資 信 託 財 産 総 額	33,931,767	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(31,391,604千円)の投資信託財産総額(33,931,767千円)に対する比率は92.5%です。

(注2) 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の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=146.82円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2024年3月11日現在
(A) 資 産	36,723,520,100円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,952,814,401
株 式(評価額)	29,726,056,967
投 資 証 券(評価額)	657,647,228
未 収 入 金	2,832,753,107
未 収 配 当 金	35,277,509
差 入 委 託 証 拠 金	518,970,888
(B) 負 債	2,843,709,620
未 払 金	2,843,708,503
未 払 利 息	1,117
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	33,879,810,480
元 本	15,822,497,108
次 期 繰 越 損 益 金	18,057,313,372
(D) 受 益 権 総 口 数	15,822,497,108口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,412円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
(A) 配 当 等 収 益	220,718,100円
受 取 配 当 金	194,271,582
受 取 利 息	16,433,005
そ の 他 収 益 金	10,199,211
支 払 利 息	△185,698
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,342,529,156
売 買 益	4,810,431,148
買 買 損	△467,901,992
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	434,846,007
取 引 益	489,866,912
取 引 損	△55,020,905
(D) そ の 他 費 用	△9,100,748
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	4,988,992,515
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	2,239,320,774
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,143,290,883
(H) 解 約 差 損 益 金	△314,290,800
(I) 計 (E+F+G+H)	18,057,313,372
次 期 繰 越 損 益 金(I)	18,057,313,372

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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3) (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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は4,485,601,989円、期中追加設定元本額は11,814,889,672円、期中一部解約元本額は477,994,553円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

My SMT S&P500インデックス (ノーロード)	11,819,951,070円
DC米国株式インデックス・オープン (S&P500)	3,035,669,330円
FOFs用米国2資産バランスファンド (適格機関投資家専用)	966,876,708円

お知らせ

該当事項はありません。