

運用報告書 (全体版)

第24期<決算日2022年11月15日>

コア30インデックス

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|--|
| 商品分類 | 追加型投信/国内/株式/インデックス型 | |
| 信託期間 | 原則、無期限です。 | |
| 運用方針 | 東京証券取引所の株価指数「トピックスコア30」の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行い、「トピックスコア30」株価指数に連動する投資成果をめざします。 | |
| 主要投資対象 | コア30インデックス | コア30インデックス マザーファンドならびにわが国の上場株式を主要投資対象とします。 |
| | コア30インデックス マザーファンド | わが国の上場株式を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | <p>①主としてコア30インデックス マザーファンドへの投資を通してわが国の上場株式へ投資します。株式への投資にあたっては、原則として「トピックスコア30」の採用銘柄（採用予定銘柄を含みます。）に投資を行います。</p> <p>②資金の流入出にあたっては、ポートフォリオの組入銘柄構成比率が「トピックスコア30」の時価構成比率から大きく変化しないように株式の売買を行うよう努めます。</p> <p>③株式の組入比率は高位を保ちますが、資金の流入出の調整等のため株価指数先物取引等を利用する場合があります。</p> | |
| 組入制限 | コア30インデックス | 株式への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | コア30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。 |
| 分配方針 | 原則として、配当等収益および売買益（評価益を含みます）等を対象に、収益の分配を行います。分配金額は、基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、基本方針にしたがって運用を行います。 | |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「コア30インデックス」は、2022年11月15日に第24期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

コア30インデックス

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 税込み 分配金 | | トピックスコア30 (ベンチマーク) | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 純資産 総額 |
|------------------|---------------|------------|-----------|-----------------------|-----------|------------|------------|--------------|
| | | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 20期(2018年11月15日) | 円 8,805 | 円 0 | % △6.4 | ポイント 731.79 | % △8.3 | % 98.0 | % - | 百万円 1,569 |
| 21期(2019年11月15日) | 9,523 | 0 | 8.2 | 775.75 | 6.0 | 97.6 | - | 1,647 |
| 22期(2020年11月16日) | 10,078 | 0 | 5.8 | 803.52 | 3.6 | 98.4 | - | 1,058 |
| 23期(2021年11月15日) | 12,674 | 5 | 25.8 | 997.51 | 24.1 | 98.6 | - | 991 |
| 24期(2022年11月15日) | 12,442 | 5 | △1.8 | 963.94 | △3.4 | 98.5 | - | 925 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質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。

(注4) トピックスコア30 (TOPIX Core30) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日 | 基準価額 | | トピックスコア30 (ベンチマーク) | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 |
|---------------------|-------------|--------|-----------------------|--------|------------|------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2021年11月15日 | 円 12,674 | % - | ポイント 997.51 | % - | % 98.6 | % - |
| 11月末 | 12,040 | △5.0 | 947.10 | △5.1 | 99.0 | - |
| 12月末 | 12,523 | △1.2 | 986.14 | △1.1 | 99.8 | - |
| 2022年1月末 | 11,934 | △5.8 | 940.73 | △5.7 | 99.7 | - |
| 2月末 | 11,662 | △8.0 | 919.58 | △7.8 | 99.7 | - |
| 3月末 | 12,416 | △2.0 | 969.50 | △2.8 | 98.6 | - |
| 4月末 | 12,021 | △5.2 | 938.80 | △5.9 | 98.6 | - |
| 5月末 | 12,123 | △4.3 | 947.01 | △5.1 | 98.6 | - |
| 6月末 | 11,573 | △8.7 | 903.96 | △9.4 | 99.1 | - |
| 7月末 | 12,082 | △4.7 | 944.53 | △5.3 | 99.7 | - |
| 8月末 | 12,132 | △4.3 | 949.09 | △4.9 | 99.7 | - |
| 9月末 | 11,287 | △10.9 | 872.30 | △12.6 | 98.4 | - |
| 10月末 | 12,102 | △4.5 | 936.80 | △6.1 | 98.5 | - |
| (期末) 2022年11月15日 | 12,442 | △1.8 | 963.94 | △3.4 | 98.5 | - |

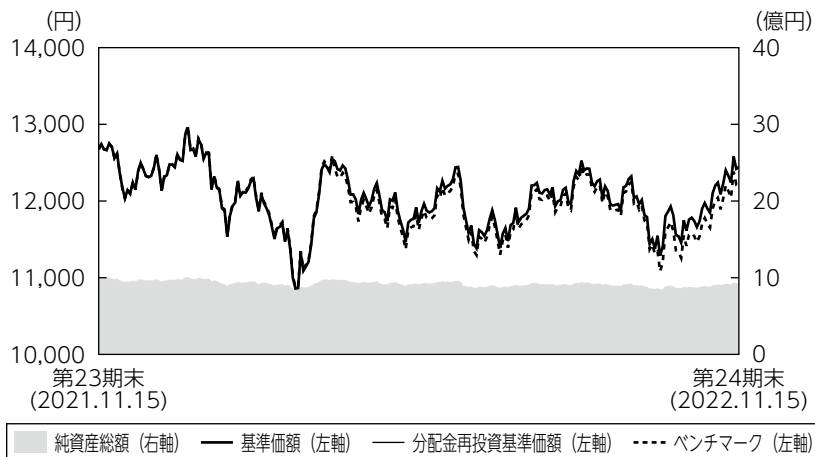
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質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。

■当期の運用経過（2021年11月16日から2022年11月15日まで）

基準価額等の推移



第24期首：12,674円
第24期末：12,442円
(既払分配金5円)
騰落率：△1.8%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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さま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。従って、お客さま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およびベンチマークは、期首の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

世界的な金融引き締めによる景気後退懸念などからトピックスコア30株価指数が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

投資環境

国内株式市場は下落しました。期初から2022年3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの新規感染者数の拡大やウクライナ情勢の緊迫化、米国の金利上昇などに対する警戒感などから軟調な推移となりました。その後は円安ドル高が進行したことが相場の支えとなる局面もありましたが、世界的な金融引き締めによる景気後退懸念などが重しとなり、不安定な相場展開が続きました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

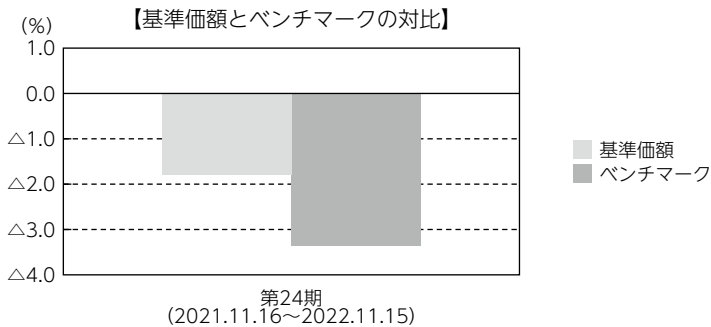
コア30インデックス マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

●コア30インデックス マザーファンド

トピックスコア30株価指数に連動する投資成果をめざす親投資信託です。運用にあたっては、トピックスコア30株価指数の採用銘柄（採用予定銘柄を含みます。）に投資を行い、株式組入比率は期を通じておおむね高位に保ちトピックスコア30株価指数との連動性を保つよう努めました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるトピックスコア30株価指数は3.4%下落しました。当ファンドはベンチマークを1.6%上回りました。騰落率に差異が生じた主な要因は、保有株式の配当金のプラス要因と未収収益の発生等を背景とした現金保有や信託報酬などのマイナス要因との差によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては分配原資等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|-----------------------------|
| | 2021年11月16日 ～2022年11月15日 |
| 当期分配金（税引前） | 5円 |
| 対基準価額比率 | 0.04% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | 5円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,678円 |

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が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、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、コア30インデックス マザーファンドの株式組入比率を高位に保ちます。

●コア30インデックス マザーファンド

引き続き、トピックスコア30株価指数に連動した投資成果を目指し、運用を行います。運用にあたっては、株式組入比率を高位に保ちます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第24期 | | 項目の概要 |
|---------------------|-------------------------------|------------------|--|
| | (2021年11月16日 ～2022年11月15日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 106円 | 0.880% | (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12,032円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (33) | (0.275) | |
| (販売会社) | (60) | (0.495) | |
| (受託会社) | (13) | (0.110) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.006 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (1) | (0.006) | |
| (c) その他費用 (監査費用) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| 合計 | 107 | 0.887 | |

(注1) 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、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

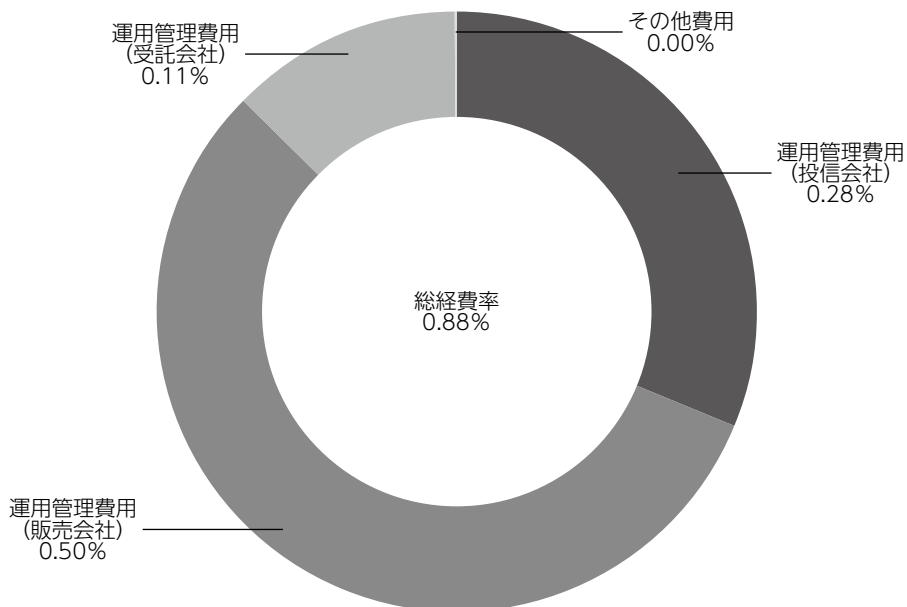
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.88%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年11月16日から2022年11月15日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| コア30インデックス マザーファンド | 千□ 39,638 | 千円 73,366 | 千□ 68,627 | 千円 129,112 |

■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 | コア30インデックス マザーファンド |
|-------------------------------|--------------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 329,371千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 913,450千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.36 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年11月16日から2022年11月15日まで）

【コア30インデックスにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|----------------|--------------------|------------|----------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.00016 | 百万円 0.00016 | % 100.0 | 百万円 0.00016 | 百万円 0.00016 | % 100.0 |

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 53千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 8千円 |
| (B)／(A) | 16.2% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

【コア30インデックス マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|--------------|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 147 | 百万円 20 | % 14.0 | 百万円 181 | 百万円 32 | % 17.9 |
| 金 銭 信 託 | 0.001178 | 0.001178 | 100.0 | 0.001178 | 0.001178 | 100.0 |

平均保有割合 100.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | |
|-----|----------|----------|-------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 3 | 百万円 2 | 百万円 19 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| コア30インデックス マザーファンド | 千円 508,578 | 千円 479,588 | 千円 925,461 |

■投資信託財産の構成

2022年11月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コア30インデックス マザーファンド | 千円 925,461 | % 99.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 6,719 | 0.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 932,181 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 932,181,727円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 4,210,857 |
| コア30インデックス マザーファンド(評価額) | 925,461,870 |
| 未 収 入 金 | 2,509,000 |
| (B) 負 債 | 6,518,456 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 371,981 |
| 未 払 解 約 金 | 2,127,671 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 4,011,769 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 7,035 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 925,663,271 |
| 元 本 | 743,962,508 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 181,700,763 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 743,962,508口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 12,442円 |

(注) 期首における元本額は782,271,624円、当期中における追加設定元本額は76,374,566円、同解約元本額は114,683,682円です。

■損益の状況

当期 自2021年11月16日 至2022年11月15日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △534円 |
| 受 取 利 息 | 20 |
| 支 払 利 息 | △554 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △4,028,450 |
| 売 買 益 | 4,723,591 |
| 売 買 損 | △8,752,041 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △8,157,776 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △12,186,760 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 305,727,996 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △111,468,492 |
| (配 当 等 相 当 額) | (265,896,247) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△377,364,739) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 182,072,744 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △371,981 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | 181,700,763 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △111,468,492 |
| (配 当 等 相 当 額) | (265,896,247) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△377,364,739) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 305,356,300 |
| 繰 越 損 益 金 | △12,187,045 |

(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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 265,896,247 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 305,728,281 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 571,624,528 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 7,683.51 |
| (g) 分 配 金 | 371,981 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 5 |

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 5円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎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、その後の受益者毎の個別元本となります。

コア30インデックス マザーファンド

運用報告書

第21期 (決算日 2022年11月4日)

(計算期間 2021年11月5日～2022年11月4日)

コア30インデックス マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 原則、無期限です。 |
| 運用方針 | 東京証券取引所の株価指数「トピックスコア30」の採用銘柄（採用予定銘柄を含みます。）に投資を行い、「トピックスコア30」株価指数に連動する投資成果をめざします。 |
| 主要投資対象 | わが国の上場株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | トピックスコア30 | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|-----------|------|------------|------------|-------|
| | 期騰落 | 中率 | (ベンチマーク) | 期騰落 | | | |
| 17期(2018年11月4日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| | 13,433 | △6.6 | 742.14 | △9.1 | 98.3 | — | 1,592 |
| 18期(2019年11月4日) | 14,165 | 5.4 | 760.09 | 2.4 | 98.4 | — | 1,627 |
| 19期(2020年11月4日) | 14,413 | 1.8 | 752.47 | △1.0 | 98.5 | — | 1,119 |
| 20期(2021年11月4日) | 19,314 | 34.0 | 988.51 | 31.4 | 98.7 | — | 983 |
| 21期(2022年11月4日) | 18,735 | △3.0 | 935.93 | △5.3 | 98.5 | — | 901 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) トピックスコア30 (TOPIX Core30) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

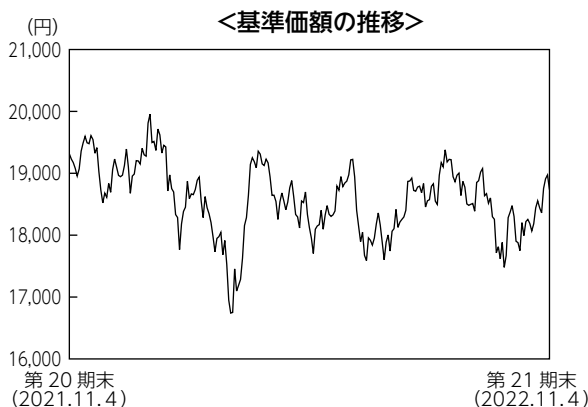
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | トピックスコア30 (ベンチマーク) | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 |
|---------------------|---------|------------|-----------------------|------------|----------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | ポ イ ン ト | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2021年11月4日 | 19,314 | — | 988.51 | — | 98.7 | — |
| 11 月 末 | 18,521 | △4.1 | 947.10 | △4.2 | 99.0 | — |
| 12 月 末 | 19,277 | △0.2 | 986.14 | △0.2 | 99.9 | — |
| 2022年1 月 末 | 18,383 | △4.8 | 940.73 | △4.8 | 99.7 | — |
| 2 月 末 | 17,976 | △6.9 | 919.58 | △7.0 | 99.7 | — |
| 3 月 末 | 19,152 | △0.8 | 969.50 | △1.9 | 98.6 | — |
| 4 月 末 | 18,553 | △3.9 | 938.80 | △5.0 | 98.6 | — |
| 5 月 末 | 18,726 | △3.0 | 947.01 | △4.2 | 98.7 | — |
| 6 月 末 | 17,886 | △7.4 | 903.96 | △8.6 | 99.2 | — |
| 7 月 末 | 18,685 | △3.3 | 944.53 | △4.4 | 99.7 | — |
| 8 月 末 | 18,776 | △2.8 | 949.09 | △4.0 | 99.7 | — |
| 9 月 末 | 17,480 | △9.5 | 872.30 | △11.8 | 98.5 | — |
| 10 月 末 | 18,755 | △2.9 | 936.80 | △5.2 | 98.5 | — |
| (期 末) 2022年11月4日 | 18,735 | △3.0 | 935.93 | △5.3 | 98.5 | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年11月5日から2022年11月4日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は18,735円となり、前期末比で3.0%下落しました。

基準価額の主な変動要因

世界的な金融引き締めによる景気後退懸念などからトピックスコア30株価指数が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの新規感染者数の拡大やウクライナ情勢の緊迫化、米国の金利上昇などに対する警戒感などから軟調な推移となりました。その後は円安ドル高が進行したことが相場の支えとなる局面もありましたが、世界的な金融引き締めによる景気後退懸念などが重しとなり、不安定な相場展開が続きました。

ポートフォリオについて

当ファンドは、トピックスコア30株価指数に連動する投資成果をめざす親投資信託です。運用にあたっては、トピックスコア30株価指数の採用銘柄に投資を行い、株式組入比率は期を通じて概ね高位に保ちました。なお、トピックスコア30株価指数採用銘柄の定期入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.3%下落しました。当ファンドはベンチマークを2.3%上回りました。騰落率に差異が生じた主な要因は、保有株式の配当金のプラス寄与によるものです。

今後の運用方針

引き続き、トピックスコア30株価指数に連動した投資成果を目指し、運用を行います。運用にあたっては、株式組入比率を高位に保ちます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|-----------|-------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 1円 (1) | 0.006% (0.006) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| 合 計 | 1 | 0.006 | |
| 期中の平均基準価額は18,580円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2021年11月5日から2022年11月4日まで)

株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|--|----------------|----------------|------|---------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 上 場 | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 45.9 (10.8) | 147,825 (-) | 47.1 | 180,617 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は株式分割、増資割当および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。

■ 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 | 328,442千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 913,450千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b) | 0.35 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年11月5日から2022年11月4日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|-----------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 株 式 | 百万円 147 | 百万円 20 | % 14.0 | 百万円 180 | 百万円 32 | % 18.0 |
| 金 銭 信 託 | 0.001178 | 0.001178 | 100.0 | 0.001178 | 0.001178 | 100.0 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | |
|-----|----------|----------|-------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 3 | 百万円 2 | 百万円 19 |

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 53千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 8千円 |
| (B)/(A) | 16.2% |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

国内株式

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|-----------------------|----------------|------|--------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 化学 (2.6%) | | | |
| 信越化学工業 | 1.6 | 1.5 | 23,182 |
| 花王 | 2.1 | — | — |
| 医薬品 (9.1%) | | | |
| 武田薬品工業 | 7.5 | 7.6 | 29,168 |
| アステラス製薬 | 8.2 | 8.2 | 16,978 |
| 第一三共 | 7.5 | 7.5 | 34,845 |
| 機械 (4.5%) | | | |
| SMC | 0.3 | 0.3 | 17,829 |
| ダイキン工業 | 1.2 | 1 | 22,445 |
| 電気機器 (24.7%) | | | |
| 日立製作所 | 4.6 | 4.3 | 30,082 |
| 日本電産 | 2.5 | 2.1 | 16,779 |
| ソニーグループ | 6 | 6.1 | 65,270 |
| キーエンス | 0.9 | 0.9 | 50,310 |
| ファナック | 0.8 | 0.8 | 15,696 |
| 村田製作所 | 2.8 | 2.6 | 18,142 |
| 東京エレクトロン | 0.6 | 0.6 | 22,770 |
| 輸送用機器 (13.2%) | | | |
| トヨタ自動車 | 48.2 | 47.1 | 93,493 |
| 本田技研工業 | 7.5 | 7 | 23,695 |
| 精密機器 (2.8%) | | | |
| HOYA | 1.9 | 1.9 | 25,051 |
| その他製品 (3.6%) | | | |
| 任天堂 | 0.5 | 5.4 | 32,151 |
| 情報・通信業 (14.1%) | | | |
| 日本電信電話 | 10.9 | 11 | 44,055 |
| KDDI | 6.8 | 6.6 | 28,083 |
| ソフトバンク | — | 13.8 | 20,092 |
| ソフトバンクグループ | 5.6 | 5 | 32,785 |
| 卸売業 (8.0%) | | | |
| 伊藤忠商事 | 6.6 | 5.6 | 22,506 |
| 三井物産 | 7.3 | 6.6 | 23,951 |
| 三菱商事 | 7 | 5.7 | 24,561 |
| 小売業 (1.9%) | | | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 3.7 | 3.1 | 16,969 |
| 銀行業 (9.6%) | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 60.2 | 55.3 | 38,820 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 6.5 | 6.2 | 26,319 |
| みずほフィナンシャルグループ | 12 | 12.2 | 19,776 |
| 保険業 (2.6%) | | | |
| 東京海上ホールディングス | 3.1 | 8.5 | 22,831 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------|----------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 期首(前期末) 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サービス業 (3.3%) | | | |
| リクルートホールディングス | 7 | 6.5 | 29,269 |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 株 柄 数 < 比 率 > | 千株 241.4 30銘柄 | 千円 887,911 <98.5%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

■投資信託財産の構成

2022年11月4日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 887,911千円 | 98.5% |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 13,726 | 1.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 901,637 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月4日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 901,637,997円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 3,262,279 |
| 株 式(評価額) | 887,911,200 |
| 未 取 配 当 金 | 10,464,518 |
| (B) 負 債 | 259,000 |
| 未 払 解 約 金 | 259,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 901,378,997 |
| 元 本 | 481,109,825 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 420,269,172 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 481,109,825口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 18,735円 |

(注1) 期首元本額 509,226,809円
追加設定元本額 39,407,237円
一部解約元本額 67,524,221円

(注2) 期末における元本の内訳
コア30インデックス 481,109,825円
期末元本合計 481,109,825円

■損益の状況

当期 自2021年11月5日 至2022年11月4日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 22,342,498円 |
| 受 取 配 当 金 | 22,343,312 |
| 受 取 利 息 | 34 |
| そ の 他 収 益 金 | 3 |
| 支 払 利 息 | △851 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △50,418,809 |
| 売 買 益 | 71,899,798 |
| 売 買 損 | △122,318,607 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | △28,076,311 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 474,302,499 |
| (E) 解 約 差 損 益 金 | △59,474,779 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 33,517,763 |
| (G) 合 計(C+D+E+F) | 420,269,172 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 420,269,172 |

(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) (E)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。