

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	信託期間は2015年6月16日から2026年2月17日までです。
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	以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 FOFs用国内株式エンハスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用) 中小型株式 マザーファンド 国内株式インデックス マザーファンド 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド 国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用) 日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用) FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用) 外国株式インデックス マザーファンド 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用) ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用) Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J J-REITインデックス マザーファンド グローバルREITインデックス マザーファンド ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用) 米国株式LSマザーファンド コモディティLSアルファ・マザーファンド ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用) ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用) MA Hedge Fund Strategies Limited 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブの直接利用は行いません。
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。

サテライト投資戦略ファンド(株式型) (愛称:サテラップ(株式型))

運用報告書(全体版)

第8期(決算日 2023年2月17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1万口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。
- ・ 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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		株式組 入率	株式先 物率	債券組 入率	債券先 物率	投資信託 証券組 入比率	純資産 総額
		税込 分配金	期中 騰落率						
第4期(2019年2月18日)	円 9,864	円 0	% △2.6	% 39.7	% 1.3	% 13.8	% —	% 44.1	百万円 18,337
第5期(2020年2月17日)	10,917	0	10.7	41.1	1.2	9.7	—	46.3	13,138
第6期(2021年2月17日)	11,845	0	8.5	45.8	0.6	11.7	—	40.5	11,518
第7期(2022年2月17日)	12,563	0	6.1	35.1	0.7	12.2	—	50.7	9,679
第8期(2023年2月17日)	12,791	0	1.8	29.1	0.7	12.0	—	56.0	8,916

(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、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準 騰落率	株式組 入率	株式先 物率	債券組 入率	債券先 物率	投資信託 証券組 入比率
(当期首) 2022年 2月17日	円 12,563	% —	% 35.1	% 0.7	% 12.2	% 50.7
2月末	12,324	△1.9	35.0	0.8	12.5	50.6
3月末	12,974	3.3	33.3	1.0	12.9	50.7
4月末	12,623	0.5	32.8	0.9	13.2	51.3
5月末	12,599	0.3	29.9	1.0	13.0	54.2
6月末	12,433	△1.0	29.7	0.9	13.4	55.0
7月末	12,652	0.7	30.2	1.1	13.1	54.0
8月末	12,675	0.9	30.4	0.8	13.1	54.1
9月末	12,214	△2.8	29.9	0.9	13.6	53.6
10月末	12,607	0.4	31.2	0.8	13.3	52.9
11月末	12,689	1.0	29.2	0.8	12.4	54.8
12月末	12,289	△2.2	27.9	0.7	12.6	55.7
2023年 1月末	12,642	0.6	28.4	0.6	11.8	55.8
(当期末) 2023年 2月17日	12,791	1.8	29.1	0.7	12.0	56.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

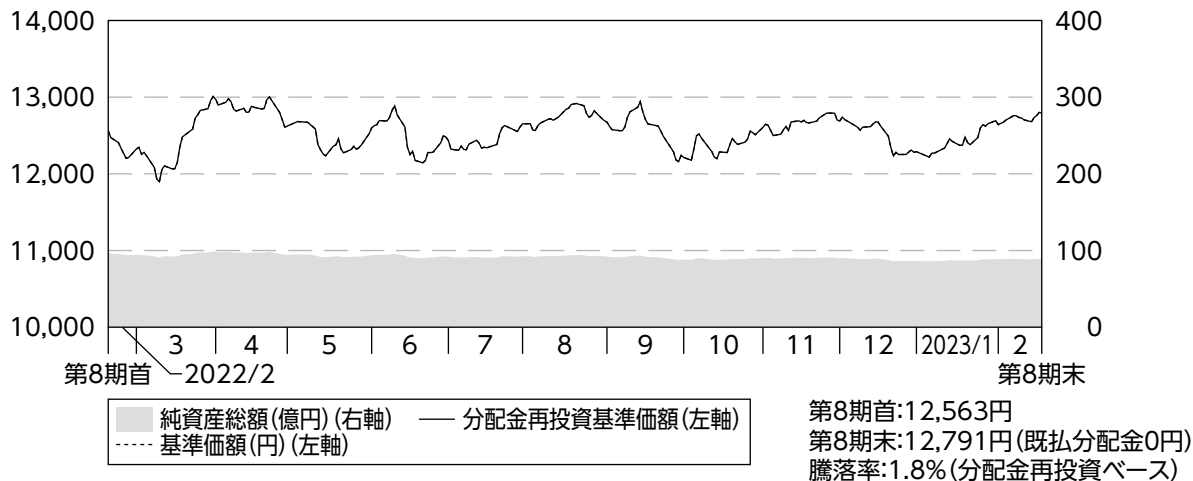
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

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は、2022年2月17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

当期の基準価額は上昇しました。欧米中央銀行の金融引き締めを背景に為替ヘッジ付きのゴールドなどがマイナスに影響した一方、期を通じて円安・米ドル高が進行したことで国内株式が堅調に推移したほか、先進国株式や海外リートの円ベースのパフォーマンスも堅調となったことなどから、基準価額は上昇しました。

当ファンドの投資対象ファンドの騰落率は以下の通りです。

組入ファンド	投資資産※1※2	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
FOFs用国内株式エンハスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	3.0%	8.0%
中小型株式 マザーファンド	国内株式	1.4%	2.2%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	10.1%	5.9%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	国内株式	1.4%	△1.4%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	5.8%	4.7%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	2.8%	0.9%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	4.5%	8.7%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	15.7%	8.4%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	先進国株式	1.4%	0.1%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	先進国株式	2.9%	8.0%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	先進国株式	2.9%	12.5%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	先進国株式	2.9%	0.4%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	新興国株式	2.8%	△7.3%
J-REITインデックス マザーファンド	国内リート	5.7%	△1.0%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外リート	5.2%	3.5%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	ヘッジファンド等	7.1%	△6.5%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	ヘッジファンド等	3.4%	△4.8%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	1.4%	8.9%
米国株式LSマザーファンド	ヘッジファンド等	3.2%	5.7%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ヘッジファンド等	4.0%	8.8%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	3.7%	△1.1%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	2.0%	△5.7%
MA Hedge Fund Strategies Limited	ヘッジファンド等	2.9%	△3.3%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ヘッジファンド等	1.6%	13.4%

※1 リートとは、不動産投資信託証券のことをいいます。本報告書では、同様の記載をすることがあります。

※2 先進国株式は、一部を新興国株式に投資するものを含みます。

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 期中に組み入れたファンドの騰落率は当ファンドへの組入日からのものです。

○国内株式市場

国内株式は上昇しました。

欧米の中央銀行が相次いで利上げを実施したことに加え、日銀の金融政策修正がマイナスに影響した一方、円安・米ドル高が進行したこと、新型コロナウイルスワクチンの接種進展により経済活動が正常化に向かったことなどがプラスに寄与し、国内株式は上昇しました。

○先進国株式市場

先進国株式は円ベースでは上昇しました。

FOMC(米連邦公開市場委員会)で政策金利見通しが引き上げられたことで、利上げ長期化による景気後退が意識されたことなどから、先進国株式は現地通貨ベースで軟調に推移しました。一方で、投資対象通貨が円に対して上昇し、円ベースでは上昇しました。

○新興国株式市場

新興国株式は下落しました。

新型コロナウイルス感染拡大に伴う中国の主要都市でのロックダウン(都市封鎖)に加え、欧米の金融引き締め長期化による世界的な景気減速が懸念されたことから、新興国株式は下落しました。一方で、投資対象通貨が円に対して上昇したことが、マイナス幅を抑制しました。

○国内リート市場

国内リートは下落しました。

当期初から2022年6月中旬にかけては、米国を中心とした金融引き締めに伴う世界的なリスクオフの動きの強まりから下落しました。6月中旬から9月中旬にかけては、日銀が金融政策決定会合で金融緩和の維持を決定したことなどから堅調に推移しました。10月末にかけては米国の金融引き締めペースの鈍化が意識されたことなどから堅調に推移しましたが、期末にかけて、欧米の金融引き締め長期化への警戒感が意識される中、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作の運用の一部見直しを発表したことや、日銀の金融政策を巡る不透明感が意識されたことなどから下落しました。

○海外リート市場

海外リートは円ベースでは上昇しました。

期前半はインフレ高進を背景に欧米中央銀行が金融引き締めを加速するとの懸念が広がり、各国の長期金利が上昇基調となったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、FOMC議事要旨が利上げペースの減速を示唆する内容となり米長期金利の上昇が一服したことなどから、下げ幅を縮小しました。一方で、投資対象通貨が円に対して上昇したことから、円ベースでは上昇しました。

○ゴールド市場

当期のゴールドは下落しました。

当期初は、ロシアがウクライナへ軍事侵攻を開始したことなどを背景に金に対する安全資産需要が強まったことから一時大幅に上昇しました。その後は、FRB(米連邦準備理事会)による利上げペースが一段と加速するとの見方が強まり米長期金利が上昇したことや米ドル高が進行したことなどを背景に軟調に推移しました。11月以降は、FOMC議事要旨が利上げペースの減速を示唆する内容となり米長期金利の上昇が一服したことなどから、金価格は堅調に推移しましたが、期末にかけて堅調な米経済指標などを背景に米長期金利が再び上昇基調となるなか、下落しました。

○当ファンド

日本を含む先進国及び新興国の株式、不動産投資信託証券(REIT)など株式代替資産及びその他の様々な資産並びにヘッジファンド等を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資し、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、投資対象ファンドのリターン・リスク特性を踏まえた目標配分比率に基づきポートフォリオの組成を行い、中長期的な安定収益の獲得を目指したファンド運営を行いました。

・ FOFs用国内株式EVI/バリューファンド(適格機関投資家専用)

国内株式資産の投資割合の見直しに伴い新規に組み入れ、当期末時点における組入比率は4.5%となりました。

・ JPX日経インデックス400 マザーファンド

国内株式資産の投資割合の見直しに伴い全部売却を行ったことから、当期末時点における組み入れはありません。

・ 外国株式インデックス マザーファンド

外国株式資産の投資割合の見直しに伴う目標配分比率の変更により、当期末時点における組入比率は15.7%となりました。

・ ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)

ヘッジファンド資産の投資割合の見直しに伴い新規に組み入れ、当期末時点における組入比率は2.0%となりました。

・ MA Hedge Fund Strategies Limited

ヘッジファンド資産の投資割合の見直しに伴う目標配分比率の変更により、当期末時点における組入比率は2.9%となりました。

当ファンドのポートフォリオ

組入ファンド	当期首(前期末)	当期末	差
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	—	4.5%	+4.5%
JPX日経インデックス400 マザーファンド	4.4%	—	△4.4%
外国株式インデックス マザーファンド	18.4%	15.7%	△2.6%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	—	2.0%	+2.0%
MA Hedge Fund Strategies Limited	1.4%	2.9%	+1.5%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	5.2%	3.7%	△1.5%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	—	1.4%	+1.4%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	4.8%	3.4%	△1.4%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	—	1.4%	+1.4%
中小型株式 マザーファンド	2.6%	1.4%	△1.2%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	6.4%	5.8%	△0.6%
国内株式インデックス マザーファンド	10.7%	10.1%	△0.6%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	3.5%	4.0%	+0.5%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	3.2%	2.8%	△0.4%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	1.2%	1.6%	+0.3%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.8%	7.1%	+0.3%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	3.2%	2.9%	△0.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.4%	5.2%	△0.2%
米国株式LSマザーファンド	3.0%	3.2%	+0.2%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	3.1%	2.9%	△0.2%
J-REITインデックス マザーファンド	5.5%	5.7%	+0.1%
FOFs用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3.1%	3.0%	△0.1%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	2.9%	2.8%	△0.1%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1.4%	1.4%	△0.0%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	2.9%	2.9%	+0.0%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

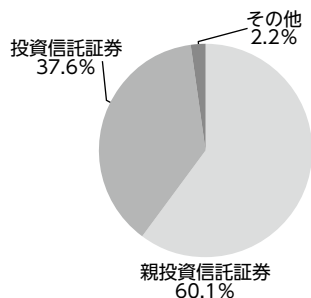
当ファンドの組入資産の内容

○組入上位ファンド

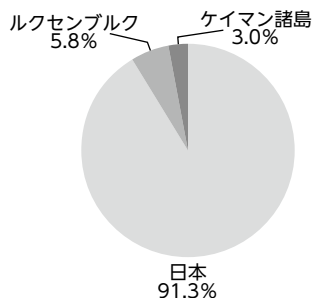
順位	ファンド名	当期末
		2023年2月17日
1	外国株式インデックス マザーファンド	15.7%
2	国内株式インデックス マザーファンド	10.1%
3	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	7.1%
4	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	5.8%
5	J-REITインデックス マザーファンド	5.7%
6	グローバルREITインデックス マザーファンド	5.2%
7	FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.5%
8	コモディティLSアルファ・マザーファンド	4.0%
9	ムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3.7%
10	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	3.4%
組入ファンド数		24

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

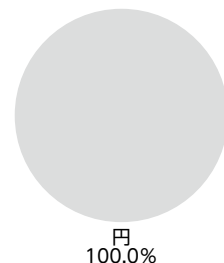
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

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8期	
	2022年2月18日~2023年2月17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)	3,118	

(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

主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月18日~2023年2月17日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	204円	1.628%	(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12,560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)	(128)	(1.023)	
(販売会社)	(69)	(0.550)	
(受託会社)	(7)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	1	0.004	(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)	(0)	(0.002)	
(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)	(0.002)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(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)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	2	0.018	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.013)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	207	1.651	

(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。

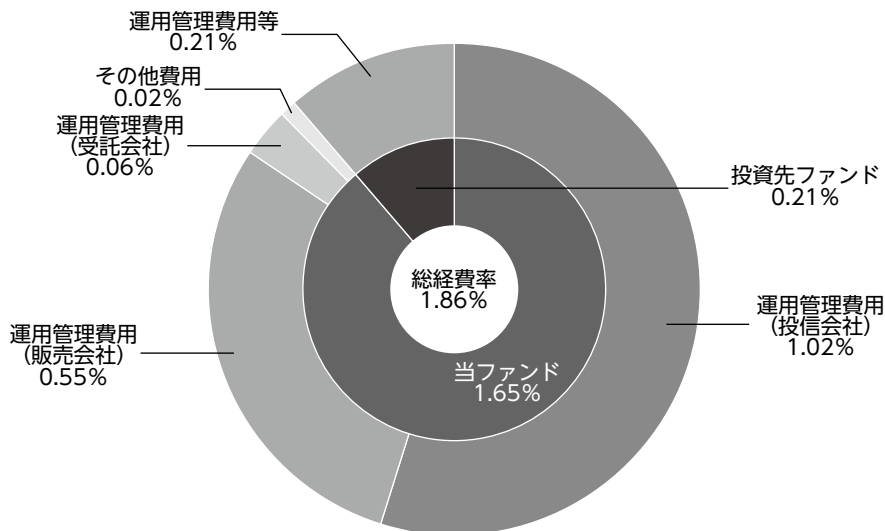
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<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1.86%です。



総経費率(①+②)	1.86%
①当ファンドの費用の比率	1.65%
②投資先ファンドの運用管理費用等の比率	0.21%

(注1)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)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(マザーファンドを除く。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンド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6)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7)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用等の比率には、個々の投資先ファンドに応じて把握可能な場合には、運用管理費用以外の費用も含まれます。

(注9)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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国	ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	千口 —	千円 —	千口 178,764	千円 167,098
	国内株式アクティブバリュウファンド (適格機関投資家専用)	—	—	105,569	124,679
	FOFs用国内株式エンハンスト 運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	—	—	34,308	54,364
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	—	—	3	38,201
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	1	1,660	14	23,120
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)	4,364	7,200	43,268	70,371
	日本長期成長株集中投資ファンド (適格機関投資家専用)	—	—	13,758	30,377
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	—	—	73,212	76,946
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	202,113	199,830	9,393	8,919
	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)	—	—	20,452	25,564
内	FOFs用国内株式EVIバリュウファンド (適格機関投資家専用)	363,119	385,150	8,165	8,705
	MA Hedge Fund Strategies Limited	14	144,480	1	18,000

(注) 金額は受渡代金です。

<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
	千口	千円	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	22,862	49,000	35,435	76,180
グローバルREITインデックス マザーファンド	3,918	10,000	36,228	97,470
中小型株式 マザーファンド	—	—	27,427	139,710
国内株式インデックス マザーファンド	42,925	80,000	141,321	273,630
外国株式インデックス マザーファンド	2,104	9,000	119,643	515,360
JPX日経インデックス400 マザーファンド	—	—	238,093	416,959
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	—	—	137,794	138,860
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	29,994	40,000	13,876	18,000
コモディティLSアルファ・マザーファンド	47,107	50,000	54,134	63,630
日本株式ESGセレクト・リーダーズ インデックスマザーファンド	116,243	125,000	—	—
外国株式ESGリーダーズ インデックスマザーファンド	105,866	122,000	—	—
米国株式LSマザーファンド	18,547	19,000	35,829	37,710
米国株式イントラデイトレンド戦略マザーファンド	18,185	15,310	11,249	10,060

株式売買比率

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<中小型株式 マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	45,091,038千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	26,769,387千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.68

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	121,395,111千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	490,891,429千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.24

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	64,891,535千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	509,031,279千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.12

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<JPX日経インデックス400 マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	27,481,945千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	20,033,099千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.37

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	11,204,622千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	9,771,362千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.14

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	7,886,336千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	9,128,899千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.86

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 738	百万円 592	% 80.2	百万円 646	百万円 567	% 87.8
金 銭 信 託	0.012319	0.012319	100.0	0.012319	0.012319	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	49,354	4,111	8.3	49,286	4,076	8.3

(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。

<J-REIT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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0	百万円 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	782,300	64,466	8.2	782,525	64,087	8.2

<平均保有割合 0.4%>

(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。

<グローバルREIT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 直 物 取 引	百万円 18,206	百万円 73	% 0.4	百万円 27,522	百万円 5	% 0.0
金 銭 信 託	0.001857	0.001857	100.0	0.001857	0.001857	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	45,925	4,408	9.6	45,831	4,384	9.6

<平均保有割合 0.5%>

(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。

<中小型株式 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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.109007	百万円 0.109007	% 100.0	百万円 0.109007	百万円 0.109007	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	342,203	27,358	8.0	344,061	27,241	7.9

<平均保有割合 0.8%>

(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。

<国内株式インデックス 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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.252396	百万円 0.252396	% 100.0	百万円 0.252396	百万円 0.252396	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	657,532	53,940	8.2	663,007	53,733	8.1

<平均保有割合 0.2%>

(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。

<外国株式インデックス 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 直 物 取 引	百万円 59,445	百万円 120	% 0.2	百万円 68,654	百万円 -	% -
金 銭 信 託	0.024758	0.024758	100.0	0.024758	0.024758	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	216,324	18,340	8.5	216,114	18,246	8.4

<平均保有割合 0.3%>

(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。

<JPX日経インデックス400 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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.012557	百万円 0.012557	% 100.0	百万円 0.012557	百万円 0.012557	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	77,072	6,607	8.6	79,168	6,594	8.3

<平均保有割合 1.9%>

(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。

<ピクテ マルチストラテジー リンク 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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.063423	百万円 0.063423	% 100.0	百万円 0.063423	百万円 0.063423	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	272,615	23,695	8.7	273,172	23,617	8.6

<平均保有割合 0.9%>

(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。

<ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)>

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 0.010390	百万円 0.010390	% 100.0	百万円 0.010390	百万円 0.010390	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	36,957	3,396	9.2	36,978	3,390	9.2

<平均保有割合 2.1%>

(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。

<コモディティLSアルファ・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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.006849	百万円 0.006849	% 100.0	百万円 0.006849	百万円 0.006849	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	76,436	7,081	9.3	76,456	7,057	9.2

<平均保有割合 1.6%>

(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。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズ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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	25,992	2,748	10.6	25,904	2,736	10.6

<平均保有割合 1.2%>

(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。

<外国株式ESGリーダーズ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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	8,241	105	1.3	225	0.699512	0.3
金 銭 信 託	0.000148	0.000148	100.0	0.000148	0.000148	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,005	180	9.0	1,999	179	9.0

<平均保有割合 1.2%>

(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。

<米国株式LS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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	249,330	249,330	100.0	246,408	246,408	100.0
為替直物取引	1,294	1,294	100.0	4,341	4,341	100.0
金 銭 信 託	0.039983	0.039983	100.0	0.039983	0.039983	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	204,855	17,262	8.4	204,482	17,120	8.4

<平均保有割合 1.4%>

(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。

<米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.005405	0.005405	100.0	0.005405	0.005405	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	35,040	3,174	9.1	35,165	3,163	9.0

<平均保有割合 1.4%>

(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
投資信託受益証券	一百万円	179百万円	783百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該投資信託受益証券の発行者は、日興アセットマネジメント株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	128百万円	183百万円	1,571百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

<JPX日経インデックス400 マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	5百万円	95百万円	56百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	51百万円	2百万円	58百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

組入資産の明細

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
株式ファンド	千口	千円	%
国内株式アクティブバリュースタートアップファンド(適格機関投資家専用)	414,348	518,764	5.8
FOFs用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	154,585	264,728	3.0
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	20	245,944	2.8
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	149,449	255,573	2.9
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	114,869	249,095	2.8
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	218,945	261,924	2.9
FOFs用国内株式EVIバリュースタートアップファンド(適格機関投資家専用)	354,954	405,215	4.5
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	163	259,601	2.9
その他			
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	359,689	330,914	3.7
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	192,720	179,750	2.0
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	102,653	127,330	1.4
MA Hedge Fund Strategies Limited	25	257,164	2.9
合 計	2,062,427	3,356,008	37.6

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当 期 末		
	当 期 首(前期末)	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	260,548	247,976	504,284
グローバルREITインデックス マザーファンド	214,485	182,175	460,101
中小型株式 マザーファンド	53,149	25,721	124,962
国内株式インデックス マザーファンド	551,200	452,804	903,706
外国株式インデックス マザーファンド	431,357	313,818	1,402,519
JPX日経インデックス400 マザーファンド	238,093	—	—
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	441,623	303,829	306,533
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	501,509	517,627	631,040
コモディティLSアルファ・マザーファンド	290,633	283,606	355,869
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	—	116,243	124,671
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	—	105,866	123,132
米 国 株 式 L S マ ー フ ァ ン ド	284,398	267,116	285,306
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	147,960	154,896	139,158

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

J-REITインデックス マザーファンド	62,078,472千口	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	25,393,569千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	35,000,748千口	コモディティLSアルファ・マザーファンド	19,485,803千口
中小型株式 マザーファンド	4,573,695千口	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	9,766,829千口
国内株式インデックス マザーファンド	258,952,777千口	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	8,916,232千口
外国株式インデックス マザーファンド	121,979,552千口	米国株式LSマザーファンド	18,894,924千口
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	40,079,354千口	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	9,300,432千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 2,839,242	31.6 %
投 資 証 券	516,765	5.7
J-REITインデックス マザーファンド	504,284	5.6
グローバルREITインデックス マザーファンド	460,101	5.1
中 小 型 株 式 マ ザ ー フ ェ ン ド	124,962	1.4
国内株式インデックス マザーファンド	903,706	10.1
外国株式インデックス マザーファンド	1,402,519	15.6
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	306,533	3.4
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	631,040	7.0
コモディティLSアルファ・マザーファンド	355,869	4.0
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	124,671	1.4
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	123,132	1.4
米 国 株 式 L S マ ザ ー フ ェ ン ド	285,306	3.2
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	139,158	1.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	272,630	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	8,989,918	100.0

(注1) グローバルREIT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(88,227,409千円)の投資信託財産総額(88,412,167千円)に対する比率は99.8%です。

(注2) 外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(544,481,432千円)の投資信託財産総額(545,234,847千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)において、当期末における外貨建純資産(32,075,852千円)の投資信託財産総額(32,118,738千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外国株式ESGリーダーズ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(10,363,876千円)の投資信託財産総額(10,370,931千円)に対する比率は99.9%です。

(注5) 米国株式LSマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(19,709,984千円)の投資信託財産総額(20,810,237千円)に対する比率は94.7%です。

(注6) 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=134.40円

1イギリスポンド=160.78円

1ノルウェークローネ=13.07円

1ニュージーランドドル=83.88円

1韓国ウォン=0.104円

1カナダドル=99.76円

1スイスフラン=144.86円

1デンマーククローネ=19.22円

1香港ドル=17.12円

1イスラエルシェケル=37.8693円

1ユーロ=143.20円

1スウェーデンクローナ=12.84円

1オーストラリアドル=92.20円

1シンガポールドル=100.50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 2023年2月17日現在
(A) 資産		8,989,918,765円
	コール・ローン等	272,623,265
	投資信託受益証券(評価額)	2,839,242,976
	投資証券(評価額)	516,765,394
	J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	504,284,371
	グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	460,101,217
	中小型株式 マザーファンド(評価額)	124,962,651
	国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	903,706,237
	外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,402,519,660
	ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド(評価額)	306,533,595
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)(評価額)	631,040,161
	コモディティLSアルファ・マザーファンド(評価額)	355,869,432
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	124,671,316
	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	123,132,864
	米国株式LSマザーファンド(評価額)	285,306,795
	米国株式インタラディ・トレンド戦略マザーファンド(評価額)	139,158,831
(B) 負債		73,641,493
	未払信託報酬	73,393,546
	未払利息	57
	その他未払費用	247,890
(C) 純資産総額(A-B)		8,916,277,272
	元本	6,970,541,061
	次期繰越損益金	1,945,736,211
(D) 受益権総口数		6,970,541,061口
	1万口当たり基準価額(C/D)	12,791円

■ 損益の状況

項 目	当 期
	自 2022年2月18日 至 2023年2月17日
(A) 配当等収益	4,774,830円
受取配当金	4,857,638
受取利息	867
支払利息	△83,675
(B) 有価証券売買損益	303,977,609
売買益	452,506,743
売買損	△148,529,134
(C) 信託報酬等	△149,527,314
(D) 当期損益金 (A+B+C)	159,225,125
(E) 前期繰越損益金	1,840,350,025
(F) 追加信託差損益金	△53,838,939
(配当等相当額)	(174,224,794)
(売買損益相当額)	(△228,063,733)
(G) 計 (D+E+F)	1,945,736,211
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金 (G+H)	1,945,736,211
追加信託差損益金	△53,838,939
(配当等相当額)	(174,271,128)
(売買損益相当額)	(△228,110,067)
分配準備積立金	1,999,575,150

(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7,704,434,536円、期中追加設定元本額は70,367,550円、期中一部解約元本額は804,261,025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)	52,207,361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)	107,017,764円
(C) 収益調整金額	174,271,128円
(D) 分配準備積立金額	1,840,350,025円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	2,173,846,278円
(F) 期末残存口数	6,970,541,061口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	3,118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

投資対象とする投資信託証券を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年5月18日)

投資対象とする投資信託証券を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

投資対象とする投資信託証券を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年11月18日)

組入投資信託証券の内容

■FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	日興アセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	主として、国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資を行い、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行います。
主 要 運 用 対 象	国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

●損益の状況

項 目	第 7 期 自 2021年2月16日 至 2022年2月15日
(A)配 当 等 收 益	△9,982円
受 取 利 息	12
支 払 利 息	△9,994
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	564,369,165
売 買 益	617,078,926
売 買 損	△52,709,761
(C)信 託 報 酬 等	△54,031,164
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	510,328,019
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,961,426,841
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,846,165,573
(配 当 等 相 当 額)	(1,434,019,952)
(売 買 損 益 相 当 額)	(412,145,621)
(G)計 (D+E+F)	5,317,920,433
(H)收 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	5,317,920,433
追 加 信 託 差 損 益 金	1,846,165,573
(配 当 等 相 当 額)	(1,434,580,872)
(売 買 損 益 相 当 額)	(411,584,701)
分 配 準 備 積 立 金	3,471,754,860

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 6 期 末	第 7 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド	9,103,233	9,058,175	14,709,571

下記は、国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第6期末	第7期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
水産・農林業(1%)			
雪国まいたけ	4	—	—
サカタのタネ	0.1	—	—
鉱業(0.7%)			
日鉄鉱業	0.8	—	—
三井松島ホールディングス	—	0.8	1,368
I N P E X	27.8	62.9	74,096
石油資源開発	4.1	5.7	16,148
建設業(4.1%)			
ミライト・ホールディングス	5.9	—	—
タマホーム	7.2	—	—
コムシスホールディングス	2.6	6.5	17,927
東建コーポレーション	—	0.1	926
長谷工コーポレーション	26.1	60.7	91,839
熊谷組	0.1	1.6	4,747
日本ハウスホールディングス	—	24.6	11,340
大東建託	2.8	—	—
N I P P O	1.8	—	—
東亜道路工業	2.1	0.5	2,487
若築建設	—	6.1	11,596
福田組	1.6	—	—
住友林業	14	36.8	83,940
バコーポレーション	—	5.3	2,729
積水ハウス	—	130.4	312,112
ユアテック	—	17.1	12,158
四電工	—	2.3	3,657
関電工	18.9	17.3	15,068
きんでん	22.1	—	—
日本電設工業	—	2.7	4,185
エクシオグループ	3.3	—	—
太平電業	1.1	—	—
食料品(1.3%)			
日本甜菜製糖	6.7	0.7	1,201
森永製菓	—	4.5	16,650
森永乳業	—	3.7	21,090
ヤクルト本社	—	6.1	37,637
明治ホールディングス	4.2	—	—
ブリマハム	3	—	—
S F o o d s	—	5	16,350
柿安本店	—	0.2	514
伊藤ハム米久ホールディングス	6.3	11.4	7,786
宝ホールディングス	—	16.1	18,595
味の素	36.1	—	—

銘柄	第6期末	第7期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アリアケジャパン	—	8.7	49,590
エバラ食品工業	1.9	—	—
ニチレイ	16.3	—	—
東洋水産	16	0.3	1,488
永谷園ホールディングス	—	4.2	8,299
わらべや日洋ホールディングス	1.4	—	—
繊維製品(0.2%)			
富士紡ホールディングス	—	3.1	11,625
倉敷紡績	—	4.8	9,374
帝人	23.7	—	—
アツギ	—	1	596
T S I ホールディングス	12.5	—	—
マツオカコーポレーション	2.9	—	—
ワールド	4.9	3.7	4,610
パルプ・紙(1%)			
中越パルプ工業	2.5	—	—
化学(5.9%)			
住友化学	48	—	—
住友精化	1.1	4.6	15,180
日産化学	—	1.1	7,117
クレハ	1.2	—	—
東ソー	22.2	61.3	113,098
大阪ソーダ	—	0.9	2,839
関東電化工業	—	9	10,161
日本カーバイド工業	1.4	—	—
堺化学工業	—	1.4	2,829
日本パーカラライジング	7.2	—	—
大日精化工業	0.3	—	—
三井化学	8.1	—	—
三菱ケミカルホールディングス	29.5	—	—
K H ネオケム	—	7.1	20,476
住友ベークライト	3.6	—	—
積水化学工業	—	45.5	90,954
日本ゼオン	4.4	15.5	21,250
積水樹脂	3	—	—
旭有機材	—	2.4	5,035
リケンテクノス	7.5	—	—
群栄化学工業	1.2	—	—
ミライアル	—	3.1	4,705
ダイキョーニシカワ	6	—	—
竹本容器	—	4.1	3,218
森六ホールディングス	3.4	—	—
カーリットホールディングス	—	4.2	2,990

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
石原ケミカル	2	—	—	—
ニイタカ	1.4	—	—	—
関西ペイント	8.2	—	—	—
D I C	14.8	—	—	—
富士フイルムホールディングス	—	28.6	215,701	—
高砂香料工業	—	—	—	—
コーセー	—	0.9	11,304	—
コタ	5.2	8.2	12,710	—
小林製薬	1.1	—	—	—
タカラバイオ	2.4	9.1	21,166	—
デクセリアルズ	2	—	—	—
大成ラミック	—	0.5	1,381	—
日東電工	5.5	13.4	114,168	—
三光合成	9.3	—	—	—
藤森工業	0.3	—	—	—
前澤化成工業	1.3	—	—	—
ユニ・チャーム	—	33	141,273	—
ショーエイコーポレーション	13.5	—	—	—
医薬品 (8.2%)				
協和キリン	20.2	31.4	92,221	—
アステラス製薬	90	91.6	180,589	—
塩野義製薬	—	30.9	234,932	—
あすか製薬	0.8	—	—	—
日本新薬	1.8	—	—	—
中外製薬	4.5	82.9	328,366	—
ロート製薬	—	20.9	74,299	—
小野薬品工業	86.8	7.7	22,022	—
持田製薬	1.3	—	—	—
参天製薬	0.5	7.9	10,301	—
扶桑薬品工業	2.1	—	—	—
東和薬品	—	5	15,300	—
大塚ホールディングス	—	33.5	133,933	—
大正製薬ホールディングス	4.7	—	—	—
パプチドリーム	2	26.5	56,392	—
あすか製薬ホールディングス	—	1.7	1,771	—
石油・石炭製品 (0.6%)				
ニチレキ	17.2	—	—	—
富士石油	21.1	—	—	—
出光興産	—	13.8	43,263	—
コスモエネルギーホールディングス	—	18.9	47,098	—
ゴム製品 (0.3%)				
横浜ゴム	—	20.3	33,901	—
ブリヂストン	54.9	—	—	—
住友ゴム工業	57.3	—	—	—
藤倉コンポジット	—	15.1	10,856	—

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
ニッタ	—	0.5	1,400	—
住友理工	4.6	—	—	—
ガラス・土石製品 (1.0%)				
日本山村硝子	—	3.3	2,676	—
日本電気硝子	22.5	6.4	18,336	—
日本コンクリート工業	26.4	—	—	—
ノリタケカンパニーリミテド	—	0.3	1,348	—
日本硝子	11.9	—	—	—
日本特殊陶業	3.7	54	115,776	—
フジインコーポレーテッド	0.6	0.7	4,487	—
クニミネ工業	6.8	—	—	—
鉄鋼 (1.0%)				
日本製鉄	146.4	—	—	—
神戸製鋼所	71.4	37.4	22,178	—
中山製鋼所	20.4	39.5	18,130	—
東京製鐵	—	12.8	14,028	—
大和工業	—	16.7	61,790	—
東京鐵鋼	0.1	—	—	—
淀川製鋼所	0.7	—	—	—
モリ工業	—	2.7	6,758	—
愛知製鋼	1	—	—	—
三菱製鋼	0.3	—	—	—
日本精線	—	0.7	3,090	—
エンビプロ・ホールディングス	—	3.7	4,850	—
新家工業	—	3.2	5,430	—
非鉄金属 (0.8%)				
三井金属鉱業	—	7	23,310	—
東邦亜鉛	0.7	—	—	—
住友金属鉱山	8.1	14.2	79,079	—
古河機械金属	—	1.6	2,078	—
フジクラ	—	1.3	845	—
アールスティ	9.3	—	—	—
金属製品 (0.7%)				
SUMCO	—	27.6	57,546	—
川田テクノロジーズ	—	0.4	1,570	—
信和	6.3	3.1	2,554	—
東洋製罐グループホールディングス	—	7	11,130	—
横浜ブリッジホールディングス	3.1	—	—	—
駒井ハルテック	—	0.2	435	—
三和ホールディングス	14.3	—	—	—
文化シヤッター	—	0.2	212	—
L I X I L	18.9	7.1	17,877	—
ダイニチ工業	5.7	—	—	—
ジーテクト	3.4	—	—	—
東プレ	0.3	—	—	—

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額	評 価 額 (千円)
高周波熱錬	—	4.3	2,571	
立川プラインド工業	3.8	—	—	
三益半導体工業	0.2	—	—	
機械 (5.3%)				
日本ドライケミカル	2.5	—	—	
ツガミ	0.6	—	—	
アマダ	26.6	51.1	52,990	
滝澤鉄工所	—	0.5	603	
F U J I	22.4	—	—	
牧野フライス製作所	1.2	1.4	5,110	
旭ダイヤモンド工業	—	3.2	1,862	
ディスコ	1.1	1.2	39,420	
日東工器	—	3.6	5,835	
日進工具	1.2	—	—	
フリュー	—	1.5	1,588	
やまびこ	2.5	1.3	1,664	
SMC	0.1	2	130,840	
日本エアータック	4.2	—	—	
小松製作所	—	27.6	74,989	
クボタ	16.5	—	—	
荏原実業	0.7	—	—	
帝国電機製作所	4.6	—	—	
新東工業	18.3	—	—	
小森コーポレーション	12.9	4.7	3,304	
住友精密工業	—	4	7,688	
荏原製作所	3.4	—	—	
西島製作所	—	1.4	1,316	
ダイキン工業	10	—	—	
オルガノ	—	0.6	4,620	
椿本チエイン	3.9	5	16,850	
ダイフク	—	1.6	13,744	
SANKYO	—	14.3	45,259	
ダイコク電機	6.9	—	—	
竹内製作所	0.8	2.3	6,072	
ジャノメ	12.2	—	—	
グローリー	—	5	10,665	
大和冷機工業	14.4	10.4	11,720	
日本ピストンリング	—	1.6	2,179	
リケン	—	0.9	2,316	
前澤工業	11.3	—	—	
日本ピラー工業	—	1.3	3,711	
キッツ	—	0.3	204	
マキタ	27.4	—	—	
三菱重工業	—	90.4	295,698	
スター精密	2.7	—	—	

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額	評 価 額 (千円)
電気機器 (14.4%)				
日清紡ホールディングス	77.4	—	—	
コニカミノルタ	40.4	—	—	
ブラザー工業	43.4	16.5	35,442	
ミネベアミツミ	1.1	—	—	
日立製作所	4.9	—	—	
三菱電機	199.8	—	—	
オリジン	—	2.2	2,708	
日本電産	11.7	—	—	
東光高岳	—	7.3	10,519	
ヤーマン	2.8	—	—	
JVCケンウッド	48.9	—	—	
I - P E X	—	8.5	13,268	
日新電機	2.3	—	—	
オムロン	9.1	—	—	
日東工業	1.2	—	—	
メルコホールディングス	0.3	—	—	
テクノメディア	1.3	—	—	
富士通	2.1	—	—	
サンケン電気	—	0.3	1,465	
ワコム	6.5	—	—	
アクセル	—	6.3	6,867	
E I Z O	2.5	—	—	
京三製作所	—	7.5	3,195	
ホーチキ	3.5	—	—	
パナソニック	56.9	—	—	
アンリツ	4.4	—	—	
ソーニグループ	54.1	54.3	663,003	
TDK	1	—	—	
日本電波工業	4	—	—	
鈴木	0.7	—	—	
フォスター電機	0.7	—	—	
ホシデン	8.4	0.7	839	
ヒロセ電機	1.3	3	51,450	
マクセル	0.4	16.4	20,188	
古野電気	6.2	—	—	
ユニデンホールディングス	2.1	—	—	
スミダコーポレーション	4.5	—	—	
リオン	—	1	2,109	
日本光電工業	23	24.4	77,348	
堀場製作所	—	1.2	7,908	
アドバンテスト	4	5.1	46,971	
キーエンス	2.8	0.3	17,277	
シスメックス	—	0.7	6,207	
日本マイクロニクス	—	3.1	4,935	

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
レーザーテック	2.7	—	—	—
岩崎電気	6.6	—	—	—
ウシオ電機	23.9	1.2	2,193	—
遠藤照明	—	1.6	1,604	—
山一電機	—	5.1	10,235	—
日本電子	—	1.2	8,064	—
ファナック	13.6	4.8	109,752	—
ローム	3	2	18,620	—
新光電気工業	2.5	—	—	—
京セラ	2.9	46.4	308,792	—
太陽誘電	1.1	0.9	4,545	—
村田製作所	31.2	21.7	173,513	—
双葉電子工業	0.7	—	—	—
日本ケミコン	0.7	—	—	—
小糸製作所	9	—	—	—
ミツバ	21.1	—	—	—
キャノン電子	3.2	—	—	—
キャノン	83.9	99.4	280,258	—
東京エレクトロン	3.9	2.2	121,484	—
輸送用機器 (11.2%)				
豊田自動織機	6.3	3	27,330	—
モリタホールディングス	2.4	—	—	—
デンソー	16.3	—	—	—
東海理化電機製作所	12.9	—	—	—
日産自動車	294	487	295,316	—
いすゞ自動車	5	—	—	—
トヨタ自動車	22.1	149.6	322,163	—
エフテック	1.7	—	—	—
トビー工業	5.6	—	—	—
ティラド	7.4	—	—	—
NOK	48.4	66.7	81,240	—
フタバ産業	9.7	—	—	—
アイシン	12.3	—	—	—
マツダ	—	29.6	26,936	—
今仙電機製作所	2.7	—	—	—
本田技研工業	127.8	116.5	419,516	—
スズキ	8.6	—	—	—
ヤマハ発動機	47.8	32.8	89,478	—
エクセディ	8.8	2.5	4,207	—
豊田合成	0.4	—	—	—
愛三工業	15.1	—	—	—
ヨロズ	—	8	7,800	—
シマノ	5.4	10.3	290,975	—
精密機器 (3.6%)				
テルモ	—	20.3	76,348	—

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
島津製作所	29.3	10.1	42,167	—
長野計器	—	1.2	1,520	—
ブイ・テクノロジー	0.9	—	—	—
東京精密	2.2	1.7	8,007	—
ニコン	66.7	63	83,727	—
トプコン	9.7	—	—	—
HOYA	23.9	18.9	289,170	—
エー・アンド・デイ	4.9	—	—	—
シチズン時計	—	9.2	4,636	—
その他製品 (0.6%)				
中本ボックス	—	0.1	171	—
パラマウントベッドホールディングス	0.8	0.4	777	—
トランザクシオン	11.9	—	—	—
アートネイチャー	12.8	—	—	—
SHOEI	2.1	1.2	5,364	—
パイロットコーポレーション	—	5.7	26,248	—
フジシールインターナショナル	—	2.5	4,680	—
タカラトミー	—	1.2	1,545	—
大建工業	—	2.3	5,347	—
NISSHA	4.7	4	5,656	—
ヤマハ	6.9	—	—	—
クリナップ	15	8	4,336	—
ピジョン	9.5	—	—	—
任天堂	6.7	—	—	—
三菱鉛筆	—	10.5	13,356	—
タカラスタンダード	—	8.6	11,997	—
グローブライド	1.1	0.1	288	—
オカムラ	6.1	—	—	—
電気・ガス業 (0.9%)				
沖縄電力	—	0.7	988	—
電源開発	28.1	63.5	119,507	—
陸運業 (2.1%)				
東武鉄道	—	6.2	18,197	—
京成電鉄	7.9	—	—	—
東海旅客鉄道	14.8	7.9	125,017	—
ハマキョウレックス	1.2	—	—	—
阪急阪神ホールディングス	—	24.5	86,852	—
南海電気鉄道	—	2.2	5,262	—
名古屋鉄道	5.6	20.7	42,083	—
丸全昭和運輸	—	2.6	8,333	—
福山通運	0.5	—	—	—
SGホールディングス	9.9	3.7	9,161	—
海運業 (1.4%)				
日本郵船	16.7	8	77,280	—
商船三井	12.2	8.3	73,953	—

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
川崎汽船	—	5.2	37,336	
乾汽船	—	0.9	2,503	
空運業(0.5%)				
ANAホールディングス	—	27.9	71,898	
倉庫・運輸関連業(0.4%)				
トランコム	1.6	—	—	
日新	—	2.8	4,754	
三井倉庫ホールディングス	3	1.1	2,579	
住友倉庫	—	1.3	2,740	
ファイズホールディングス	—	0.3	179	
近鉄エクスプレス	—	2.6	8,177	
エーアイティー	—	2.3	3,206	
内外トランスライン	—	10.1	19,563	
日本コンセプト	—	8.4	11,650	
情報・通信業(7.8%)				
クロスキャット	—	0.8	1,284	
システナ	2.7	—	—	
コア	—	0.6	906	
ソフトクリエイトホールディングス	1.1	0.6	2,433	
T I S	—	5.8	15,648	
三菱総合研究所	—	0.7	2,604	
K L a b	1	—	—	
イーブックイニシアティブジャパン	0.8	—	—	
ネクソン	9.2	—	—	
クロス・マーケティンググループ	0.4	—	—	
じげん	—	34	10,404	
オブティム	0.4	—	—	
セレス	2.2	—	—	
S H I F T	—	0.6	12,138	
システムリサーチ	—	2.2	3,902	
インターネットイニシアティブ	2.3	—	—	
フリービット	10.5	—	—	
アステリア	—	10.7	8,132	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	7.6	9,720	
パイブドHD	1.2	—	—	
ネオジャパン	2.1	4.8	4,996	
P R T I M E S	3.2	4.1	11,291	
ダブルスタンダード	0.2	—	—	
ベネフィットジャパン	1.5	—	—	
U b i c o mホールディングス	1.1	—	—	
カナミックネットワーク	4.7	—	—	
ノムラシステムコーポレーション	—	8.1	1,854	
チェンジ	1.8	0.1	158	
シンクロ・フード	—	5.5	1,512	
オロ	—	0.8	1,977	

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
プロトコーポレーション	8.9	—	—	
ハイマックス	1.2	3	3,501	
野村総合研究所	21	13.9	54,696	
インフォコム	1.2	—	—	
システムサポート	—	1.9	1,915	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	1.1	—	—	
トビラシステムズ	1.2	—	—	
ベース	0.2	—	—	
クレスコ	—	4.1	6,920	
オービック	2.6	0.9	16,848	
T D Cソフト	4.5	1.5	1,659	
日本オラクル	3.7	4.3	35,346	
S Bテックノロジー	—	1.4	3,505	
伊藤忠テクノソリューションズ	—	6.3	18,666	
アイティフォー	—	2.4	1,886	
デジタルガレージ	3.4	0.6	2,361	
ビジネスエンジニアリング	0.7	—	—	
日本テレビホールディングス	52.8	58.1	79,422	
朝日放送グループホールディングス	—	4.9	3,704	
スカパーJ SATホールディングス	41.2	0.1	45	
テレビ東京ホールディングス	—	1.5	3,205	
USEN-NEXT HOLDINGS	0.9	—	—	
日本電信電話	11.3	—	—	
K D D I	77	109.6	407,712	
ソフトバンク	81	—	—	
光通信	—	0.4	5,888	
東宝	11.4	—	—	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5	—	—	
カブコン	7	21.3	61,301	
S C S K	0.9	2.9	5,623	
富士ソフト	0.3	—	—	
NSD	2	—	—	
ソフトバンクグループ	21	56.2	289,879	
卸売業(9.5%)				
エレマテック	4.8	—	—	
あらた	1	0.4	1,562	
神戸物産	—	9	33,705	
あい ホールディングス	—	3	5,400	
ダイワボウホールディングス	0.4	—	—	
マクニカ・富士エレホールディングス	3.1	3.9	10,202	
バイタルケアエスケー・ホールディングス	—	12.6	10,256	
ジュエテックホールディングス	—	1.6	1,947	
T O K A Iホールディングス	9.4	—	—	
佐島電機	5.7	—	—	
伯東	3.8	—	—	

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
三菱食品	—	10.6	34,185	—
ドウシシャ	5.9	—	—	—
丸文	—	1.7	1,218	—
日本ライフライン	3.8	—	—	—
I D O M	1.1	—	—	—
エスケイジャパン	—	1.4	589	—
伊藤忠商事	85.2	106.4	403,681	—
丸紅	289.8	273.2	323,059	—
長瀬産業	6.4	—	—	—
豊田通商	2.4	—	—	—
三井物産	65.2	—	—	—
スターゼン	2.5	—	—	—
住友商事	90.1	84.5	157,339	—
三菱商事	7.3	33.7	133,586	—
キャノンマーケティングジャパン	—	19	47,386	—
ユアサ商事	—	9.3	27,565	—
阪和興業	—	6.1	20,404	—
ニチモウ	—	0.3	803	—
アステナホールディングス	5.2	—	—	—
三愛石油	—	4.8	4,492	—
稲畑産業	11.8	—	—	—
G S I クレオス	2.9	—	—	—
サンワテクノス	3.3	5.2	6,983	—
リョーサン	1.1	—	—	—
加賀電子	—	0.5	1,652	—
立花エレテック	—	1.5	2,410	—
西本Wismettaホールディングス	—	1.1	3,099	—
日鉄物産	2.5	—	—	—
イエローハット	0.7	3.8	6,243	—
J Kホールディングス	—	9.7	10,204	—
ミスミグループ本社	—	21.5	76,002	—
小売業 (3.5%)				
アダストリア	1.2	—	—	—
パルグループホールディングス	—	1.3	2,124	—
エディオン	18.5	—	—	—
大黒天物産	0.8	—	—	—
アルベン	1.5	—	—	—
クオールホールディングス	2.3	—	—	—
ジンズホールディングス	0.3	—	—	—
D C Mホールディングス	—	6.2	6,888	—
M o n o t a R O	14.4	—	—	—
J・フロント リテイリング	—	3.3	3,554	—
マツキョココカラ&カンパニー	5.4	—	—	—
Z O Z O	25.3	13.3	42,360	—
H a m e e	1.1	3.1	3,317	—

銘柄	第 6 期 末		第 7 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
クリエイトSDホールディングス	0.8	—	—	—
ミサワ	5.4	7.1	4,615	—
シュッピン	5	17	19,720	—
オイシックス・ラ・大地	1	—	—	—
ジョイフル本田	—	3.5	5,453	—
ヨシックスホールディングス	—	0.1	218	—
日本調剤	0.6	—	—	—
コスモス薬品	4.1	—	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	38.9	31.1	181,375	—
ツルハホールディングス	1.5	—	—	—
フェリシモ	3.6	—	—	—
トリドールホールディングス	—	0.5	1,324	—
J Mホールディングス	0.6	—	—	—
串カツ田中ホールディングス	—	0.1	210	—
パロックジャパンリミテッド	—	2.1	1,856	—
クスリのアオキホールディングス	—	0.1	700	—
メディカルシステムネットワーク	4.3	—	—	—
ノジマ	1.7	—	—	—
三城ホールディングス	0.7	—	—	—
G-7ホールディングス	5.8	—	—	—
コーナン商事	0.6	0.6	2,187	—
エコス	—	4.3	8,707	—
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	24.6	61.8	117,729	—
西松屋チェーン	3.6	—	—	—
薬王堂ホールディングス	1	—	—	—
上新電機	2.4	—	—	—
ライフコーポレーション	—	2	6,120	—
M r M a x H D	6.3	—	—	—
コメリ	—	3.7	10,245	—
青山商事	—	2.1	1,564	—
高島屋	—	27.8	32,248	—
エイチ・ツー・オー リテイリング	—	7.9	7,062	—
アクシアル リテイリング	0.6	—	—	—
ケーズホールディングス	63.5	—	—	—
日産東京販売ホールディングス	—	12.9	3,018	—
ナルミヤ・インターナショナル	3.4	—	—	—
ギフト	—	6.6	15,562	—
ニトリホールディングス	7.3	—	—	—
パローホールディングス	2	1.9	4,288	—
サンドラッグ	5.7	1.4	4,382	—
やまや	—	2.3	5,823	—
ベルーナ	0.7	—	—	—
銀行業 (6.3%)				
じもとホールディングス	—	5.6	3,841	—
めぶきフィナンシャルグループ	44.5	—	—	—

銘柄	第6期末		第7期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
東京さくらばフィナンシャルグループ	—	9.7	19,186	
ゆうちょ銀行	19.1	3.4	3,590	
富山第一銀行	—	22.6	7,209	
西日本フィナンシャルホールディングス	35.5	—	—	
第四北越フィナンシャルグループ	—	2.9	7,992	
あおぞら銀行	—	24	64,296	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	334.2	245,336	
りそなホールディングス	458.7	—	—	
三井住友フィナンシャルグループ	—	83.4	359,454	
群馬銀行	39.2	111.2	44,702	
七十七銀行	24.9	—	—	
十六銀行	10.7	—	—	
八十二銀行	90.8	237.4	105,168	
滋賀銀行	—	2	4,522	
南都銀行	8.1	0.6	1,285	
百五銀行	84.5	—	—	
山口フィナンシャルグループ	—	1.3	959	
京葉銀行	12.3	—	—	
北日本銀行	—	2.1	3,639	
フィデアホールディングス	95.6	—	—	
池田泉州ホールディングス	—	83.8	16,089	
証券・商品先物取引業(2.6%)				
マーキュリアインベストメント	2.2	—	—	
SBIホールディングス	—	29	89,465	
野村ホールディングス	510.3	478	258,263	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	42.7	19.4	7,934	
極東証券	6.1	—	—	
岩井コスモホールディングス	1.8	5.6	7,761	
保険業(0.6%)				
SOMPOホールディングス	—	15.2	81,152	
第一生命ホールディングス	122.9	—	—	
その他金融業(0.2%)				
全国保証	6.7	—	—	
ジェイリース	—	0.1	186	
アルヒ	0.3	—	—	
クレディセゾン	—	9.6	13,104	
芙蓉総合リース	1.7	—	—	
みずほリース	—	3.2	10,448	
ジャックス	1.8	3	9,735	
三菱HCキャピタル	179	—	—	
不動産業(0.4%)				
サムティ	0.8	—	—	
飯田グループホールディングス	19.4	11	24,695	
シーアールイー	—	2.3	3,891	
ケイアイスター不動産	1.9	—	—	

銘柄	第6期末		第7期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
三井不動産	6.6	—	—	
東京建物	—	0.6	1,068	
住友不動産	5.1	—	—	
スターツコーポレーション	—	2.1	5,346	
フジ住宅	12	—	—	
ゴールドクレスト	1.6	7.2	13,428	
日神グループホールディングス	3.3	—	—	
ファースト住建	—	3.3	3,768	
カチタス	1.4	—	—	
グランディハウス	—	0.4	232	
サービス業(3.9%)				
ジェイエイシーリクルートメント	—	3.9	7,620	
日本M&Aセンターホールディングス	8.4	20.2	35,552	
メンバーズ	0.6	—	—	
UTグループ	1.6	0.1	350	
アイティメディア	5.3	7.3	11,555	
タケエイ	1.7	—	—	
パーソルホールディングス	—	10.6	28,376	
スタジオアリス	3	—	—	
NJS	3.1	—	—	
セントケア・ホールディング	0.2	—	—	
ツクイホールディングス	4.2	—	—	
ベネフィット・ワン	—	1.5	3,934	
エムスリー	3	—	—	
アウトソーシング	3.8	—	—	
ディー・エヌ・エー	21	—	—	
エスプール	5.3	—	—	
WDBホールディングス	—	1.9	5,266	
バリューコマース	1	—	—	
JPHホールディングス	—	49.4	11,510	
EPSホールディングス	4.1	—	—	
アミューズ	1.9	—	—	
H. U. グループホールディングス	33	12.1	36,239	
オリエンタルランド	—	2.4	52,392	
ダスキン	10.6	12.5	34,462	
ビー・エム・エル	—	5	17,775	
りらいあコミュニケーションズ	—	0.8	859	
ユー・エス・エス	30.8	—	—	
サイバーエージェント	—	34.6	52,661	
エン・ジャパン	0.9	1.3	3,737	
テクノプロ・ホールディングス	5	—	—	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.3	—	—	
チャーム・ケア・コーポレーション	0.6	—	—	
キャリアリンク	2.5	4.7	7,332	
N・フィールド	2.8	—	—	

銘柄	第6期末	第7期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
ライオンエクスプレスホールディングス	6.1	2.1	2,887
ERIホールディングス	—	11.4	12,847
シグマクス・ホールディングス	1.5	—	—
ウィルグループ	8.8	2	2,428
リクルートホールディングス	5.5	17.4	87,800
日本郵政	—	34.6	33,942
ベルシステム24ホールディングス	1.9	—	—
LITALICO	0.1	—	—
グローバルキッズCOMPANY	0.1	—	—
ソラスト	4.8	—	—
セラク	2.5	—	—
インソース	0.4	—	—
ベイクレント・コンサルティング	0.7	1.7	69,020
ジャパンエレベーターサービスホールディング	0.2	—	—
ウェルビー	—	4.9	5,659
日総工産	11.9	—	—
スプリックス	—	0.5	749
テノ.ホールディングス	0.9	—	—
ピアラ	0.3	—	—
Fast Fitness Japan	—	0.1	192
ダイレクトマーケティングミックス	0.6	—	—
建設技術研究所	3.3	3.3	7,656
燦ホールディングス	1.5	—	—
東京都競馬	1.8	—	—
トランス・コスモス	—	2.8	8,918
トーカイ	1.5	—	—
セコム	7.8	—	—
いであ	2	—	—
学究社	4.3	5.4	8,677
ステップ	0.4	—	—
合計	株数・金額 6,651	6,241	13,964,441
	銘柄数<比率>	415	345 <91.0%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >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	第7期末	
	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
国内 TOPIX先物	1,243	—

組入投資信託証券の内容

■国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用方針	主として、アクティブバリュー マザーファンド受益証券に投資を行い、長期的な観点からわが国の株式市場全体(TOPIX(東証株価指数))の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。
主要運用対象	アクティブバリュー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
組入制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。

●損益の状況

項目	第 4 期 自 2021年10月26日 至 2022年10月25日
(A)配当等収益	△37,073円
受取利息	113
支払利息	△37,186
(B)有価証券売買損益	1,065,449,678
売買利益	1,186,798,152
売買損	△121,348,474
(C)信託報酬等	△182,799,538
(D)当期損益金(A+B+C)	882,613,067
(E)前期繰越損益金	6,667,828,460
(F)追加信託差損益金	△1,460,547,359
(配当等相当額)	(1,557,676,102)
(売買損益相当額)	(△3,018,223,461)
(G)計(D+E+F)	6,089,894,168
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,089,894,168
追加信託差損益金	△1,460,547,359
(配当等相当額)	(1,559,500,924)
(売買損益相当額)	(△3,020,048,283)
分配準備積立金	7,550,441,527

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 3 期 末	第 4 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
アクティブバリュー マザーファンド	8,098,732	6,739,222	33,202,799

下記は、アクティブバリュー マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第3期末	第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
建設業(3.1%)			
ミライト・ワン	178.1	—	—
コムシスホールディングス	64.1	—	—
熊谷組	106.9	183.7	460,719
大和ハウス工業	—	208.6	621,523
日揮ホールディングス	301	156.6	271,701
食料品(0.9%)			
アサヒグループホールディングス	166.4	76.6	326,699
アリアケジャパン	—	14.5	73,370
パルプ・紙(1.8%)			
レンゴー	—	918.9	763,605
化学(9.2%)			
クレハ	57.9	27.5	255,475
エア・ウォーター	531.7	493.2	810,820
カネカ	134	52.4	193,618
三菱瓦斯化学	336.9	159.2	302,161
三菱ケミカルグループ	417.8	—	—
KHネオケム	124.7	315.7	866,912
富士フィルムホールディングス	34.4	79	547,391
ライオン	—	576.8	864,046
JSP	99.8	84.8	123,808
医薬品(4.1%)			
小野薬品工業	299	263	909,191
参天製薬	265.9	206.1	201,153
ツムラ	156.1	144.6	443,922
鳥居薬品	81.6	68.6	201,478
石油・石炭製品(1.6%)			
ENEOSホールディングス	546.6	1,359.7	669,924
ガラス・土石製品(1.9%)			
AGC	194.9	115.8	534,417
東洋炭素	90.4	77	273,350
日本碍子	90.8	—	—
鉄鋼(—%)			
日本製鉄	182.6	—	—
非鉄金属(1.6%)			
三井金属鉱業	20.9	—	—
住友金属鉱山	132.7	89.3	376,131
古河電気工業	35.3	—	—
住友電気工業	163.6	194.9	303,264
タツタ電線	186.7	—	—
金属製品(0.7%)			
SUMCO	416.8	150.9	283,390
機械(8.6%)			
芝浦機械	348.2	215.6	620,281

銘柄	第3期末	第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アマダ	488.6	—	—
ナブテスコ	—	145.7	460,412
小松製作所	35.3	100.1	275,325
ダイキン工業	18.2	20.9	457,814
オルガノ	97.4	102.4	251,699
タダノ	—	260.1	237,471
アマノ	123.7	229.9	583,256
THK	138.3	131.1	334,960
IHI	146.4	137.8	459,563
電気機器(13.8%)			
日立製作所	239.1	210.8	1,385,166
三菱電機	166.2	—	—
富士電機	168.4	153.6	835,584
マブチモーター	211.8	211.6	846,400
パナソニックホールディングス	201.9	—	—
アンリツ	268.6	120.8	197,024
ソニーグループ	106.8	111.9	1,095,612
TDK	211	108.6	505,533
日本光電工業	42.4	47	157,685
村田製作所	71	59.1	425,520
市光工業	658	680.5	270,158
SCREENホールディングス	62.4	25.4	207,264
輸送用機器(7.7%)			
デンソー	48.2	—	—
トヨタ自動車	829.2	744.4	1,500,710
NOK	674.7	233.6	263,734
太平洋工業	180.1	257.1	271,497
本田技研工業	284.2	380.3	1,266,399
スズキ	35	—	—
エフ・シー・シー	135.4	—	—
精密機器(2.6%)			
テルモ	—	78.4	347,155
トプコン	176	—	—
オリンパス	319	249.4	749,945
その他製品(0.3%)			
タカラトミー	133	110.6	138,692
任天堂	8.3	—	—
電気・ガス業(0.6%)			
中部電力	374	229.2	277,332
大阪瓦斯	11.7	—	—
陸運業(2.9%)			
東日本旅客鉄道	69.7	66.4	528,544
東海旅客鉄道	35.2	—	—
ヤマトホールディングス	98.1	243.3	529,664

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
セイノーホールディングス	195.7	167.2	190,273	
空運業(1.1%)				
日本航空	151.2	177	494,538	
倉庫・運輸関連業(1.4%)				
上組	248.9	212.1	598,334	
近鉄エクスプレス	131.9	—	—	
情報・通信業(8.0%)				
NECネットエスアイ	550.3	512.3	829,926	
ネクソン	279.8	74.5	184,760	
大塚商会	133.9	—	—	
BIPROGY	45	229	740,815	
日本電信電話	211.9	237.4	966,930	
エヌ・ティ・ティ・データ	136.1	—	—	
ソフトバンクグループ	194.9	124.4	740,055	
卸売業(4.8%)				
伊藤忠商事	248.1	237	926,196	
三菱商事	250.3	216.8	894,300	
岩谷産業	54.7	42.6	229,614	
小売業(4.1%)				
エービーシー・マート	105.6	—	—	
くら寿司	163.6	124.4	410,520	
セリア	43.1	—	—	
J.フロントリテイリング	472.5	371.4	436,395	
ウエルシアホールディングス	113.8	70	209,860	
バン・パシフィック・インターナショナルホ	123.2	144.5	344,632	
日本瓦斯	246.8	83.2	175,302	
ライフコーポレーション	—	84.6	188,488	
銀行業(4.4%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,270.7	1,565.7	1,111,803	
三井住友フィナンシャルグループ	144.6	190.4	801,964	
証券・商品先物取引業(1.5%)				
SBIホールディングス	105.1	82.3	217,436	
ジャフコグループ	—	185.1	432,393	
保険業(1.9%)				
SOMPOホールディングス	44.1	59.1	363,287	
第一生命ホールディングス	193.7	199.8	470,029	
東京海上ホールディングス	52.5	—	—	
その他金融業(2.7%)				
アルヒ	515	68.9	97,080	
東京センチュリー	—	112.2	547,536	
イオンフィナンシャルサービス	433.7	359.9	512,497	
オリックス	96.1	—	—	
不動産業(3.5%)				
東急不動産ホールディングス	724.5	1,264	950,528	
三井不動産	193.2	199.3	554,851	

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
サービス業(5.2%)				
ジェイエイシーリクルートメント	—	230.6	555,054	
セブテーニ・ホールディングス	—	1,239.6	570,216	
りらいあコミュニケーションズ	161.1	220.6	218,614	
リクルートホールディングス	71	50.2	226,301	
ダイセキ	116.1	152.6	687,463	
合計				
株数・金額	20,855	20,971	43,036,480	
銘柄数<比率>	99	86	<97.0%>	

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用方針	信託財産は、日本長期成長株集中投資マザーファンドを通じて主として日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。
主要運用対象	日本長期成長株集中投資マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
組入制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

●損益の状況

項目	第 16 期 自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日
(A)有価証券売買損益	16,223,742,528円
売 買 益	16,436,581,811
売 買 損	△212,839,283
(B)信託報酬等	△426,685,679
(C)当期損益金(A+B)	15,797,056,849
(D)前期繰越損益金	△5,525,733,303
(E)追加信託差損益金	65,254,568,741
(配当等相当額)	(44,652,900,974)
(売買損益相当額)	(20,601,667,767)
(F)計(C+D+E)	75,525,892,287
(G)収益分配金	△1,221,447,921
次期繰越損益金(F+G)	74,304,444,366
追加信託差損益金	65,254,568,741
(配当等相当額)	(44,757,083,849)
(売買損益相当額)	(20,497,484,892)
分配準備積立金	16,725,307,049
繰越損益金	△7,675,431,424

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 15 期 末	第 16 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本長期成長株集中投資マザーファンド	22,882,804	25,662,990	137,024,974

下記は、日本長期成長株集中投資マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第15期末	第16期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
食料品(5.0%)			
味の素	3,310.4	2,552.4	11,470,485
化学(6.4%)			
信越化学工業	736.7	384.6	6,818,958
ユニ・チャーム	1,387.4	1,516.8	7,935,897
医薬品(5.2%)			
協和キリン	1,914.5	2,207.2	6,842,320
第一三共	1,054.9	1,141.4	5,143,148
機械(5.4%)			
SMC	112.2	81.3	5,004,828
ダイキン工業	65.8	120	2,704,200
栗田工業	1,040.7	827.6	4,866,288
電気機器(24.2%)			
イビデン	1,197.5	1,475.3	8,025,632
富士電機	1,116.6	1,352	7,463,040
日本電産	1,078.4	608.7	4,898,817
ソニーグループ	1,182.2	1,211.8	13,384,331
アドバンテスト	1,093.2	1,120.6	11,026,704
キーエンス	69	101.5	5,718,510
浜松ホトニクス	528.3	773.8	5,463,028
太陽誘電	820.6	—	—
精密機器(11.3%)			
テルモ	—	745.6	3,002,531
オリンパス	4,350.2	4,469.2	11,812,095
H O Y A	934	635.5	8,957,372
朝日インテック	1,148.5	915.7	2,235,223
その他製品(4.3%)			
アシックス	2,723.7	3,223.7	9,912,877
情報・通信業(18.3%)			
S H I F T	230.2	318.3	8,941,047
野村総合研究所	1,589.5	2,234.9	7,241,076
オービック	122.4	173.4	3,611,922
エス・ティ・ティ・データ	4,228.9	5,232.4	10,783,976
カブコン	—	1,931.7	8,354,602
ソフトバンクグループ	705.1	549.5	3,456,904
小売業(4.3%)			
ニトリホールディングス	577.2	632.2	10,007,726
ファーストリテイリング	22.6	—	—
保険業(4.7%)			
東京海上ホールディングス	1,266.2	3,826	10,846,710
その他金融業(4.7%)			
オリックス	4,164.2	4,788.6	10,752,801

銘柄	第15期末	第16期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
サービス業(6.2%)			
リクルートホールディングス	1,503.6	2,161.9	9,341,569
ペイカレント・コンサルティング	93.6	961	4,939,540
合計	株数・金額 株数<比率>	40,368 48,274	230,964,164 <96.7%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■FOFs用国内株式EVIバリュートファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	日本株EVIハイアルファマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュート指標(PBR、PER、配当利回り)等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。
主 要 運 用 対 象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

●損益の状況

項 目	第 1 期 自 2022年3月17日 至 2022年6月 6日
(A)配 当 等 収 益	△114円
支 払 利 息	△114
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	853,968,074
売 買 益	853,951,578
売 買 損	16,496
(C)信 託 報 酬 等	△14,476,641
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	839,491,319
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	586,675,158
(配 当 等 相 当 額)	(△1)
(売 買 損 益 相 当 額)	(586,675,159)
(F)合 計(D+E)	1,426,166,477
次 期 繰 越 損 益 金(F)	1,426,166,477
追 加 信 託 差 損 益 金	586,675,158
(配 当 等 相 当 額)	(71,549,078)
(売 買 損 益 相 当 額)	(515,126,080)
分 配 準 備 積 立 金	839,491,319

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	
	口 数	評 価 額
日本株EVIハイアルファマザーファンド	千口 4,625,941	千円 17,849,659

下記は、日本株EVIハイアルファマザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	2021年6月7日時点		2022年6月6日時点	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
鉱業(1.1%)				
INPEX	—	396	641,916	
建設業(4.6%)				
清水建設	540.9	—	—	
長谷工コーポレーション	—	611	947,050	
鹿島建設	—	893	1,287,706	
西松建設	—	117	504,270	
東亜建設工業	159.3	—	—	
住友林業	283.5	—	—	
食料品(4.8%)				
森永乳業	216	—	—	
日本ハム	—	477	1,905,615	
東洋水産	—	195	937,950	
繊維製品(1.7%)				
東レ	881.3	1,460.3	996,362	
ワコールホールディングス	204.6	—	—	
化学(4.7%)				
住友化学	1,945.6	—	—	
信越化学工業	—	85	1,565,700	
三菱瓦斯化学	268.8	573	1,223,928	
東洋インキSCホールディングス	181	—	—	
医薬品(0.5%)				
鳥居薬品	80.9	108	322,920	
ガラス・土石製品(2.9%)				
日本特殊陶業	—	486	1,229,580	
ニチアス	165.8	211	479,181	
鉄鋼(4.4%)				
日本製鉄	—	697	1,553,961	
ジェイエフイーホールディングス	457.8	—	—	
東京製鐵	538.2	654	1,052,286	
大同特殊鋼	147.9	—	—	
非鉄金属(2.1%)				
三井金属鉱業	146.7	—	—	
フジクラ	—	1,527	1,227,708	
金属製品(1.0%)				
日本発条	—	614	569,792	
機械(5.8%)				
アマダ	—	601	636,459	
住友重機械工業	233.6	—	—	
荏原製作所	165.5	161	906,430	
セガサミーホールディングス	284.8	413	949,487	
IHI	149.4	246	971,700	

銘柄	2021年6月7日時点		2022年6月6日時点	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
電気機器(17.3%)				
日立製作所	—	282	1,938,468	
東芝	191.8	200	1,148,400	
明電舎	196.1	—	—	
日本電気	—	238.9	1,249,447	
富士通	65.2	—	—	
ルネサスエレクトロニクス	—	895	1,363,980	
パナソニックホールディングス	405.2	—	—	
TDK	—	276	1,280,640	
アルプスアルパイン	—	871	1,268,176	
メイコー	131	—	—	
京セラ	—	110	822,910	
キヤノン	204.9	375	1,249,125	
輸送用機器(9.7%)				
トヨタ紡織	—	456	979,032	
いすゞ自動車	—	1,560	2,527,200	
トヨタ自動車	176.4	—	—	
三菱自動車工業	2,219.3	2,314	937,170	
KYB	152.9	—	—	
アイシン	141.4	—	—	
本田技研工業	158.2	—	—	
SUBARU	—	571	1,349,273	
精密機器(3.2%)				
ニコン	—	613	1,021,871	
シチズン時計	—	1,611	913,437	
セイコーホールディングス	228	—	—	
その他製品(1.6%)				
トッパン・フォームズ	192.9	—	—	
凸版印刷	567.9	391	951,694	
リントック	181.4	—	—	
オカムラ	347.9	—	—	
陸運業(—)				
日本通運	109.9	—	—	
海運業(2.2%)				
日本郵船	193.9	—	—	
川崎汽船	—	123	1,316,100	
情報・通信業(8.4%)				
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	142	—	—	
アカツキ	—	81	230,121	
日本電信電話	675.7	1,211	4,755,597	
卸売業(7.4%)				
マクニカ・富士エレホールディングス	190.2	90	265,590	

銘柄	2021年6月7日時点		2022年6月6日時点	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
丸紅	910.4	615	863,460	
三井物産	414.9	—	—	
三菱商事	—	726	3,293,862	
小売業(2.4%)				
J・フロント リテイリング	891.7	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	279.6	—	—	
しまむら	—	104	1,150,240	
イズミ	128.4	—	—	
ヤマダホールディングス	1,432.1	—	—	
アークランドサカモト	—	192	294,528	
銀行業(5.2%)				
めぶきフィナンシャルグループ	—	3,144	782,856	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	3,147	2,325,003	
りそなホールディングス	4,045.3	—	—	
証券、商品先物取引業(-)				
野村ホールディングス	1,131.8	—	—	
保険業(1.5%)				
MS&ADインシュアランス グループホールディングス	390	—	—	
第一生命ホールディングス	238.6	334	901,633	
その他金融業(2.6%)				
オリックス	—	641	1,577,821	
不動産業(2.0%)				
ビューリック	—	1,096	1,192,448	
サービス業(2.9%)				
日本郵政	—	1,775	1,701,337	
合計	株数・金額 23,786.6	株数・金額 34,568.2	株数・金額 59,561,422	
	銘柄数<比率> 50	銘柄数<比率> 49	銘柄数<比率> <98.8%>	

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運 用 方 針	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産(特許、著作権、ブランド等)を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。
主 要 運 用 対 象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢの受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

●損益の状況

項 目	第 2 期 自 2021年4月16日 至 2022年4月15日
(A)配 当 等 収 益	△1円
支 払 利 息	△1
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,593,711,689
売 買 益	3,089,262,293
売 買 損	△495,550,604
(C)信 託 報 酬 等	△131,616,105
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,462,095,583
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,330,033,075
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,187,455,914
(配 当 等 相 当 額)	(103,243,674)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,084,212,240)
(G)計 (D+E+F)	5,979,584,572
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	5,979,584,572
追 加 信 託 差 損 益 金	1,187,455,914
(配 当 等 相 当 額)	(103,804,793)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,083,651,121)
分 配 準 備 積 立 金	4,792,128,658

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	第 2 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ	千口 11,494,482	千口 8,677,023	千円 14,818,619

下記は、グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	第 2 期 末		業 種
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ABBOTT LABORATORIES	502	431	5,079	641,881	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL	756	626	4,786	604,930	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON AND CO	209	159	4,343	548,903	ヘルスケア機器・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	94	1,446	182,789	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA CO	504	354	2,301	290,891	食品・飲料・タバコ
DANAHER CORP	255	204	5,672	716,805	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EQUIFAX INC	—	35	757	95,703	商業・専門サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	27	—	—	—	各種金融
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	263	260	2,666	337,013	ソフトウェア・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	343	355	4,424	559,067	各種金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	—	59	1,572	198,771	家庭用品・パーソナル用品
MOODY'S CORPORATION	52	40	1,322	167,078	各種金融
NIKE INC-CL B	120	135	1,812	229,081	耐久消費財・アパレル
OTIS WORLDWIDE CORP	—	222	1,661	209,931	資本財
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,348	1,035	10,539	1,331,890	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	494	265	4,208	531,821	家庭用品・パーソナル用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	73	56	2,592	327,573	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	125	96	5,486	693,325	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	358	308	6,554	828,247	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	113	72	1,350	170,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC-CL A	262	165	5,282	667,581	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	—	11	277	35,031	ヘルスケア機器・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	332	184	4,221	533,430	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	548	359	10,054	1,270,596	ソフトウェア・サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,693 19	5,533 23	88,414 —	11,172,954 <75.4%>
(ドイツ)			千ユーロ		
SAP SE	505	471	4,585	626,053	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	505 1	471 1	4,585 —	626,053 <4.2%>
(フランス)					
LOREAL	92	57	2,084	284,544	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	34	35	2,250	307,312	耐久消費財・アパレル
PERNOD-RICARD	182	108	2,141	292,325	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	309 3	201 3	6,476 —	884,183 <6.0%>
(オランダ)					
HEINEKEN NV	300	230	2,076	283,454	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	651	436	460	62,871	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	951 2	666 2	2,536 —	346,325 <2.3%>

銘柄		第1期末 株数 (百株)	第2期末 株数 (百株)	評価額		業種
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(その他)						
RELX PLC		273	192	568	77,612	商業・専門サービス
国小計	株数・金額 銘柄数<比率>	273	192	568	77,612	
		1	1	—	<0.5%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,040	1,533	14,166	1,934,175	
		7	7	—	<13.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		905	—	—	—	食品・飲料・タバコ
EXPERIAN PLC		461	307	841	138,902	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		1,263	969	5,873	969,144	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		1,041	734	1,791	295,655	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,671	2,012	8,507	1,403,702	
		4	3	—	<9.5%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,405	9,078	—	14,510,831	
		30	33	—	<97.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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。

組入投資信託証券の内容

■ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運用方針	主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要運用対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
組入制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 投資信託証券(マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●損益の状況

項目	第 1 期 自 2021年9月24日 至 2022年9月15日
(A)有価証券売買損益	1,164,526,125円
売 買 益	1,301,917,281
売 買 損	△137,391,156
(B)信託報酬等	△94,527,888
(C)当期損益金(A+B)	1,069,998,237
(D)追加信託差損益金	311,791,759
(売買損益相当額)	(311,791,759)
(E)計(C+D)	1,381,789,996
(F)収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	1,381,789,996
追加信託差損益金	311,791,759
(配当等相当額)	(20,861,166)
(売買損益相当額)	(290,930,593)
分配準備積立金	1,069,998,237

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	
	口 数	評 価 額
ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド	千口 14,312,328	千円 15,790,792

下記は、ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第 1 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
食料品 (8.1%)		
森永製菓	30.1	115,433
医薬品 (14.8%)		
小野薬品工業	63.5	211,455
金属製品 (11.8%)		
三和ホールディングス	124.6	168,833
電気機器 (28.3%)		
村田製作所	30.6	228,276
小糸製作所	37.4	174,471
輸送用機器 (19.1%)		
ヤマハ発動機	93.8	272,020
倉庫・運輸関連業 (11.0%)		
上組	57.5	156,860
小売業 (6.9%)		
イズミ	32.5	98,475
合 計	株 数 ・ 金 額 470	1,425,823
	銘 柄 数 < 比 率 > 8	< 8.8% >

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国株式>

銘柄	第 1 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)		千ドル		
ALASKA AIR GROUP INC	255	1,171	167,991	運輸
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	343	3,056	438,149	小売
BAIDU INC - SPON ADR	187	2,417	346,454	メディア・娯楽
BANCO DE CHILE-ADR	677	1,288	184,704	銀行
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49	1,367	195,991	各種金融
BOOKING HOLDINGS INC	6	1,198	171,740	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	231	1,627	233,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	261	2,646	379,305	ヘルスケア機器・サービス
CITIGROUP INC	274	1,328	190,417	銀行
CONOCOPHILLIPS	78	924	132,533	エネルギー
CROWN HOLDINGS INC	125	1,215	174,193	素材

銘柄	第 1 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	評 価 額			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
DR HORTON INC	171	1,182	169,502	耐久消費財・アパレル	
WALT DISNEY CO/THE	156	1,758	252,109	メディア・娯楽	
META PLATFORMS INC-A	117	1,772	254,027	メディア・娯楽	
FEDEX CORP	94	1,930	276,729	運輸	
GENERAL MOTORS CO	304	1,237	177,410	自動車・自動車部品	
GLOBAL PAYMENTS INC	224	2,972	426,140	ソフトウェア・サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	79	924	132,507	銀行	
NETEASE INC-ADR	193	1,652	236,849	メディア・娯楽	
NEWMONT CORP	275	1,180	169,223	素材	
PFIZER INC	118	544	78,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PULTEGROUP INC	197	766	109,873	耐久消費財・アパレル	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	121	1,586	227,378	保険	
SCHWAB (CHARLES) CORP	282	2,055	294,621	各種金融	
T-MOBILE US INC	156	2,218	318,000	電気通信サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	195	1,557	223,276	半導体・半導体製造装置	
TERADYNE INC	165	1,387	198,824	半導体・半導体製造装置	
VIATRIS INC	885	834	119,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WAYFAIR INC- CLASS A	217	1,086	155,741	小売	
WELLS FARGO & CO	567	2,456	352,056	銀行	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	82	954	136,826	ヘルスケア機器・サービス	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	186	1,187	170,165	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	79	1,205	172,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDTRONIC PLC	200	1,820	260,906	ヘルスケア機器・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	80	1,670	239,418	保険	
AERCAP HOLDINGS NV	308	1,449	207,719	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,949	55,634	7,974,651	
	銘柄 数 <比 率>	36	—	<49.4%>	
(カナダ)			千カナダドル		
BARRICK GOLD CORP	563	1,156	125,841	素材	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	138	1,026	111,726	エネルギー	
MTY FOOD GROUP INC	355	2,170	236,294	消費者サービス	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	1,310	1,277	139,060	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,367	5,630	612,922	
	銘柄 数 <比 率>	4	—	<3.8%>	
(メキシコ)			千メキシカンペソ		
QUALITAS CONTROLADORA SAB CV	2,435	20,797	149,316	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,435	20,797	149,316	
	銘柄 数 <比 率>	1	—	<0.9%>	

銘 柄		第 1 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		1,982	5,291	146,666	銀行
SENDAS DISTRIBUIDORA SA		3,943	7,247	200,857	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	5,925	12,539	347,523	
	銘 柄 数 <比 率>	2	—	<2.2%>	
(ドイツ)			千ユーロ		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,442	2,751	393,315	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額	1,442	2,751	393,315	
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<2.4%>	
(フランス)					
SEB SA		95	676	96,768	耐久消費財・アパレル
KERING		36	1,902	272,000	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		221	1,822	260,554	消費者サービス
CREDIT AGRICOLE SA		1,059	1,025	146,607	銀行
BNP PARIBAS		706	3,550	507,552	銀行
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		590	2,410	344,672	資本財
国 小 計	株 数 ・ 金 額	2,710	11,388	1,628,154	
	銘 柄 数 <比 率>	6	—	<10.1%>	
(スペイン)					
BANCO SANTANDER SA		10,076	2,605	372,477	銀行
国 小 計	株 数 ・ 金 額	10,076	2,605	372,477	
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<2.3%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	14,229	16,744	2,393,947	
	銘 柄 数 <比 率>	8	—	<14.8%>	
(イギリス)			千ポンド		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,797	730	120,720	耐久消費財・アパレル
BELLWAY PLC		545	1,055	174,413	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		4,117	977	161,515	食品・生活必需品小売り
HALEON PLC		3,646	985	162,932	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC		1,065	1,419	234,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額	11,172	5,168	854,236	
	銘 柄 数 <比 率>	5	—	<5.3%>	
(スイス)			千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		189	2,072	308,490	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	189	2,072	308,490	
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<1.9%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
AUTOLIV INC-SWED DEP RECEIPT		272	21,746	291,184	自動車・自動車部品

銘柄		第 1 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HUSQVARNA AB-B SHS		3,038	20,345	272,421	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,310	42,091	563,605	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<3.5%>	
(ノルウェー) SUBSEA 7 SA		1,485	13,555	192,621	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,485	13,555	192,621	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<1.2%>	
(ポーランド) DINO POLSKA SA		149	5,153	156,207	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	149	5,153	156,207	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<1.0%>	
(韓国) LG CORP		484	3,911,044	402,446	資本財
NICE HOLDINGS CO LTD		302	426,863	43,924	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	787	4,337,908	446,370	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<2.8%>	
(南アフリカ) AVI LTD		1,971	14,499	118,751	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	1,971	14,499	118,751	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.7%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	51,973	—	14,118,645	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	—	<87.5%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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。

組入投資信託証券の内容

■Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

●ファンドの概要

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用方針	主として世界各国の金融商品取引所(これに準ずるものを含みます。)に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス(ESG)や社会的規範を考慮した運用を行います。
主要運用対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「Capital International Fund Audited Annual Report 2021 For the year ended 31 December 2021」の情報を基に掲載しています。

Capital Group New Economy Fund (LUX)

● 損益の状況 (2021年12月31日までの会計期間)

	Capital Group New Economy Fund (LUX)
Income	
Interest on bonds and convertible bonds (net of withholding taxes)	-
Dividend income (net of withholding taxes)	US\$2,246,377
Other income	-
Interest on bank accounts	14,080
Interest on swap contracts	-
	2,260,457
Expenses	
Management fees	5,543,083
Administrative Manager services	452,623
Taxe d'abonnement	253,137
Professional services	183,921
Depository and custody	133,952
Overdraft interest *	-
Other	21,808
Printing and publishing	19,776
Interest on swap contracts	-
	6,608,300
Reimbursement of expenses	261,986
Net investment income/(loss) for the year (a)	(4,085,857)
Net realised gain/(loss) on:	
Sale of investments	21,585,935
Financial futures contracts	-
Foreign currency transaction	(1,514,197)
Swap contracts	-
Net realised gain/(loss) for the year (b)	20,071,738
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) on:	
Investments	29,904,266
Financial futures contracts	-
Swap contracts	-
Foreign currency transactions	854,343
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) for the year (c)	30,758,609
Result of operations for the year (a+b+c)	46,744,490
Dividend distributions	(4,264)
Net subscriptions/(redemptions) of shares for the year	328,414,944
Total net assets at the beginning of the year	297,897,663
Translation difference	-
Total net assets at the end of the year	US\$673,052,833

* Mainly due to negative interest rate policy implemented by central banks.

● 投資明細表 (2021年12月31日現在)

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Equities				
<i>Australia</i>				
Atlassian Corp. plc 'A'	USD	6,585	2,510,795	0.37
Sydney Airport	AUD	49,896	315,100	0.05
Xero Ltd.	AUD	2,858	294,101	0.04
			3,119,996	0.46
<i>Brazil</i>				
NU Holdings Ltd. 'A'	USD	168,707	1,582,472	0.24
Pagseguro Digital Ltd. 'A'	USD	56,730	1,487,460	0.22
Rede D'Or Sao Luiz SA, Reg. S	BRL	34,512	277,769	0.04
StoneCo Ltd. 'A'	USD	71,666	1,208,289	0.18
			4,555,990	0.68
<i>Canada</i>				
AbCellera Biologics, Inc.	USD	74,223	1,061,389	0.16
Lightspeed Commerce, Inc.	USD	7,909	319,761	0.05
Shopify, Inc. 'A'	USD	5,850	8,057,731	1.19
			9,438,881	1.40
<i>China</i>				
Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. 'A'	CNY	30,960	205,385	0.03
CanSino Biologics, Inc., Reg. S 'H'	HKD	46,256	1,068,968	0.16
CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd., Reg. S	HKD	784,000	1,214,576	0.18
ENN Energy Holdings Ltd.	HKD	295,100	5,555,678	0.82
Hefei Meiya Optoelectronic Technology, Inc. 'A'	CNY	61,400	360,885	0.05
Kingdee International Software Group Co. Ltd.	HKD	326,000	1,003,392	0.15
Meituan, Reg. S 'B'	HKD	4,096	118,401	0.02
Tencent Holdings Ltd.	HKD	78,300	4,587,010	0.68
WuXi AppTec Co. Ltd., Reg. S 'H'	HKD	210,912	3,651,547	0.54
Wuxi Biologics Cayman, Inc., Reg. S	HKD	539,000	6,397,452	0.95
Yunnan Energy New Material Co. Ltd.	CNY	4,500	176,799	0.03
Zai Lab Ltd.	HKD	3,900	253,079	0.04
			24,593,172	3.65
<i>Denmark</i>				
SimCorp A/S	DKK	2,084	228,051	0.03
			228,051	0.03
<i>Finland</i>				
Neste OYJ	EUR	26,813	1,323,633	0.20
			1,323,633	0.20
<i>France</i>				
Air Liquide SA	EUR	1,336	233,205	0.03
Airbus SE	EUR	24,542	3,139,458	0.47
Alten SA	EUR	1,801	324,995	0.05
EssilorLuxottica SA	EUR	2,163	461,093	0.07
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	1,396	1,155,455	0.17
Safran SA	EUR	31,186	3,822,496	0.57
			9,136,702	1.36

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
<i>Germany</i>				
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	2,726	573,692	0.09
SAP SE	EUR	4,270	607,188	0.09
SUSE SA	EUR	6,052	276,986	0.04
			1,457,866	0.22
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	599,800	6,046,038	0.90
Futu Holdings Ltd., ADR	USD	20,841	902,415	0.13
Galaxy Entertainment Group Ltd.	HKD	105,000	544,017	0.08
			7,492,470	1.11
<i>Hungary</i>				
Wizz Air Holdings plc, Reg. S	GBP	15,876	899,958	0.13
			899,958	0.13
<i>India</i>				
Bajaj Finserv Ltd.	INR	1,448	319,580	0.05
Embassy Office Parks REIT	INR	254,845	1,164,354	0.17
HDFC Bank Ltd.	INR	57,091	1,136,203	0.17
Kotak Mahindra Bank Ltd.	INR	402,271	9,719,683	1.44
Reliance Industries Ltd.	INR	16,812	535,589	0.08
Star Health & Allied Insurance Co. Ltd.	INR	99,136	1,050,431	0.16
			13,925,840	2.07
<i>Ireland</i>				
Flutter Entertainment plc	EUR	9,206	1,456,864	0.22
ICON plc	USD	1,376	426,147	0.06
Ryanair Holdings plc, ADR	USD	8,667	886,894	0.13
			2,769,905	0.41
<i>Israel</i>				
Nice Ltd., ADR	USD	1,045	317,262	0.05
			317,262	0.05
<i>Italy</i>				
Amplifon SpA	EUR	6,638	358,597	0.05
			358,597	0.05
<i>Japan</i>				
Bandai Namco Holdings, Inc.	JPY	3,200	250,203	0.04
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	JPY	3,500	113,644	0.02
Daiichi Sankyo Co. Ltd.	JPY	268,800	6,835,086	1.02
Hoya Corp.	JPY	700	104,121	0.01
Keyence Corp.	JPY	1,800	1,131,044	0.17
M3, Inc.	JPY	3,700	186,335	0.03
Nidec Corp.	JPY	7,476	878,688	0.13
Nomura Research Institute Ltd.	JPY	4,800	205,929	0.03
Obic Co. Ltd.	JPY	1,600	300,443	0.04
Olympus Corp.	JPY	58,300	1,342,831	0.20
Sony Group Corp.	JPY	1,900	239,090	0.03
			11,587,414	1.72
<i>Netherlands</i>				
Allfunds Group plc	EUR	19,655	387,036	0.06

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
ASML Holding NV	EUR	4,750	3,821,745	0.57
IMCD NV	EUR	1,657	367,301	0.05
InPost SA	EUR	9,872	119,114	0.02
			4,695,196	0.70
<i>Singapore</i>				
Sea Ltd., ADR	USD	13,682	3,060,800	0.46
			3,060,800	0.46
<i>South Korea</i>				
Coupang, Inc.	USD	47,589	1,398,165	0.21
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	98,702	6,501,255	0.97
SK Hynix, Inc.	KRW	33,247	3,663,812	0.54
			11,563,232	1.72
<i>Spain</i>				
Amadeus IT Group SA 'A'	EUR	5,786	392,870	0.06
			392,870	0.06
<i>Sweden</i>				
EQT AB	SEK	20,768	1,133,067	0.17
Evolution AB, Reg. S	SEK	9,258	1,317,771	0.20
Nibe Industrier AB 'B'	SEK	72,152	1,091,918	0.16
			3,542,756	0.53
<i>Switzerland</i>				
Bachem Holding AG 'B'	CHF	1,034	812,493	0.12
Zur Rose Group AG	CHF	2,439	630,361	0.09
			1,442,854	0.21
<i>Taiwan</i>				
MediaTek, Inc.	TWD	20,000	860,231	0.13
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	72,440	8,715,256	1.29
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	46,000	1,022,518	0.15
			10,598,005	1.57
<i>United Kingdom</i>				
Entain plc	GBP	47,488	1,081,788	0.16
Farfetch Ltd. 'A'	USD	19,638	656,498	0.10
Genus plc	GBP	5,811	388,397	0.06
Ocado Group plc	GBP	11,335	257,447	0.04
Rentokil Initial plc	GBP	86,855	686,566	0.10
			3,070,696	0.46
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories	USD	64,884	9,131,774	1.36
Accenture plc 'A'	USD	6,171	2,558,188	0.38
Activision Blizzard, Inc.	USD	8,033	534,436	0.08
Adobe, Inc.	USD	5,987	3,394,988	0.50
Advanced Micro Devices, Inc.	USD	26,657	3,835,942	0.57
Affirm Holdings, Inc.	USD	50,071	5,035,140	0.75
agilon health, Inc.	USD	251,209	6,782,643	1.01
Airbnb, Inc. 'A'	USD	19,852	3,305,159	0.49
Align Technology, Inc.	USD	1,395	916,766	0.14
Alphabet, Inc. 'A'	USD	3,525	10,212,066	1.52
Alphabet, Inc. 'C'	USD	3,772	10,914,621	1.62

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Amazon.com, Inc.	USD	5,720	19,072,425	2.83
Amphenol Corp. 'A'	USD	13,770	1,204,324	0.18
Apple, Inc.	USD	9,634	1,710,709	0.25
Applied Materials, Inc.	USD	49,972	7,863,594	1.17
Aptiv plc	USD	13,065	2,155,072	0.32
Arch Capital Group Ltd.	USD	80,254	3,567,290	0.53
Arista Networks, Inc.	USD	35,908	5,161,775	0.77
Autodesk, Inc.	USD	12,071	3,394,245	0.50
Avalara, Inc.	USD	1,553	200,508	0.03
Avaya Holdings Corp.	USD	21,894	433,501	0.06
Bandwidth, Inc. 'A'	USD	7,066	507,056	0.08
Berkshire Hathaway, Inc. 'B'	USD	11,101	3,319,199	0.49
Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd.	USD	31,330	4,317,587	0.64
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	USD	4,377	386,708	0.06
Block, Inc. 'A'	USD	15,442	2,494,037	0.37
Boeing Co. (The)	USD	4,642	934,527	0.14
Booking Holdings, Inc.	USD	1,136	2,725,525	0.40
Bottomline Technologies DE, Inc.	USD	13,269	749,300	0.11
Broadcom, Inc.	USD	32,948	21,923,929	3.26
Bumble, Inc. 'A'	USD	16,137	546,399	0.08
Burlington Stores, Inc.	USD	5,747	1,675,308	0.25
Cano Health, Inc.	USD	47,214	420,677	0.06
Carrier Global Corp.	USD	43,837	2,377,719	0.35
Carvana Co.	USD	6,855	1,588,920	0.24
Catalent, Inc.	USD	15,729	2,013,784	0.30
CCC Intelligent Solutions Holdings, Inc.	USD	74,781	851,756	0.13
Centene Corp.	USD	46,652	3,844,125	0.57
Ceridian HCM Holding, Inc.	USD	129,678	13,546,164	2.01
Charter Communications, Inc. 'A'	USD	1,902	1,240,047	0.18
Chipotle Mexican Grill, Inc.	USD	1,732	3,027,969	0.45
Cigna Corp.	USD	12,843	2,949,138	0.44
Cloudflare, Inc. 'A'	USD	7,733	1,016,890	0.15
CME Group, Inc.	USD	12,058	2,754,771	0.41
Coinbase Global, Inc. 'A'	USD	1,272	321,015	0.05
Comcast Corp. 'A'	USD	103,474	5,207,846	0.77
Confluent, Inc. 'A'	USD	8,017	611,216	0.09
Copart, Inc.	USD	17,292	2,621,813	0.39
Costco Wholesale Corp.	USD	7,826	4,442,820	0.66
CRISPR Therapeutics AG	USD	7,532	570,775	0.08
Crowdstrike Holdings, Inc. 'A'	USD	5,472	1,120,392	0.17
CSX Corp.	USD	261,010	9,813,976	1.46
Datadog, Inc. 'A'	USD	8,938	1,591,947	0.24
Discover Financial Services	USD	18,945	2,189,284	0.33
Dolby Laboratories, Inc. 'A'	USD	6,195	589,888	0.09
Dollar General Corp.	USD	9,516	2,244,158	0.33
DoorDash, Inc. 'A'	USD	7,047	1,049,298	0.16
DraftKings, Inc. 'A'	USD	63,785	1,752,174	0.26
Eli Lilly & Co.	USD	3,394	937,491	0.14
Endeavor Group Holdings, Inc. 'A'	USD	50,342	1,756,432	0.26
EPAM Systems, Inc.	USD	2,686	1,795,457	0.27
Equifax, Inc.	USD	3,248	950,982	0.14
Equinix, Inc., REIT	USD	1,248	1,055,608	0.16

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Etsy, Inc.	USD	2,231	488,455	0.07
Exact Sciences Corp.	USD	26,488	2,061,561	0.31
Fate Therapeutics, Inc.	USD	17,575	1,028,313	0.15
Fiserv, Inc.	USD	12,212	1,267,483	0.19
Five Below, Inc.	USD	19,212	3,974,771	0.59
Floor & Decor Holdings, Inc. 'A'	USD	38,624	5,021,506	0.75
General Electric Co.	USD	28,348	2,678,036	0.40
General Motors Co.	USD	50,361	2,952,665	0.44
Gilead Sciences, Inc.	USD	13,456	977,040	0.15
Global Blood Therapeutics, Inc.	USD	5,632	164,849	0.02
GLOBALFOUNDRIES, Inc.	USD	499	32,420	-
Guardant Health, Inc.	USD	17,669	1,767,253	0.26
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	USD	29,913	4,666,129	0.69
Home Depot, Inc. (The)	USD	7,335	3,044,098	0.45
HubSpot, Inc.	USD	1,204	793,617	0.12
Humana, Inc.	USD	6,882	3,192,285	0.47
Insight Enterprises, Inc.	USD	5,005	533,533	0.08
Insulet Corp.	USD	21,033	5,596,250	0.83
Intercontinental Exchange, Inc.	USD	12,789	1,749,152	0.26
Janus Henderson Group plc	USD	16,249	681,483	0.10
JPMorgan Chase & Co.	USD	32,365	5,124,998	0.76
Keysight Technologies, Inc.	USD	3,525	727,948	0.11
KKR & Co., Inc.	USD	18,547	1,381,752	0.21
Lam Research Corp.	USD	674	484,707	0.07
Live Nation Entertainment, Inc.	USD	8,413	1,006,952	0.15
Marqeta, Inc. 'A'	USD	163,372	2,805,097	0.42
Marriott International, Inc. 'A'	USD	19,665	3,249,445	0.48
Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	4,575	795,227	0.12
Marvell Technology, Inc.	USD	3,207	280,580	0.04
Mastercard, Inc. 'A'	USD	21,984	7,899,291	1.17
Match Group, Inc.	USD	4,616	610,466	0.09
MercadoLibre, Inc.	USD	6,630	8,939,892	1.33
Meta Platforms, Inc. 'A'	USD	28,471	9,576,221	1.42
Micron Technology, Inc.	USD	151,920	14,151,348	2.10
Microsoft Corp.	USD	91,588	30,802,876	4.58
MicroStrategy, Inc. 'A'	USD	1,281	697,492	0.10
Molina Healthcare, Inc.	USD	10,358	3,294,673	0.49
MongoDB, Inc.	USD	4,387	2,322,258	0.35
Monster Beverage Corp.	USD	8,411	807,792	0.12
Motorola Solutions, Inc.	USD	10,305	2,799,869	0.42
MSCI, Inc.	USD	735	450,327	0.07
Nasdaq, Inc.	USD	8,798	1,847,668	0.27
Netflix, Inc.	USD	46,616	28,083,343	4.17
New York Times Co. (The) 'A'	USD	31,888	1,540,190	0.23
NextEra Energy, Inc.	USD	3,377	315,277	0.05
NIKE, Inc. 'B'	USD	7,288	1,214,691	0.18
Norfolk Southern Corp.	USD	4,280	1,274,199	0.19
NortonLifeLock, Inc.	USD	52,092	1,353,350	0.20
Novavax, Inc.	USD	2,248	321,621	0.05
Novocure Ltd.	USD	16,566	1,243,775	0.18
NVIDIA Corp.	USD	4,076	1,198,792	0.18
Oak Street Health, Inc.	USD	48,784	1,616,702	0.24

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Okta, Inc.	USD	2,689	602,793	0.09
Old Dominion Freight Line, Inc.	USD	4,860	1,741,727	0.26
Paycom Software, Inc.	USD	5,126	2,128,264	0.32
Paylocity Holding Corp.	USD	915	216,086	0.03
PayPal Holdings, Inc.	USD	10,430	1,966,889	0.29
Pegasystems, Inc.	USD	5,045	564,132	0.08
Peloton Interactive, Inc. 'A'	USD	14,881	532,145	0.08
Penumbra, Inc.	USD	1,225	351,967	0.05
PerkinElmer, Inc.	USD	15,135	3,043,043	0.45
Playtika Holding Corp.	USD	84,934	1,468,509	0.22
Qorvo, Inc.	USD	4,489	702,035	0.10
Qualtrics International, Inc. 'A'	USD	8,698	307,909	0.05
R1 RCM, Inc.	USD	19,551	498,355	0.07
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	USD	1,441	910,020	0.14
RenaissanceRe Holdings Ltd.	USD	7,211	1,221,039	0.18
RingCentral, Inc. 'A'	USD	17,581	3,293,800	0.49
Rivian Automotive, Inc. 'A'	USD	44,221	4,585,276	0.68
S&P Global, Inc.	USD	6,018	2,840,075	0.42
Sailpoint Technologies Holdings, Inc.	USD	10,961	529,855	0.08
SentinelOne, Inc. 'A'	USD	13,593	686,311	0.10
ServiceNow, Inc.	USD	6,374	4,137,427	0.61
Sherwin-Williams Co. (The)	USD	17,032	5,997,989	0.89
Smartsheet, Inc. 'A'	USD	25,101	1,944,072	0.29
Snap, Inc. 'A'	USD	100,404	4,722,000	0.70
Snowflake, Inc. 'A'	USD	20,111	6,812,601	1.01
Stericycle, Inc.	USD	9,690	577,912	0.09
Stryker Corp.	USD	6,166	1,648,912	0.25
SVB Financial Group	USD	1,173	795,576	0.12
Syneos Health, Inc.	USD	6,369	653,969	0.10
Target Corp.	USD	758	175,432	0.03
Tesla, Inc.	USD	544	574,888	0.09
TG Therapeutics, Inc.	USD	7,664	145,616	0.02
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	19,155	12,780,982	1.90
T-Mobile US, Inc.	USD	9,339	1,083,137	0.16
Tradeweb Markets, Inc. 'A'	USD	32,141	3,218,600	0.48
TransDigm Group, Inc.	USD	2,521	1,604,062	0.24
Twilio, Inc. 'A'	USD	4,947	1,302,743	0.19
Union Pacific Corp.	USD	15,633	3,938,422	0.59
UnitedHealth Group, Inc.	USD	31,253	15,693,381	2.33
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	USD	5,908	1,297,397	0.19
VMware, Inc. 'A'	USD	15,188	1,759,985	0.26
Warner Music Group Corp. 'A'	USD	11,353	490,223	0.07
Wayfair, Inc. 'A'	USD	2,438	463,147	0.07
Wolfspeed, Inc.	USD	76,574	8,558,676	1.27
Yum! Brands, Inc.	USD	6,452	895,925	0.13
Zendesk, Inc.	USD	21,083	2,198,746	0.33
Zoetis, Inc.	USD	8,804	2,148,440	0.32
Zoom Video Communications, Inc. 'A'	USD	2,791	513,293	0.08
ZoomInfo Technologies, Inc. 'A'	USD	94,624	6,074,861	0.90
Zscaler, Inc.	USD	8,146	2,617,554	0.39
			521,125,189	77.43

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Total Equities			650,697,335	96.68
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			650,697,335	96.68
Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market				
<i>Equities</i>				
<i>Singapore</i>				
Grab Holdings Ltd. 'A'	USD	2,464	17,568	–
			17,568	–
<i>United States of America</i>				
CCC Intelligent Solutions, Inc.	USD	32,160	366,303	0.05
			366,303	0.05
Total Equities			383,871	0.05
Total Transferable securities and money market instruments dealt in on another regulated market			383,871	0.05
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
<i>Collective Investment Schemes - UCITS</i>				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	5,023,193	5,023,193	0.75
			5,023,193	0.75
Total Collective Investment Schemes - UCITS			5,023,193	0.75
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			5,023,193	0.75
Total Investments			656,104,399	97.48
Cash			16,326,818	2.43
Other assets/(liabilities)			621,616	0.09
Total net assets			673,052,833	100.00

組入投資信託証券の内容

■Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

●ファンドの概要

運 用 会 社	Wellington Management Company LLP
運 用 方 針	MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率を上回る投資成果を追求します。ポートフォリオは、カントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。
主 要 運 用 対 象	金融商品取引所等に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。 ※この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。
組 入 制 限	投資信託証券(上場投資信託を除きます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「Wellington Management Funds (Luxembourg) Audited annual report For the financial year ended December 31, 2021」の情報を基に掲載しています。

Wellington Emerging Markets Research Equity Fund

● 損益の状況 (2021年12月31日までの会計期間)

	Wellington Downside Alpha Opportunities Fund USD	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund USD	Wellington Global Health Care Long-Short Fund (in liquidation)* USD
Income			
Interest income (net of withholding tax)	-	-	7,112
Interest income on derivatives	-	-	5,482
Dividend income (net of withholding tax)	2,301,902	33,559,117	252,711
Other income	-	92	4,510
Total income	2,301,902	33,559,209	269,815
Expenses			
Investment management fees	582,777	11,818,713	199,206
Distribution fees	199	1,108,269	34,161
Administrative fee	203,255	3,732,315	51,127
Performance fees	-	-	-
Other fees	-	-	140,000**
Interest expense on derivatives	-	-	173,659
Dividend payments on derivatives	96,463	-	176,442
Total expenses	882,694	16,659,297	774,595
Net investment income/(expense)	1,419,208	16,899,912	(504,780)
Net realised appreciation/(depreciation) on sale of investments, currency transactions and financial derivative instruments	12,282,973	168,752,697	1,954,395
Capital gains tax	-	(2,049,613)	-
Net realised appreciation/(depreciation) for the year	12,282,973	166,703,084	1,954,395
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) on sale of investments, currency transactions and financial derivative instruments	5,834,423	(213,341,098)	(6,038,988)
Finance costs			
Interest expenses	(337)	(3,252)	(2,296)
Distributions	-	(1,473,177)	-
Total finance costs	(337)	(1,476,429)	(2,296)
Increase/(decrease) in net assets as a result of operations	19,536,267	(31,214,531)	(4,591,669)
Net assets at the beginning of the year	122,195,848	1,673,909,196	62,937,497
Subscriptions	143,558	497,324,493	2,071,340
Redemptions	(22,696,368)	(483,737,525)	(60,417,168)
Currency translation adjustment	-	-	-
Total net assets at the end of the year	119,179,305	1,656,281,633	-

* Fund liquidated on June 30, 2021. The statement of operations and changes in net assets has been presented on liquidation basis of accounting.

** Other expenses represent monthly interest charged by State Street and the foreign exchange related expenses on the conversions of the cash balances in local currencies.

● 投資明細表 (2021年12月31日現在)

株数 (単位:千) C1** (通貨) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

Transferable securities admitted to an official stock exchange listing

Common stocks

Communication services

Media & entertainment

516	HKD	Baidu Incorporated Class A	9,573,168	0.58
40	KRW	NAVER Corporation	12,603,612	0.76
326	HKD	NetEase Incorporated	6,579,756	0.40
200	JPY	Nexon Company Limited	3,868,414	0.23
15	USD	Sea Limited (ADR)	3,435,291	0.21
1,736	HKD	Tencent Holdings Limited	101,733,051	6.14
257	USD	Yandex NV Class A	15,515,043	0.93

Telecommunication services

2,900	INR	Bharti Airtel Limited	25,757,216	1.55
267	EUR	Hellenic Telecommunications Organization SA	4,935,728	0.30
505	USD	Mobile TeleSystems PJSC (ADR)	4,011,379	0.24
118	KRW	SK Telecom Company Limited	5,748,599	0.35
32,479	IDR	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	9,206,495	0.56

Total communication services **202,967,752** **12.25**

Consumer discretionary

Automobiles & components

293	HKD	BYD Company Limited Class H	10,019,343	0.60
116	KRW	Kia Corporation	8,034,613	0.49
1,286	INR	Mahindra & Mahindra Limited	14,480,096	0.87
650	USD	XPeng Incorporated (ADR)	32,739,967	1.98
153	HKD	XPeng Incorporated Class A	3,653,691	0.22

Consumer durables & apparel

770	HKD	ANTA Sports Products Limited	11,548,604	0.70
1,783	HKD	Li Ning Company Limited	19,519,394	1.18
141	JPY	Universal Entertainment Corporation	2,984,610	0.18

Consumer services

124	KRW	Kangwon Land Incorporated	2,503,183	0.15
1,127	HKD	Nayuki Holdings Limited	1,237,897	0.07
404	USD	New Oriental Education & Technology Group Incorporated (ADR)	848,106	0.05
5,384	HKD	Sands China Limited	12,540,074	0.76
107	USD	TAL Education Group (ADR)	421,720	0.02
67	HKD	Trip.com Group Limited	1,642,393	0.10
334	USD	Trip.com Group Limited (ADR)	8,213,650	0.50

Retailing

1,652	HKD	Alibaba Group Holding Limited	25,201,987	1.52
61	USD	Alibaba Group Holding Limited (ADR)	7,248,328	0.44
370	CNY	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited Class A	12,745,530	0.77
24	KRW	CJ ENM Company Limited	2,792,580	0.17
185	USD	Coupage Incorporated	5,422,138	0.32
154	USD	JD.com Incorporated (ADR)	10,784,544	0.65
27	HKD	JD.com Incorporated Class A	952,426	0.06
0	BRL	Lojas Renner SA	2	0.00
1,259	BRL	Magazine Luiza SA	1,631,948	0.10
504	HKD	Meituan Class B	14,559,655	0.88
52,368	IDR	Mitra Adiperkasa Tbk PT	2,608,745	0.16
705	HKD	Zhongsheng Group Holdings Limited	5,497,993	0.33

Total consumer discretionary **219,833,217** **13.27**

株数 (単位:千) C1** (通貨) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

Consumer staples

Food & staples retailing

2,971	THB	CP All Ptd	5,267,450	0.32
52	KRW	E-MART Incorporated	6,625,582	0.40
819	BRL	Raia Drogasil SA	3,572,802	0.21
670	CNY	Yifeng Pharmacy Chain Company Limited Class A	5,797,101	0.35

Food beverage & tobacco

4	CNY	Kweichow Moutai Company Limited Class A	1,222,277	0.07
25	CNY	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Company Limited Class A	1,248,583	0.07
644	HKD	Vitasoy International Holdings Limited	1,300,176	0.08
66	CNY	Wuliangye Yibin Company Limited Class A	2,298,795	0.14
2,205	HKD	Yihai International Holding Limited	10,198,433	0.62

Household & personal products

8	KRW	Amorepacific Corporation	1,170,229	0.07
280	INR	Dabur India Limited	2,183,407	0.13
245	INR	Hindustan Unilever Limited	7,780,823	0.47
206	CNY	Proya Cosmetics Company Limited	6,715,235	0.41
2,951	IDR	Unilever Indonesia Tbk PT	850,981	0.05
2,029	USD	Yatsen Holding Limited (ADR)	4,361,634	0.26
75	CNY	Yunnan Botanee Bio-Technology Group Company Limited Class A	2,268,737	0.14

Total consumer staples **62,862,245** **3.79**

Energy

Energy

4,290	HKD	China Oilfield Services Limited Class H	3,758,213	0.23
3,157	USD	Gazprom PJSC (ADR)	29,011,470	1.75
182	USD	Lukoil PJSC (ADR)	16,378,442	0.99
49	USD	NAC Kazatomprom JSC (GDR)	1,798,361	0.11
28	USD	Novatek PJSC (GDR)	6,678,681	0.40
433	CAD	Parex Resources Incorporated	7,409,434	0.45
1,967	BRL	Petroleo Brasileiro SA	10,839,272	0.65
671	INR	Reliance Industries Limited	21,368,405	1.29
82	KRW	SK Innovation Company Limited	16,486,043	1.00

Total energy **113,728,321** **6.87**

Financials

Banks

1,627	INR	Axis Bank Limited	14,847,340	0.90
23,125	IDR	Bank Central Asia Tbk PT	11,844,577	0.71
1,975	GBP	Bank of Cyprus Holdings Plc	2,278,785	0.14
55,642	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	16,045,377	0.97
5,577	PHP	BDO Unibank Incorporated	13,200,108	0.80
34,855	HKD	China Construction Bank Corporation Class H	24,142,085	1.46
1,906	HKD	China Merchants Bank Company Limited Class H	14,805,280	0.89
116	USD	Credicorp Limited	14,206,262	0.86
6,843	TWTD	E.Sun Financial Holding Company Limited	6,937,999	0.42
17,169	KES	Equity Group Holdings Limited	8,004,204	0.48
400	INR	ICICI Bank Limited	3,983,055	0.24
589	USD	ICICI Bank Limited (ADR)	11,663,355	0.70
25,997	HKD	Industrial & Commercial Bank of China Limited Class H	14,672,164	0.89
5,919	THB	Kasikornbank Ptd	25,060,586	1.51
343	CZK	Komercni Banka AS	14,651,866	0.88
519	INR	Kotak Mahindra Bank Limited	12,530,596	0.76

株数 (單位:千) CNY** (通幣) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

Transferable securities admitted to an official stock exchange listing (continued)

Common stocks (continued)

Financials (continued)

Banks (continued)

3,629	USD	Sberbank of Russia PJSC	14,181,555	0.86
286	KRW	Shinhan Financial Group Company Limited	8,851,905	0.53

Diversified financials

8,205	HKD	CSC Financial Company Limited Class H	8,977,762	0.54
4,606	ZAR	FirstRand Limited	17,547,501	1.06
871	GBP	Ninety One Plc	3,268,736	0.20
91	SAR	Saudi Tadawul Group Holding Company	3,040,759	0.18

Insurance

1,807	HKD	AIA Group Limited	18,219,275	1.10
2,891	BRL	Caixa Seguridade Participacoes SA	4,339,245	0.26
2,294	HKD	China Pacific Insurance Group Company Limited Class H	6,221,908	0.38
8,590	ZAR	Old Mutual Limited	7,050,670	0.43
1,910	HKD	Ping An Insurance Group Company of China Limited Class H	13,756,451	0.83
2,991	ZAR	Rand Merchant Investment Holdings Limited	8,465,518	0.51

Total financials

322,794,924 19.49

Health care

Health care equipment & services

81	INR	Apollo Hospitals Enterprise Limited	5,459,355	0.33
754	INR	Fortis Healthcare Limited	3,014,676	0.18
256	BRL	Notre Dame Intermedica Participacoes SA	2,775,883	0.17
2,584	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer Company Limited Class H	3,224,660	0.19
64	CNY	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited Class A	3,817,948	0.23
381	HKD	Venus MedTech Hangzhou Incorporated Class H	1,448,442	0.09

Pharmaceuticals, biotechnology & life sciences

396	HKD	Akeso Incorporated	1,726,973	0.10
246	CNY	Amoy Diagnostics Company Limited	2,915,737	0.18
57	HKD	Asynchem Laboratories Tianjin Company Limited Class H	2,327,258	0.14
12	USD	BeiGene Limited (ADR)	3,204,018	0.19
3,749	HKD	CSPC Pharmaceutical Group Limited	4,073,018	0.25
310	HKD	Everest Medicines Limited	1,384,354	0.08
170	HKD	Hangzhou Tigermed Consulting Company Limited	2,157,446	0.13
92	GBP	Hikma Pharmaceuticals Plc	2,766,976	0.17
513	CNY	Hualan Biological Engineering Incorporated Class A	2,343,691	0.14
473	BRL	Hypera SA	2,400,666	0.15
645	CNY	Jinyu Bio-Technology Company Limited Class A	1,654,664	0.10
187	HKD	Remegen Company Limited Class H	1,868,489	0.11
285	HKD	Wuxi AppTec Company Limited Class H	4,935,380	0.30
44	HKD	Wuxi Biologics Cayman Incorporated	516,318	0.03
22	HKD	Zai Lab Limited	1,439,085	0.09

株数 (單位:千) CNY** (通幣) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

Health care (continued)

Pharmaceuticals, biotechnology & life sciences (continued)

30	USD	Zai Lab Limited (ADR)	1,901,401	0.11
Total health care			57,356,438	3.46

Industrials

Capital goods

252	TWD	Airtac International Group	9,289,679	0.56
431	CNY	Contemporary Amperex Technology Company Limited Class A	39,772,930	2.40

Transportation

278	BRL	Localiza Rent a Car SA	2,641,436	0.16
Total industrials			51,704,045	3.12

Information technology

Semiconductors, semiconductor equipment

2,730	TWD	ASE Technology Holding Company Limited	10,508,729	0.63
64	TWD	ASMedia Technology Incorporated	4,210,070	0.25
15	EUR	ASML Holding NV	11,612,873	0.70
79	TWD	ASPEED Technology Incorporated	10,179,456	0.62
170	KRW	Eugene Technology Company Limited	7,411,703	0.45
310	TWD	Globalwafers Company Limited	9,949,760	0.60
702	TWD	MediaTek Incorporated	30,202,610	1.82
126	TWD	Parade Technologies Limited	9,632,052	0.58
790	TWD	Realtek Semiconductor Corporation	16,563,280	1.00
5,640	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	125,358,571	7.57
20	JPY	Tokyo Electron Limited	11,537,917	0.70

Software & services

345	CNY	Glodon Company Limited Class A	3,458,324	0.21
580	USD	Infosys Limited (ADR)	14,683,495	0.89
2,681	HKD	Kingdee International Software Group Company Limited	8,253,146	0.50
1,044	CNY	Venustech Group Incorporated	4,673,417	0.28

Technology hardware & equipment

799	KRW	Samsung Electronics Company Limited	52,637,163	3.18
156	CNY	Wuxi Lead Intelligent Equipment Company Limited Class A	1,822,682	0.11
276	TWD	Yageo Corporation	4,783,388	0.29

Total information technology

337,478,636 20.38

Materials

Materials

2,449	CNY	Angang Steel Company Limited Class A	1,441,020	0.09
1,110	HKD	Angang Steel Company Limited Class H	494,042	0.03
157	GBP	Anglo American Plc	6,412,136	0.39
400	HKD	Anhui Conch Cement Company Limited Class H	1,995,886	0.12
1,792	CNY	Baoshan Iron & Steel Company Limited Class A	2,013,632	0.12
5,112	HKD	China National Building Material Company Limited	6,268,450	0.38
551	GBP	Ferrexpo Plc	2,233,569	0.14
540	HKD	Ganfeng Lithium Company Limited Class H	8,494,476	0.51
849	ZAR	Gold Fields Limited	9,267,620	0.56
735	MXN	Grupo Mexico SAB de CV Class B	3,208,057	0.19

株數 (單位:千) CCY** (通貨) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

株數 (單位:千) CCY** (通貨) 銘柄 時価 USD 純資産 比率(%)

Transferable securities admitted to an official stock exchange listing (continued)

Common stocks (continued)			
Materials (continued)			
<i>Materials (continued)</i>			
271	CNY	Guangzhou Tinci Materials Technology Company Limited	4,866,016 0.29
826	ZAR	Harmony Gold Mining Company Limited	3,444,806 0.21
299	ZAR	Impala Platinum Holdings Limited	4,218,821 0.26
9	USD	MMC Norilsk Nickel PJSC	2,709,602 0.16
17	KRW	POSCO	3,847,503 0.23
179	CNY	Shandong Sinocera Functional Material Company Limited Class A	1,195,608 0.07
249	CNY	Shanghai Putalai New Ener Class A	6,269,822 0.38
1,234	ZAR	Sibanye Stillwater Limited	3,797,660 0.23
1,211	CNY	Sinoma Science & Technology Company Limited	6,466,808 0.39
173	INR	Tata Steel Limited	2,592,877 0.16
1,262	USD	Vale SA (ADR)	17,692,623 1.07
266	CNY	Yunnan Energy New Material Company Limited Class A	10,446,839 0.63
232	CNY	Zhejiang Huayou Cobalt Company Limited	4,015,458 0.24
Total materials			113,393,331 6.85
Real estate			
<i>Real estate</i>			
7,363	PHP	Ayala Land Incorporated	5,299,380 0.32
1,828	THB	Central Pattana Pcl	3,090,713 0.19
11,722	HKD	CIFI Holdings Group Company Limited	7,051,397 0.42
930	HKD	Country Garden Services Holdings Company Limited	5,569,204 0.34
500	HKD	ESR Cayman Limited	1,689,833 0.10

Real estate (continued)

<i>Real estate (continued)</i>			
380	USD	KE Holdings Incorporated (ADR)	7,652,944 0.46
1,358	HKD	Longfor Group Holdings Limited	6,393,237 0.39
1,720	HKD	Shimao Property Holdings Limited	1,125,085 0.07
1,424	HKD	Sunac China Holdings Limited	2,151,872 0.13
Total real estate			40,023,665 2.42
Utilities			
<i>Utilities</i>			
5,066	HKD	China Gas Holdings Limited	10,526,921 0.64
6,994	HKD	China Longyuan Power Group Corporation Limited Class H	16,328,145 0.99
144	USD	China Yangtze Power Company Limited (GDR)	5,031,742 0.30
907	CNY	China Yangtze Power Company Limited Class A	3,230,111 0.19
851	BRL	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	6,137,369 0.37
384	HKD	ENN Energy Holdings Limited	7,228,662 0.44
2,351	INR	Power Grid Corporation of India Limited	6,464,428 0.39
Total utilities			54,947,378 3.32
Total common stocks			1,577,089,952 95.22
Preferred stocks			
2,214	BRL	Banco Bradesco SA	7,635,268 0.46
711	BRL	Gerdau SA	3,482,550 0.21
460	KRW	Samsung Electronics Company Limited	27,532,763 1.66
Total preferred stocks			38,650,581 2.33
Total transferable securities admitted to an official stock exchange listing			1,615,740,533 97.55
Total investments in securities			1,615,740,533 97.55

Financial derivative instruments

Traded future contracts

<i>Number of contracts long/short</i>	<i>CCY</i>	<i>Investment</i>	<i>Delivery date</i>	<i>Counterparty</i>	<i>Commitment USD</i>	<i>Unrealised appreciation/ (depreciation) USD</i>	<i>% net assets</i>
289	USD	MSCI Emerging Market Futures	18/03/2022	Citigroup Global Markets Incorporated	17,720,035	113,143	0.01
Unrealised appreciation on future contracts						113,143	0.01
Total traded future contracts						113,143	0.01

A positive number of contracts indicates that the Fund is long of the underlying asset and a negative number of contracts indicates that the Fund is short of the underlying asset.

Net other assets/(liabilities)	<i>Fair value USD</i>	<i>% net assets</i>
Total net assets	40,427,957	2.44
	1,656,281,633	100.00

* The holding/nominal value of the transferable securities with a holding/nominal value of less than 500 have been rounded to zero ("0").

** CCY is the trade currency of the holding.

組入投資信託証券の内容

■ FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)

● ファンドの概要

運 用 会 社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社 (SPC) の発行する円建債券に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」(以下「MAN AHL ファンド」*といたします。)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 *MAN AHL ファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。
主 要 運 用 対 象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資は行いません。

● 損益の状況

項 目	第 7 期 自 2021年10月12日 至 2022年10月11日
(A)配 当 等 收 益	△7,987円
受 取 利 息	94
支 払 利 息	△8,081
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,918,302,676
売 買 益	1,920,426,579
売 買 損	△2,123,903
(C)信 託 報 酬 等	△10,228,141
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,908,066,548
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,534,999,869
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	503,264,854
(配 当 等 相 当 額)	(581,011,719)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△77,746,865)
(G)計 (D+E+F)	3,946,331,271
(H)收 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	3,946,331,271
追 加 信 託 差 損 益 金	503,264,854
(配 当 等 相 当 額)	(581,009,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△77,744,962)
分 配 準 備 積 立 金	3,443,218,631
繰 越 損 益 金	△152,214

● 組入資産の明細

< 親投資信託残高 >

	第 6 期 末		第 7 期 末	
	口	数	口	評 価 額
	千口		千口	千円
MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド	9,575,613		13,230,991	17,324,660

下記は、MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド全体の内容です。

<国内(邦貨建)公社債>

第		7		期		末	
銘	柄	名	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
普通社債券(含む投資法人債券)							
STAR	HELIOS	0% 02/12/26	0	20,450,000	26,175,938	2026/2/12	
合		計		20,450,000	26,175,938		

組入投資信託証券の内容

■ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオマザーファンド受益証券を主要投資対象、TOPIX(東証株価指数)を対象とした株価指数先物取引(以下、「株価指数先物取引」といいます。)を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。
主要運用対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、株価指数先物取引を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
組 入 制 限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

●損益の状況

項 目	第 4 期
	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日
(A)配 当 等 收 益	△746,323円
支 払 利 息	△746,323
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△132,397,955
売 買 益	910,261,080
売 買 損	△1,042,659,035
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△601,507,114
取 引 益	3,860,033,920
取 引 損	△4,461,541,034
(D)信 託 報 酬 等	△164,936,255
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△899,587,647
(F)前 期 繰 越 損 益 金	△1,644,822,303
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	833,310,741
(配 当 等 相 当 額)	(521,555,895)
(売 買 損 益 相 当 額)	(311,754,846)
(H) 計 (E+F+G)	△1,711,099,209
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△1,711,099,209
追 加 信 託 差 損 益 金	833,310,741
(配 当 等 相 当 額)	(522,784,354)
(売 買 損 益 相 当 額)	(310,526,387)
分 配 準 備 積 立 金	976,256,711
繰 越 損 益 金	△3,520,666,661

●組入資産の明細

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	第 4 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 TOPIX	—	23,596

<親投資信託残高>

	第 3 期 末	第 4 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド	10,946,463	7,890,199	11,461,303
日本成長株投資マザーファンド	10,435,700	8,440,244	11,249,158

下記は、日本成長株投資マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
鉱業(1.1%)				
INPEX	77.4	84.1	118,412	
建設業(2.4%)				
ショーボンドホールディングス	20.9	16.8	96,264	
大和ハウス工業	50.8	52.1	160,624	
食料品(1.0%)				
東洋水産	—	19.6	101,920	
パルプ・紙(0.9%)				
レンゴー	134.1	109.5	99,426	
化学(14.3%)				
日産化学	20.5	20.1	124,419	
信越化学工業	32.9	30.1	509,292	
日油	25.8	27.8	150,398	
花王	29	—	—	
富士フィルムホールディングス	—	16.4	111,880	
ミルボン	20.8	17.3	96,188	
コーセー	4.8	—	—	
ニフコ	40.8	35.6	117,124	
ユニ・チャーム	110.4	79.7	414,997	
医薬品(7.4%)				
塩野義製薬	2.8	—	—	
日本新薬	—	12.4	92,628	
中外製薬	134.3	125.6	433,571	
参天製薬	—	102.7	112,764	
JCRファーマ	46.9	42.2	72,035	
第一三共	73.8	17.9	77,274	
機械(9.0%)				
三浦工業	37.1	43.4	133,238	
ディスコ	5.2	0.8	31,320	
SMC	5.7	4.8	279,936	
小松製作所	73.4	—	—	
ダイキン工業	24.3	18.9	391,324	
ダイブク	16.9	19.4	125,130	
電気機器(12.7%)				
日立製作所	22.7	17.2	118,508	
日本電産	43.7	25.8	189,862	
キーエンス	9.9	8.9	474,993	
シスメックス	15.5	26.6	220,487	
太陽誘電	20.1	10.2	40,800	
村田製作所	39	29.7	206,296	
東京エレクトロン	1.6	2.4	99,816	
輸送用機器(2.8%)				
本田技研工業	—	27.3	85,176	
スズキ	51.7	—	—	
シマノ	4.9	10.1	214,827	
精密機器(4.5%)				
テルモ	40.4	35.9	135,881	
HOYA	19.3	17	223,125	
朝日インテック	68	37.9	85,919	
メニコン	—	11.4	32,330	

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
その他製品(2.6%)				
バンダイナムコホールディングス	13.8	12.3	102,864	
ビジョン	131.3	82.5	178,117	
陸運業(1.1%)				
SGホールディングス	50	60.1	118,637	
倉庫・運輸関連業(0.4%)				
トランコム	—	5	37,850	
情報・通信業(13.2%)				
システナ	145.6	159.3	64,357	
GMOペイメントゲートウェイ	22.7	30.5	346,785	
ラクス	—	38.5	61,176	
オービック	19.4	13.9	276,332	
ジャストシステム	31	—	—	
トレンドマイクロ	18.7	6.5	40,170	
大塚商会	31.9	12.8	53,632	
ネットワンシステムズ	—	29.1	97,048	
日本電信電話	—	80.8	301,141	
KDDI	65.2	41.7	166,341	
ソフトバンクグループ	42.4	—	—	
卸売業(2.2%)				
伊藤忠商事	105.9	57.3	239,915	
小売業(9.2%)				
MonotaRO	157.5	126.8	238,003	
コスモス薬品	5.5	4	54,680	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	64.3	25.9	58,689	
ワークマン	16.5	—	—	
ニトリホールディングス	14.1	14.5	231,057	
ファーストリテイリング	6.5	5.1	403,920	
銀行業(0.8%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	117.4	101.9	83,394	
保険業(2.5%)				
東京海上ホールディングス	63.2	94.2	272,379	
その他金融業(0.9%)				
イー・ギョランティ	48.5	42.9	94,894	
不動産業(0.8%)				
カチタス	16.6	29	85,173	
サービス業(10.2%)				
日本M&Aセンターホールディングス	70.7	126.9	204,435	
エス・エム・エス	22.5	33.3	106,893	
カカクコム	26.3	—	—	
エムスリー	105.6	119.7	432,595	
リクルートホールディングス	67.9	55.8	228,277	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36.9	28.5	45,429	
リログループ	72.9	32.1	66,447	
合計	株数	金額		
	2,916	2,628	10,668,830	
	63	64	<94.8%>	

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

下記は、野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
水産・農林業(0.6%)				
マルハニチロ	—	11.1	27,050	
ホクト	24.4	19.5	36,445	
建設業(6.9%)				
ショーボンドホールディングス	31.4	15.9	91,107	
西松建設	17.5	31.8	124,338	
大東建託	13.1	—	—	
大和ハウス工業	61.9	48.6	149,833	
積水ハウス	51	57.2	136,422	
関電工	92.6	67.7	58,560	
きんでん	62.7	57.1	81,367	
エクシオグループ	49.5	24.8	53,444	
九電工	36.4	18	57,780	
インフロンア・ホールディングス	—	58.7	59,228	
食料品(13.6%)				
日清製粉グループ本社	65.7	—	—	
森永製菓	28.2	23.9	92,373	
江崎グリコ	40.9	33.6	123,480	
山崎製パン	—	49.4	79,484	
カルビー	16.6	34.5	105,570	
明治ホールディングス	3.2	13.4	89,244	
伊藤ハム米久ホールディングス	73.3	52.5	36,067	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホルデ	—	20.7	29,890	
サントリー食品インターナショナル	41.3	29.3	133,461	
伊藤園	26.7	15.7	77,008	
味の素	57.9	30.4	132,756	
キューピー	67	50.2	122,387	
ハウス食品グループ本社	36.7	22.8	62,791	
カゴメ	34.3	17.5	53,462	
ニチレイ	41.4	14.5	40,600	
東洋水産	35	23.4	121,680	
日清食品ホールディングス	20.6	13	136,370	
日本たばこ産業	97.4	60	169,950	
パルプ・紙(1.6%)				
大王製紙	58.8	64	66,688	
レンゴ	190	139.2	126,393	
化学(4.2%)				
エア・ウォーター	—	29.5	45,046	
日油	25.9	6.1	33,001	
花王	—	10.2	54,070	
富士フイルムホールディングス	29	4.5	30,699	
ファンケル	5.5	—	—	
ポーラ・オルビスホールディングス	—	11.6	21,077	

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
小林製薬	16.7	5.9	49,206	
エフピコ	41.9	28	98,560	
ユニ・チャーム	44	31.4	163,499	
医薬品(0.7%)				
協和キリン	50.3	—	—	
科研製薬	38.5	18.4	71,484	
ツムラ	38	4.7	13,912	
大塚ホールディングス	17.1	—	—	
大正製薬ホールディングス	20.5	—	—	
機械(2.1%)				
平和	36.4	41.4	101,264	
SANKYO	53.2	23.1	122,661	
セガサミーホールディングス	—	14.9	28,071	
電気機器(7.3%)				
東芝	—	35	152,775	
日本電産	4.6	—	—	
日本電気	—	17.1	79,429	
エレコム	27.9	—	—	
ヒロセ電機	8.4	3.8	65,702	
アズビル	34.6	28.2	98,136	
日本光電工業	41.4	37	114,700	
キーエンス	7.4	—	—	
シスメックス	8.4	—	—	
浜松ホトニクス	25.6	—	—	
京セラ	3.3	23.8	160,007	
キヤノン	32.4	62.3	186,214	
精密機器(—%)				
HOYA	20.3	—	—	
その他製品(1.4%)				
バンダイナムコホールディングス	21.9	—	—	
大日本印刷	—	6	16,122	
リントック	—	25.1	54,567	
コクヨ	64.7	52.1	96,958	
電気・ガス業(4.2%)				
電源開発	—	60.9	128,194	
東京瓦斯	87	56.1	144,401	
大阪瓦斯	93.3	65.3	137,195	
東邦瓦斯	41.2	33	83,358	
陸運業(4.1%)				
小田急電鉄	29.9	—	—	
京王電鉄	21.2	—	—	
富士急行	10	—	—	
西日本鉄道	33.2	6.9	17,484	

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
近鉄グループホールディングス	—	30.7	135,694	
阪急阪神ホールディングス	14.5	18.9	75,033	
南海電気鉄道	31.6	25.8	72,885	
名古屋鉄道	—	38.7	84,443	
ヤマトホールディングス	63.3	—	—	
福山通運	14	—	—	
日立物流	13.1	—	—	
九州旅客鉄道	—	33.9	98,106	
SGホールディングス	65.4	—	—	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
上組	—	8.1	22,096	
情報・通信業(18.4%)				
NECネットエスアイ	40.7	48.6	77,760	
TIS	51.7	36	127,440	
グリー	—	80.6	55,291	
コーエーテックモホールディングス	35.4	—	—	
インターネットイニシアティブ	14.2	48.4	116,595	
フジ・メディア・ホールディングス	—	113.8	119,945	
オービック	9.1	5.8	115,304	
トレンドマイクロ	—	13.4	82,812	
日本オラクル	13.1	10	78,900	
オービックビジネスコンサルタント	16.8	—	—	
伊藤忠テクノソリューションズ	44	39.1	120,623	
大塚商会	32.2	29.5	123,605	
日本テレビホールディングス	—	117.1	120,261	
スカパーJ SATホールディングス	—	147.5	69,472	
日本電信電話	117.7	85.1	317,167	
KDDI	88.6	62.1	247,716	
ソフトバンク	196.6	146.5	217,406	
光通信	1	—	—	
東宝	28.3	11.6	58,812	
カブコン	46.3	—	—	
SCSK	72.4	59.8	120,437	
卸売業(8.3%)				
アルフレッサ ホールディングス	—	78.5	130,781	
シップヘルスクエアホールディングス	59.6	45.1	118,793	
メイバルホールディングス	19.8	72.1	126,319	
アズワン	10.5	—	—	
伊藤忠商事	85	55.2	231,122	
三井物産	63.6	—	—	
キャンマーケティングジャパン	48.5	26.6	80,199	
岩谷産業	25.5	22	126,060	
PALTAC	14.4	9.9	42,867	
ミスミグループ本社	7	—	—	
スズケン	—	34.6	126,290	

銘柄	第3期末		第4期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
小売業(14.6%)				
ローソン	29.1	25.2	123,984	
エービーシー・マート	30.7	17.9	127,627	
エディオン	—	17.4	22,011	
Monotaro	71.7	—	—	
ZOZO	43.8	—	—	
すかいらーくホールディングス	60.7	80.8	127,987	
コスモス薬品	9.7	2.7	36,909	
セブン&アイ・ホールディングス	52.8	32.2	179,837	
バン・パシフィック・インターナショナルホ	87.8	60.9	137,999	
ゼンショーホールディングス	60.8	31.6	105,702	
スギホールディングス	23.7	13.5	82,620	
しまむら	8.5	6.7	84,554	
ヤオコー	18.2	14.2	96,418	
ケーズホールディングス	—	67.5	75,060	
アインホールディングス	9.5	10.1	60,297	
ヤマダホールディングス	—	211.8	99,334	
ニトリホールディングス	10.9	7.9	125,886	
吉野家ホールディングス	—	50.6	116,886	
サンドラッグ	40.7	31.4	116,651	
銀行業(4.2%)				
ひろぎんホールディングス	—	101.1	64,906	
三井住友トラスト・ホールディングス	—	19.9	88,336	
セブン銀行	—	340.6	89,918	
みずほフィナンシャルグループ	—	129.2	228,296	
山口フィナンシャルグループ	—	33.1	27,506	
保険業(4.8%)				
SOMPOホールディングス	—	28.1	161,884	
MS&ADインシュアランスグループホール	—	39.8	163,498	
東京海上ホールディングス	—	83.8	242,307	
不動産業(1.2%)				
大東建託	—	9.9	136,125	
サービス業(1.6%)				
総合警備保障	36.1	—	—	
オリエンタルランド	13.8	—	—	
ユー・エス・エス	85.8	—	—	
日本郵政	—	170.8	187,709	
セコム	15.7	—	—	
合計	4,463	5,054	11,793,528	
株数・金額 銘柄数<比率>	111	116	<99.4%>	

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運 用 方 針	ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 〈マザーファンドの投資態度〉 主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主 要 運 用 対 象	「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 〈マザーファンドの投資対象〉 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。
組 入 制 限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

●損益の状況

項 目	第 1 期 自 2022年 4月12日 至 2022年11月16日
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,513,714,686円
売 買 益	5,761,044
売 買 損	△1,519,475,730
(B)信 託 報 酬 等	△41,002,362
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	△1,554,717,048
(D)追 加 信 託 差 損 益 金	△293,520,278
(売 買 損 益 相 当 額)	(△293,520,278)
(E) 計 (C+D)	△1,848,237,326
次 期 繰 越 損 益 金 (E)	△1,848,237,326
追 加 信 託 差 損 益 金	△293,520,278
(配 当 等 相 当 額)	(△1,328,356)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△292,191,922)
繰 越 損 益 金	△1,554,717,048

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	
	口 数	評 価 額
ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド	千口 21,481,305	千円 20,383,610

下記は、ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド全体の内容です。

<国内(邦貨建)公社債>

第	1	期	末		
銘	柄	名	利	率	
			(%)	額	
				面	
				金	
				額	
				(千円)	
				評	
				価	
				額	
				(千円)	
				償	
				還	
				年月日	
国債証券					
第1107	回国庫短期証券	—	3,100,000	3,100,397	2022/12/12
第1109	回国庫短期証券	—	6,700,000	6,701,144	2022/12/19
第1112	回国庫短期証券	—	6,480,000	6,483,732	2023/4/10
第1113	回国庫短期証券	—	8,900,000	8,902,303	2023/1/16
第1118	回国庫短期証券	—	6,940,000	6,942,028	2023/2/13
合	計		32,120,000	32,129,606	

組入投資信託証券の内容

■MA Hedge Fund Strategies Limited

●ファンドの概要

運 用 会 社	UBS O' Connor LLC
運 用 方 針	公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。
主 要 運 用 対 象	主として世界各国(日本を含みます。)の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
組 入 制 限	投資法人財産を超える有価証券(現物に限ります)の空売りは行いません。 投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 一発行会社(投資法人を含みます。)の発行済株式総数の50%超を超える株式(投資法人が発行する投資証券を含みます。)を取得しないものとします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

以下の「損益の状況」は「MA Hedge Fund Strategies Limited FINANCIAL STATEMENTS Year Ended December 30, 2021 With Report of Independent Auditors」の情報を基に、「投資明細表」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

MA Hedge Fund Strategies Limited

● 損益の状況 (2021年12月30日までの会計期間)

Realized and unrealized gains (losses) on investments in securities, derivative contracts and foreign currency

Net realized gain on investments in securities and foreign currency	\$ 10,322,165	
Net realized loss on derivative contracts and foreign currency	(11,071,987)	
Net change in unrealized appreciation/depreciation on investments in securities and foreign currency	(6,582,848)	
Net change in unrealized appreciation/depreciation on derivative contracts and foreign currency	<u>(125,573)</u>	
Net loss on investments in securities, derivative contracts and foreign currency		\$ (7,458,243)

Investment income

Dividends (net of withholding tax of \$79,595)	1,879,580
Interest	232,652
Other	<u>20,615</u>
Total investment income	2,132,847

Expenses

Dividends	381,897
Interest	300,126
Management fees	410,550
Performance fees	158,753
Administration fees	138,943
Other	<u>205,496</u>
Total expenses	<u>1,595,765</u>

Net investment income		<u>537,082</u>
Net change in net assets resulting from operations		<u>\$ (6,921,161)</u>

●投資明細表(2021年12月30日現在)

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
Bond													
CORP													
	-475,000	US099724AJ55	BORGWARNER INC 3.375% 03/15/25	USD	-510,266.78	-510,266.78	105.4676	1.0000	-500,971.28	-500,971.28	9,295.50	0.00	9,295.50
	408,000	US099724AM84	BORGWARNER INC 5.000% 10/01/25 SR:144A	USD	470,592.48	470,592.48	111.9977	1.0000	456,950.74	456,950.74	-13,641.74	0.00	-13,641.74
	524,000	US15911NAA37	CHANGE HEALTH / FIN INC 5.750% 03/01/25 SR:144A	USD	533,984.88	533,984.88	100.8710	1.0000	528,564.04	528,564.04	-5,420.84	0.00	-5,420.84
	27,000	US20752TAA25	CONNECT FINCO SARL/CONN 6.750% 10/01/26 SR:144A	USD	28,350.00	28,350.00	105.0100	1.0000	28,352.70	28,352.70	2.70	0.00	2.70
	220,000	US22282EAJ10	COVANTA HOLDING CORP 5.000% 09/01/30	USD	236,741.25	236,741.25	102.1370	1.0000	224,701.40	224,701.40	-12,039.85	0.00	-12,039.85
	74,000	US36164YAB74	GCP APPLIED TECHNOLOGIES 5.500% 04/15/26 SR:144A	USD	75,966.25	75,966.25	102.6000	1.0000	75,924.00	75,924.00	-42.25	0.00	-42.25
	141,000	US50076XAC56	KRATON POLYMERS LLC/CAP 4.250% 12/15/25 SR:144A	USD	145,940.00	145,940.00	103.6365	1.0000	146,127.48	146,127.48	187.48	0.00	187.48
	298,000	US563568AB08	WELBILT INC 9.500% 02/15/24	USD	313,688.41	313,688.41	101.1225	1.0000	301,345.07	301,345.07	-12,343.34	0.00	-12,343.34
	30,000	US67421QA0A4	OASIS MIDSTREAM PARTNERS 8.000% 04/01/29 SR:144A	USD	32,700.00	32,700.00	109.9399	1.0000	32,981.70	32,981.70	281.70	0.00	281.70
	56,000	US87900YAF07	TEEXAY CORP 9.250% 11/15/22 SR:144A	USD	57,792.00	57,792.00	102.6425	1.0000	57,479.80	57,479.80	-312.20	0.00	-312.20
	2,000	US92943GA0A94	WR GRACE HOLDING LLC 5.625% 08/15/29 SR:144A	USD	2,046.24	2,046.24	102.8930	1.0000	2,057.86	2,057.86	11.62	0.00	11.62
	26,000	US92943GAC50	WR GRACE HOLDING LLC 5.625% 10/01/24 SR:144a	USD	0.00	0.00	105.3820	1.0000	27,399.32	27,399.32	27,399.32	0.00	27,399.32
			Subtotal - CORP			1,387,534.73			1,380,912.83	1,380,912.83	-6,621.90	0.00	-6,621.90
GOVT													
	-49,200	US91282CBH34	US TREASURY N/B 0.375% 01/31/26	USD	-49,039.24	-49,039.24	96.7500	1.0000	-47,601.00	-47,601.00	1,438.24	0.00	1,438.24
			Subtotal - GOVT			-49,039.24			-47,601.00	-47,601.00	1,438.24	0.00	1,438.24
			Subtotal - Bond			1,338,495.49			1,333,311.83	1,333,311.83	-5,183.66	0.00	-5,183.66
Equity													
ADR													
	10,770	BBL US	BHP GROUP PLC-ADR	USD	460,272.18	460,272.18	59.5900	1.0000	641,784.30	641,784.30	181,512.12	0.00	181,512.12
	-10,764	BHP US	BHP GROUP LTD-SPON ADR	USD	-746,605.17	-746,605.17	60.2600	1.0000	-648,638.64	-648,638.64	97,966.53	0.00	97,966.53
	2,008	RYAAY US	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	USD	180,640.38	180,640.38	102.1200	1.0000	205,056.96	205,056.96	24,416.58	0.00	24,416.58
			Subtotal - ADR			-105,692.61			198,202.62	198,202.62	303,895.23	0.00	303,895.23
COMMON STOCK													
	600	1935465D UU	FIDELITY SOUTHERN CORP	USD	6,000.00	6,000.00	9.8500	1.0000	5,910.00	5,910.00	-90.00	0.00	-90.00
	1,500	2MX FP	2MX ORGANIC SA	EUR	14,979.00	17,640.76	9.8010	1.1325	14,701.50	16,649.45	-314.27	-677.04	-991.31
	23,900	5486 JP	HITACHI METALS LTD	JPY	50,885,230.52	464,113.95	2,131.0000	115.0800	50,930,900.00	442,569.54	396.80	-21,941.21	-21,544.41
	4,300	6502 JP	TOSHIBA CORP	JPY	20,527,348.37	188,091.20	4,730.0000	115.0800	20,339,000.00	176,737.87	-1,636.69	-9,716.64	-11,353.33
	-46,706	9990822D US	APOLLO ASSET MANAGEMENT INC	USD	-2,758,519.38	-2,758,519.38	73.0400	1.0000	-3,411,406.24	-3,411,406.24	-652,886.86	0.00	-652,886.86
	208,751	AABA_ESCROW	AABA_ESCROW	USD	3,067,698.91	3,067,698.91	5.9050	1.0000	1,232,674.77	1,232,674.77	-1,835,024.14	0.00	-1,835,024.14
	745	AAC US	ARES ACQUISITION CORP-A	USD	7,450.00	7,450.00	9.7400	1.0000	7,256.30	7,256.30	-193.70	0.00	-193.70
	1,050	AACI US	ARMADA ACQUISITION CORP I	USD	10,500.00	10,500.00	9.8160	1.0000	10,306.80	10,306.80	-193.20	0.00	-193.20
	1,500	AAQC US	ACCELERATE ACQUISITION COR-A	USD	14,883.00	14,883.00	9.7000	1.0000	14,550.00	14,550.00	-333.00	0.00	-333.00
	294	ACAH US	ATLANTIC COASTAL ACQUISITI-A	USD	2,910.60	2,910.60	9.7600	1.0000	2,869.44	2,869.44	-41.16	0.00	-41.16
	1,206	ACEL US	ACCEL ENTERTAINMENT INC	USD	13,109.22	13,109.22	13.0200	1.0000	15,702.12	15,702.12	2,592.90	0.00	2,592.90
	15,790	ACHN_CVR	ACHILLION PHARMACEUTICALS INC	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	9,474.00	9,474.00	9,474.00	0.00	9,474.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)	
		751	ACII US	ATLAS CREST INVESTMENT COR-A	USD	7,516.00	7,516.00	9.7600	1.0000	7,329.76	7,329.76	-186.24	0.00	-186.24
		1,495	ACQR US	INDEPENDENCE HDS CORP-CL A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7400	1.0000	14,561.30	14,561.30	-388.70	0.00	-388.70
		1,500	ACRO US	ACROPOLIS INFRASTRUCTURE - A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7200	1.0000	14,580.00	14,580.00	-420.00	0.00	-420.00
		744	ACTD US	ARLIGHT CLEAN TRANSITION -A	USD	7,432.56	7,432.56	9.9500	1.0000	7,402.80	7,402.80	-29.76	0.00	-29.76
		746	AEAC US	AUTHENTIC EQUITY ACQUISITI-A	USD	7,460.00	7,460.00	9.7600	1.0000	7,280.96	7,280.96	-179.04	0.00	-179.04
		1,500	AEAE US	ALTEENERGY ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8400	1.0000	14,760.00	14,760.00	-240.00	0.00	-240.00
		4,529	AFTR US	AFTERNEXT HEALTHTECH ACQUI-A	USD	45,290.00	45,290.00	9.7000	1.0000	43,931.30	43,931.30	-1,358.70	0.00	-1,358.70
		750	AGCB US	ALTIMETER GROWTH CORP 2-A	USD	7,609.61	7,609.61	9.8300	1.0000	7,372.50	7,372.50	-237.11	0.00	-237.11
		1,495	AGGR US	AGILE GROWTH CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7200	1.0000	14,531.40	14,531.40	-418.60	0.00	-418.60
		1,500	AHPA US	AVISTA PUBLIC ACQUIS-CLASS A	USD	15,000.00	15,000.00	10.0000	1.0000	15,000.00	15,000.00	0.00	0.00	0.00
		1,506	AKIC US	SPORTS VENTURES ACQUISITIO-A	USD	15,060.00	15,060.00	9.7400	1.0000	14,668.44	14,668.44	-391.56	0.00	-391.56
		1,500	ALCC US	ALTC ACQUISITION CORP-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8200	1.0000	14,730.00	14,730.00	-270.00	0.00	-270.00
		375	ALTU US	ALTITUDE ACQUISITION CORP-A	USD	0.00	0.00	9.8700	1.0000	3,701.25	3,701.25	3,701.25	0.00	3,701.25
		2,250	AMCI US	AMCI ACQUISITION CORP II-A	USD	22,500.00	22,500.00	9.6600	1.0000	21,735.00	21,735.00	-765.00	0.00	-765.00
		-22,721	AMD US	ADVANCED MICRO DEVICES	USD	-1,989,840.96	-1,989,840.96	145.1500	1.0000	-3,297,953.15	-3,297,953.15	-1,308,112.19	0.00	-1,308,112.19
		913	AMPI US	ADVANCED MERGER PARTNERS 1-A	USD	9,078.03	9,078.03	9.7158	1.0000	8,870.53	8,870.53	-207.50	0.00	-207.50
		1,501	ANAC US	ARCTOS NORTHSTAR ACQUISIT-A	USD	15,010.00	15,010.00	9.7700	1.0000	14,664.77	14,664.77	-345.23	0.00	-345.23
		1,344	ANZU US	ANZU SPECIAL ACQUISITION -A	USD	13,440.00	13,440.00	9.7500	1.0000	13,104.00	13,104.00	-336.00	0.00	-336.00
		750	APAC US	STONEBRIDGE ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	9.8500	1.0000	7,387.50	7,387.50	-112.50	0.00	-112.50
		1,497	APGB US	APOLLO STRATEGIC GROWTH-CL A	USD	14,970.00	14,970.00	9.7800	1.0000	14,640.66	14,640.66	-329.34	0.00	-329.34
		750	APMI US	AXONPRIME INFRASTRUCTURE-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8200	1.0000	7,365.00	7,365.00	-135.00	0.00	-135.00
		765	APSG US	APOLLO STRATEGIC GROWTH-CL A	USD	1,477.50	1,477.50	9.8600	1.0000	7,542.90	7,542.90	6,065.40	0.00	6,065.40
		1,200	APTM US	ALPHA PARTNERS TECHNOLOGY-A	USD	11,907.00	11,907.00	9.7000	1.0000	11,640.00	11,640.00	-267.00	0.00	-267.00
		1,500	ARGU US	ARGUS CAPITAL CORP-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9100	1.0000	14,865.00	14,865.00	-135.00	0.00	-135.00
		3,232	ARNA US	ARENA PHARMACEUTICALS INC	USD	297,265.38	297,265.38	92.9000	1.0000	300,252.80	300,252.80	2,987.42	0.00	2,987.42
		971	ARTA US	ARTISAN ACQUISITION CORP-A	USD	9,665.57	9,665.57	9.9000	1.0000	9,612.90	9,612.90	-52.67	0.00	-52.67
		1,200	ARTE US	ARTEMIS STRATEGIC INVES-CL A	USD	12,000.00	12,000.00	10.1678	1.0000	12,201.36	12,201.36	201.36	0.00	201.36
		748	ASAQ US	ATLANTIC AVENUE ACQUISIT-CL A	USD	4,309.76	4,309.76	9.8100	1.0000	7,337.88	7,337.88	3,028.12	0.00	3,028.12
		300	ASAX US	ASTREA ACQUISITION CORP-CL A	USD	2,942.47	2,942.47	9.9100	1.0000	2,973.00	2,973.00	30.53	0.00	30.53
		4,527	ASZ US	AUSTERLITZ ACQUISITION COR-A	USD	45,223.29	45,223.29	9.7400	1.0000	44,092.98	44,092.98	-1,130.31	0.00	-1,130.31
		1,196	ATAQ US	ALTIMAR ACQUISITION CORP-A	USD	11,960.00	11,960.00	9.7600	1.0000	11,672.96	11,672.96	-287.04	0.00	-287.04
		5,444	ATC US	ATOTECH LTD	USD	135,507.19	135,507.19	25.4200	1.0000	138,386.48	138,386.48	2,879.29	0.00	2,879.29
		-10,191	ATCOA SS	ATLAS COPCO AB-A SHS	SEK	-3,844,532.42	-408,142.50	625.8000	9.0427	-6,377,527.80	-705,268.11	-280,114.96	-17,010.65	-297,125.61
		11,645	ATCOB SS	ATLAS COPCO AB-B SHS	SEK	3,845,386.07	408,044.21	532.2000	9.0427	6,197,469.00	685,356.04	260,108.47	17,203.36	277,311.83
		40,674	ATH US	ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	USD	2,632,517.83	2,632,517.83	83.9100	1.0000	3,412,955.34	3,412,955.34	780,437.51	0.00	780,437.51
		377	AUS US	AUSTERLITZ ACQUISITION COR-A	USD	3,770.00	3,770.00	9.7300	1.0000	3,668.21	3,668.21	-101.79	0.00	-101.79
		750	AVAC US	AVALON ACQUISITION INC-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.9000	1.0000	7,425.00	7,425.00	-75.00	0.00	-75.00
		1,170	AVAN US	AVANTI ACQUISITION CORP-A	USD	0.00	0.00	9.8200	1.0000	11,489.40	11,489.40	11,489.40	0.00	11,489.40
		960	BGSX US	BUILD ACQUISITION CORP-A	USD	9,513.81	9,513.81	9.7600	1.0000	9,369.60	9,369.60	-144.21	0.00	-144.21
		750	BHAC US	CRUXIS BIE ACQUISITION CO-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8000	1.0000	7,350.00	7,350.00	-150.00	0.00	-150.00
		453	BLNG US	BELONG ACQUISITION CORP-A	USD	4,530.00	4,530.00	9.7000	1.0000	4,394.10	4,394.10	-135.90	0.00	-135.90
		452	BLTS US	BRIGHT LIGHTS ACQUISITI-CL A	USD	4,520.00	4,520.00	9.8950	1.0000	4,472.54	4,472.54	-47.46	0.00	-47.46
		1,500	BLUA US	BLUERIVER ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7250	1.0000	14,587.50	14,587.50	-412.50	0.00	-412.50
		31,900	BMV-R_CVR	BRISTOL-MYERS SQUIBB-CVR	USD	76,232.78	76,232.78	1.1130	1.0000	35,604.87	35,604.87	-40,627.91	0.00	-40,627.91
		115	BNNR US	BANNER ACQUISITION CORP	USD	1,150.00	1,150.00	9.7700	1.0000	1,123.55	1,123.55	-26.45	0.00	-26.45
		1,111	BOAC US	BLUESCAPE OPPORTUNITIES AC-A	USD	0.00	0.00	9.7900	1.0000	10,876.69	10,876.69	10,876.69	0.00	10,876.69
		1,176	BOAS US	BOA ACQUISITION CORP-A	USD	11,583.60	11,583.60	9.8450	1.0000	11,577.72	11,577.72	-5.88	0.00	-5.88
		519	BRIV US	B RILEY PRINCIPAL 250 MERG-A	USD	5,110.50	5,110.50	9.7250	1.0000	5,047.28	5,047.28	-63.22	0.00	-63.22
		746	BSKY US	BIG SKY GROWTH PARTNERS 1N-A	USD	7,460.00	7,460.00	9.7200	1.0000	7,251.12	7,251.12	-208.88	0.00	-208.88
		1,205	BTAQ US	BURGUNDY TECHNOLOGY ACQUIS-A	USD	11,724.65	11,724.65	9.9900	1.0000	12,037.95	12,037.95	313.30	0.00	313.30
		1,195	BYTS US	BYTE ACQUISITION CORP - A	USD	11,519.80	11,519.80	9.8000	1.0000	11,711.00	11,711.00	191.20	0.00	191.20
		1,497	CAS US	CASCADE ACQUISITION COR-CL A	USD	7,425.00	7,425.00	9.9600	1.0000	14,910.12	14,910.12	7,485.12	0.00	7,485.12
		1,198	CCAC US	CITIC CAPITAL ACQUISITION-A	USD	11,776.34	11,776.34	10.0300	1.0000	12,015.94	12,015.94	239.60	0.00	239.60

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
2,215	CCV US	CHURCHILL CAPITAL CORP V-A	USD	22,150.00	22,150.00	9.8500	1.0000	21,817.75	21,817.75	-332.25	0.00	-332.25	
1,492	CCVI US	CHURCHILL CAPITAL CORP VI-A	USD	14,920.00	14,920.00	9.7600	1.0000	14,561.92	14,561.92	-358.08	0.00	-358.08	
11,112	CERN US	CERNER CORP	USD	1,014,038.80	1,014,038.80	93.1400	1.0000	1,034,971.68	1,034,971.68	20,932.88	0.00	20,932.88	
736	CFE US	CF ACQUISITION CORP VIII-A	USD	7,360.00	7,360.00	9.9799	1.0000	7,345.21	7,345.21	-14.79	0.00	-14.79	
1,781	CFIV US	CF ACQUISITION CORP IV-CL A	USD	17,734.13	17,734.13	9.8100	1.0000	17,471.61	17,471.61	-262.52	0.00	-262.52	
750	CHAA US	CATCHA INVESTMENT CORP-A	USD	7,245.00	7,245.00	9.7400	1.0000	7,305.00	7,305.00	60.00	0.00	60.00	
20,651	CHNG US	CHANGE HEALTHCARE INC	USD	466,687.47	466,687.47	21.4200	1.0000	442,344.42	442,344.42	-24,343.05	0.00	-24,343.05	
1,506	CHPM US	CHP MERGER CORP-CLASS A	USD	15,346.14	15,346.14	10.1100	1.0000	15,225.66	15,225.66	-120.48	0.00	-120.48	
1,800	CIIG US	CIIG CAPITAL PARTNERS II-A	USD	18,000.00	18,000.00	9.8400	1.0000	17,712.00	17,712.00	-288.00	0.00	-288.00	
27,905	CIT US	CIT GROUP INC	USD	1,439,391.91	1,439,391.91	50.3000	1.0000	1,403,621.50	1,403,621.50	-35,770.41	0.00	-35,770.41	
1,495	CLAA US	COLONADE ACQUISITION CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7100	1.0000	14,516.45	14,516.45	-433.55	0.00	-433.55	
375	CLAQ US	CLEANTECH ACQUISITION CORP	USD	3,750.00	3,750.00	9.9499	1.0000	3,731.21	3,731.21	-18.79	0.00	-18.79	
353	CLAS US	CLASS ACCELERATION CORP-A	USD	3,395.86	3,395.86	9.7000	1.0000	3,424.10	3,424.10	28.24	0.00	28.24	
1,500	CLBR US	COLOMBIER ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.6200	1.0000	14,430.00	14,430.00	-570.00	0.00	-570.00	
2,212	CLIM US	CLIMATE REAL IMPACT SOLUTI-A	USD	21,977.50	21,977.50	9.7600	1.0000	21,589.12	21,589.12	-388.38	0.00	-388.38	
1,498	CLRM US	CLARM ACQUISITION CORP-CL A	USD	14,980.00	14,980.00	9.7700	1.0000	14,635.46	14,635.46	-344.54	0.00	-344.54	
278	CNDA US	CONCORD ACQUISITION CORP -A	USD	2,727.02	2,727.02	9.7500	1.0000	2,710.50	2,710.50	-16.52	0.00	-16.52	
325	CNTQ US	CHARDAN NEXTECH ACQUISITION	USD	5,250.00	5,250.00	9.9700	1.0000	5,234.25	5,234.25	-15.75	0.00	-15.75	
637	COHR US	COHERENT INC	USD	1,677,550.30	1,677,550.30	265.9200	1.0000	1,738,319.04	1,738,319.04	60,768.74	0.00	60,768.74	
751	COLI US	COLICITY INC-A	USD	7,510.00	7,510.00	9.7300	1.0000	7,307.23	7,307.23	-202.77	0.00	-202.77	
37,735	CONE US	CYRUSONE INC	USD	3,370,784.62	3,370,784.62	90.1800	1.0000	3,402,942.30	3,402,942.30	32,157.68	0.00	32,157.68	
1,540	CONX US	CONX CORP-CLASS A SHARES	USD	1,588.80	1,588.80	9.8100	1.0000	15,107.40	15,107.40	13,518.60	0.00	13,518.60	
2,215	COOL US	CORNER GROWTH ACQUISITION-A	USD	22,150.00	22,150.00	9.7800	1.0000	21,662.70	21,662.70	-487.30	0.00	-487.30	
504	CORS US_20190121	CORSAIR PARTNERING CORP -A	USD	5,040.00	5,040.00	9.6800	1.0000	4,878.72	4,878.72	-161.28	0.00	-161.28	
349	COVA US	CRESCENT COVE ACQUISITION-A	USD	3,378.32	3,378.32	9.7200	1.0000	3,392.28	3,392.28	13.96	0.00	13.96	
9,510	CPAA US	CONVERS PARK III ACQUISITI-A	USD	95,100.00	95,100.00	9.7500	1.0000	92,722.50	92,722.50	-2,377.50	0.00	-2,377.50	
897	CPAR US	CATALYST PARTNERS ACQ-A	USD	8,970.00	8,970.00	9.7100	1.0000	8,709.87	8,709.87	-260.13	0.00	-260.13	
596	CPKT US	CROWN PROPTech ACQUISITION-A	USD	5,960.00	5,960.00	9.8800	1.0000	5,888.48	5,888.48	-71.52	0.00	-71.52	
1,497	CPUH US	COMPUTE HEALTH ACQUISITION-A	USD	14,970.00	14,970.00	9.7400	1.0000	14,580.78	14,580.78	-389.22	0.00	-389.22	
165	CRC US	CALIFORNIA RESOURCES CORP	USD	4,091.89	4,091.89	42.4300	1.0000	7,000.95	7,000.95	2,909.06	0.00	2,909.06	
2,952	CRHC US	COHN ROBBINS HOLDINGS-CL A	USD	1,462.50	1,462.50	9.8200	1.0000	28,988.64	28,988.64	27,526.14	0.00	27,526.14	
1,500	CRU US	CRIBLE ACQUISITION CORP-A	USD	14,976.75	14,976.75	9.7300	1.0000	14,595.00	14,595.00	-381.75	0.00	-381.75	
750	CRZN US	CORAZON CAPITAL V838 MONOC-A	USD	7,353.75	7,353.75	9.7600	1.0000	7,320.00	7,320.00	-33.75	0.00	-33.75	
760	CSTA US	CONSTELLATION ACQUISITION-A	USD	7,600.00	7,600.00	9.7800	1.0000	7,432.80	7,432.80	-167.20	0.00	-167.20	
1,232	CTAQ US	CARNEY TECHNOLOGY ACQU- CL A	USD	0.00	0.00	9.7800	1.0000	12,048.96	12,048.96	12,048.96	0.00	12,048.96	
2,991	CVII US	CHURCHILL CAPITAL CORP VII-A	USD	29,692.50	29,692.50	9.8100	1.0000	29,341.71	29,341.71	-350.79	0.00	-350.79	
900	DCACS NA	DISRUPTIVE CAPITAL ACQUISITI	GBP	8,993.40	12,248.12	9.8450	1.3499	8,860.50	11,960.78	-179.40	-107.94	-287.34	
1,500	DCRD US	DECARBONIZATION PLUS ACQUI-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8728	1.0000	14,809.20	14,809.20	-190.80	0.00	-190.80	
1,484	DGNU US	DRAGONER GROWTH OPP III-A	USD	14,564.21	14,564.21	9.7800	1.0000	14,513.52	14,513.52	-50.69	0.00	-50.69	
1,195	DHBC US	DHB CAPITAL CORP-CL A	USD	11,950.00	11,950.00	9.7500	1.0000	11,651.25	11,651.25	-298.75	0.00	-298.75	
1,495	DHCA US	DHC ACQUISITION CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7300	1.0000	14,546.35	14,546.35	-403.65	0.00	-403.65	
2,213	DHHC US	DIAMONDHEAD HOLDINGS CORP-A	USD	21,942.70	21,942.70	9.7250	1.0000	21,521.45	21,521.45	-421.25	0.00	-421.25	
1,252	DISA US	DISRUPTIVE ACQUISITION COR-A	USD	12,094.32	12,094.32	9.8000	1.0000	12,269.60	12,269.60	175.28	0.00	175.28	
750	DLCA US	DEEP LAKE CAPITAL ACQUIS-CLA	USD	7,500.00	7,500.00	9.7600	1.0000	7,320.00	7,320.00	-180.00	0.00	-180.00	
1,765	DMYS US	DMY TECHNOLOGY GROUP INC VI	USD	17,650.00	17,650.00	9.8200	1.0000	17,332.30	17,332.30	-317.70	0.00	-317.70	
750	DNAA US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	7,405.15	7,405.15	9.9700	1.0000	7,477.50	7,477.50	72.35	0.00	72.35	
750	DNAB US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	7,400.79	7,400.79	9.8500	1.0000	7,387.50	7,387.50	-13.29	0.00	-13.29	
750	DNAC US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	7,407.61	7,407.61	9.8600	1.0000	7,395.00	7,395.00	-12.61	0.00	-12.61	
686	DNAD US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	6,771.76	6,771.76	9.8400	1.0000	6,750.24	6,750.24	-21.52	0.00	-21.52	
748	DNZ US	D AND Z MEDIA ACQUISITION-A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7500	1.0000	7,293.00	7,293.00	-187.00	0.00	-187.00	
752	DRAY US	MACONDRAY CAPITAL AC-CLASS A	USD	7,520.00	7,520.00	9.8500	1.0000	7,407.20	7,407.20	-112.80	0.00	-112.80	
756	DSAQ US	DIRECT SELLING ACQUISITION-A	USD	7,560.00	7,560.00	9.9000	1.0000	7,484.40	7,484.40	-75.60	0.00	-75.60	
1,046	DTOC US	DIGITAL TRANSFORMATION OPP-A	USD	10,460.00	10,460.00	9.7500	1.0000	10,198.50	10,198.50	-261.50	0.00	-261.50	

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	765	DTRT US	DTRT HEALTH ACQ CORP-A	USD	7,650.00	7,650.00	9.9800	1.0000	7,634.70	7,634.70	-15.30	0.00	-15.30
	748	DUNE US	DUNE ACQUISITION CORP-CL A	USD	7,480.00	7,480.00	9.8600	1.0000	7,375.28	7,375.28	-104.72	0.00	-104.72
	598	EGGF US	EG ACQUISITION CORP-A	USD	5,980.00	5,980.00	9.7400	1.0000	5,824.52	5,824.52	-155.48	0.00	-155.48
	750	ENER US_20190121	ACCRETION ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	9.7600	1.0000	7,320.00	7,320.00	-180.00	0.00	-180.00
	2,253	ENNV US	ECP ENVIRONMENTAL GROWTH O-A	USD	22,191.00	22,191.00	9.8950	1.0000	22,293.44	22,293.44	102.44	0.00	102.44
	1,551	ENPC US	EXECUTIVE NETWORK PARTNER-A	USD	0.00	0.00	9.8400	1.0000	15,261.84	15,261.84	15,261.84	0.00	15,261.84
	1,800	ENTF US	ENTERPRISE 4.0 TECHNOLOGY AC	USD	18,000.00	18,000.00	9.8700	1.0000	17,766.00	17,766.00	-234.00	0.00	-234.00
	753	ENVI US	ENVIRONMENTAL IMPACT ACQUI-A	USD	7,530.00	7,530.00	9.9200	1.0000	7,469.76	7,469.76	-60.24	0.00	-60.24
	2,250	EOCW US	ELLIOTT OPPORTUNITY II COR-A	USD	22,500.00	22,500.00	9.7500	1.0000	21,937.50	21,937.50	-562.50	0.00	-562.50
	649	EPAY US	BOTTOMLINE TECHNOLOGIES (DE)	USD	36,935.49	36,935.49	56.4800	1.0000	37,220.32	37,220.32	284.83	0.00	284.83
	747	EPHY US	EPIPHANY TECHNOLOGY ACQ-CL A	USD	7,470.00	7,470.00	9.7700	1.0000	7,298.19	7,298.19	-171.81	0.00	-171.81
	1,029	EPIC NA	EPIC ACQUISITION CORP	EUR	10,279.71	11,600.65	9.7900	1.1325	10,073.91	11,408.70	-233.07	41.12	-191.95
	748	EPWR US	EMPOWERMENT & INCLUSION-CL A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7400	1.0000	7,285.52	7,285.52	-194.48	0.00	-194.48
	1,504	EQD US	EQUITY DISTRIBUTION ACQUIS-A	USD	7,340.00	7,340.00	9.8287	1.0000	14,782.37	14,782.37	7,442.37	0.00	7,442.37
	748	EQHA US	EQ HEALTH ACQUISITION CORP-A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7100	1.0000	7,263.08	7,263.08	-216.92	0.00	-216.92
	1,500	ESAC US	ESGEN ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9000	1.0000	14,850.00	14,850.00	-150.00	0.00	-150.00
	1,343	ESG NA	ESG CORE INVESTMENTS BV	EUR	13,174.83	15,516.00	9.5820	1.1325	12,868.63	14,573.72	-346.77	-595.51	-942.28
	1,495	ESM US	ESM ACQUISITION CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7200	1.0000	14,531.40	14,531.40	-418.60	0.00	-418.60
	1,500	ETAC US	E.MERGE TECHNOLOGY ACQUISIT-A	USD	14,677.50	14,677.50	9.8400	1.0000	14,760.00	14,760.00	82.50	0.00	82.50
	4,501	EVLV US	EVLV TECHNOLOGIES HOLDINGS	USD	43,776.78	43,776.78	4.6000	1.0000	20,704.60	20,704.60	-23,072.18	0.00	-23,072.18
	750	FACA US	FIGURE ACQUISITION CORP I -A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8300	1.0000	7,372.50	7,372.50	-127.50	0.00	-127.50
	451	FACT US	FREEDOM ACQUISITION I CORP-A	USD	4,510.00	4,510.00	9.6900	1.0000	4,370.19	4,370.19	-139.81	0.00	-139.81
	750	FATP US	FAT PROJECTS ACQUISITION COR	USD	7,500.00	7,500.00	9.7400	1.0000	7,305.00	7,305.00	-195.00	0.00	-195.00
	5,371	FBC US	FLAGSTAR BANCORP INC	USD	240,007.19	240,007.19	47.7900	1.0000	256,680.09	256,680.09	16,672.90	0.00	16,672.90
	1,500	FCAX US	FORTRESS CAPITAL ACQUISITI-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7500	1.0000	14,625.00	14,625.00	-375.00	0.00	-375.00
	-1,713	FCNCA US	FIRST CITIZENS BCBSH -CL A	USD	-1,436,574.98	-1,436,574.98	811.0200	1.0000	-1,389,277.26	-1,389,277.26	47,297.72	0.00	47,297.72
	750	FICV US	FRONTIER INVESTMENT CORP -A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7000	1.0000	7,275.00	7,275.00	-225.00	0.00	-225.00
	1,650	FIMM US	MARLIN TECHNOLOGY CORP-A	USD	16,404.00	16,404.00	9.7600	1.0000	16,104.00	16,104.00	-300.00	0.00	-300.00
	19,057	FKR IM	FALCK RENEWABLES SPA	EUR	166,008.98	191,063.08	8.6600	1.1325	165,033.62	186,900.59	-1,104.60	-3,057.89	-4,162.49
	450	FLME US	FLAME ACQUISITION CORP -CL A	USD	4,500.00	4,500.00	9.7200	1.0000	4,374.00	4,374.00	-126.00	0.00	-126.00
	1,800	FLYA US	SOAR TECHNOLOGY ACQUISITIO-A	USD	18,000.00	18,000.00	10.0400	1.0000	18,072.00	18,072.00	72.00	0.00	72.00
	1,465	FMAC US	FIRSTMARK HORIZON ACQUISIT-A	USD	0.00	0.00	9.8900	1.0000	14,488.85	14,488.85	14,488.85	0.00	14,488.85
	1,195	FMIV US	FORUM MERGER IV CORP-A	USD	11,950.00	11,950.00	9.7300	1.0000	11,627.35	11,627.35	-322.65	0.00	-322.65
	675	FNVT US	FINNOVATE ACQUISITION CORP-A	USD	6,750.00	6,750.00	9.8300	1.0000	6,635.25	6,635.25	-114.75	0.00	-114.75
	7,340	FOE US	FERRO CORP	USD	157,400.57	157,400.57	21.8000	1.0000	160,012.00	160,012.00	2,611.43	0.00	2,611.43
	691	FOUN US	FOUNDER SPAC-CL A	USD	6,910.00	6,910.00	9.9500	1.0000	6,875.45	6,875.45	-34.55	0.00	-34.55
	2,280	FPAC US	FAR PEAK ACQUISITION CORP-A	USD	22,878.48	22,878.48	10.0500	1.0000	22,914.00	22,914.00	35.52	0.00	35.52
	748	FRON US	FRONTIER ACQUISITION CORP-A	USD	7,480.00	7,480.00	9.8200	1.0000	7,345.36	7,345.36	-134.64	0.00	-134.64
	597	FRSG US	FIRST RESERVE SUSTAINABLE-A	USD	5,970.00	5,970.00	9.9000	1.0000	5,910.30	5,910.30	-59.70	0.00	-59.70
	748	FRW US	PWP FORWARD ACQUISITION CO-A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7100	1.0000	7,263.08	7,263.08	-216.92	0.00	-216.92
	1,196	FRXB US	FOREST ROAD ACQUISITION CO-A	USD	11,960.00	11,960.00	9.7500	1.0000	11,661.00	11,661.00	-299.00	0.00	-299.00
	2,251	FSNB US	FUSION ACQUISITION CORP II-A	USD	22,510.00	22,510.00	9.6900	1.0000	21,812.19	21,812.19	-697.81	0.00	-697.81
	3,679	FSRX US	FINSERV ACQUISITION CORP-A	USD	36,790.00	36,790.00	9.7500	1.0000	35,870.25	35,870.25	-919.75	0.00	-919.75
	749	FSSI US	FORTISTAR SUSTAINABLE SOLU-A	USD	7,490.00	7,490.00	9.7200	1.0000	7,280.28	7,280.28	-209.72	0.00	-209.72
	441	FST US	FAST ACQUISITION CORP-CL A	USD	4,458.51	4,458.51	10.1600	1.0000	4,480.56	4,480.56	22.05	0.00	22.05
	1,376	FTAA US	FTAC ATHENA ACQUISITION CO-A	USD	13,529.86	13,529.86	9.9114	1.0000	13,638.09	13,638.09	108.23	0.00	108.23
	748	FTEV US	FINTECH EVOLUTION ACQUISIT-A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7200	1.0000	7,270.56	7,270.56	-209.44	0.00	-209.44
	820	FTPA US	FTAC PARNASSUS ACQUISITION-A	USD	8,200.00	8,200.00	9.8400	1.0000	8,068.80	8,068.80	-131.20	0.00	-131.20
	1,500	FTVI US	FINTECH ACQUISITION CORP -A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8200	1.0000	14,730.00	14,730.00	-270.00	0.00	-270.00
	2,205	FVIV US	FORTRESS VALUE ACQUIS IV-A	USD	21,629.10	21,629.10	9.7400	1.0000	21,476.70	21,476.70	-152.40	0.00	-152.40
	2,250	FVT US	FORTRESS VALUE ACQUISITION-A	USD	22,500.00	22,500.00	9.7750	1.0000	21,993.75	21,993.75	-506.25	0.00	-506.25
	1,482	FWAC US	FIFTH WALL ACQUISITION COR-A	USD	14,526.12	14,526.12	9.8500	1.0000	14,597.70	14,597.70	71.58	0.00	71.58
	1,230	FZT US	FAST ACQUISITION CORP II-A	USD	12,300.00	12,300.00	9.7300	1.0000	11,967.90	11,967.90	-332.10	0.00	-332.10

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
1,095	GACQ	US	GLOBAL CONSUMER ACQUISITION	USD	10,950.00	10,950.00	9.8700	1.0000	10,807.65	10,807.65	-142.35	0.00	-142.35
735	GATE	US	MARBLEGATE ACQUISITION CORP-A	USD	7,203.00	7,203.00	9.7700	1.0000	7,180.95	7,180.95	-22.05	0.00	-22.05
1,650	GFJ1	GR	GFJ ESG ACQUISITION I SE - A	EUR	16,493.50	19,122.51	9.9500	1.1325	16,417.50	18,592.82	-74.75	-454.94	-529.69
1,049	GFOR	US	GRAF ACQUISITION CORP IV	USD	10,301.00	10,301.00	9.6900	1.0000	10,164.81	10,164.81	-136.19	0.00	-136.19
616	GFX	US	GOLDEN FALCON ACQUISITI-CL A	USD	0.00	0.00	9.7700	1.0000	6,018.32	6,018.32	6,018.32	0.00	6,018.32
1,199	GHAC	US	GAMING & HOSPITALITY ACQUI-A	USD	11,990.00	11,990.00	9.8100	1.0000	11,762.19	11,762.19	-227.81	0.00	-227.81
600	GIA	US	GIGCAPITAL5 INC	USD	6,000.00	6,000.00	9.8900	1.0000	5,934.00	5,934.00	-66.00	0.00	-66.00
2,970	GIAC	US	GESHER I ACQUISITION CORP-A	USD	29,700.00	29,700.00	9.7759	1.0000	29,034.42	29,034.42	-665.58	0.00	-665.58
904	GIIX	US	GORES HOLDINGS VIII INC-CL A	USD	8,962.00	8,962.00	10.1600	1.0000	9,184.64	9,184.64	222.64	0.00	222.64
1,501	GLBL	US	CARTESIAN GROWTH CORP-A	USD	14,934.82	14,934.82	9.8800	1.0000	14,829.88	14,829.88	-104.94	0.00	-104.94
750	GLTA	US	GALATA ACQUISITION CORP - A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8900	1.0000	7,417.50	7,417.50	-82.50	0.00	-82.50
1,500	GNAC	US	GROUP NINE ACQUISITION -CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7800	1.0000	14,670.00	14,670.00	-330.00	0.00	-330.00
1,500	GOAC	US	GO ACQUISITION CORP-CLASS A	USD	14,760.00	14,760.00	9.8400	1.0000	14,760.00	14,760.00	0.00	0.00	0.00
750	GOGN	US	GOGREEN INVESTMENTS CORP	USD	7,500.00	7,500.00	9.9000	1.0000	7,425.00	7,425.00	-75.00	0.00	-75.00
900	GPAC	US	GLOBAL PARTNER ACQUISITION-A	USD	8,971.44	8,971.44	9.7000	1.0000	8,730.00	8,730.00	-241.44	0.00	-241.44
-150	GS	US	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	-60,094.21	-60,094.21	385.5200	1.0000	-57,828.00	-57,828.00	2,266.21	0.00	2,266.21
747	GSAQ	US	GLOBAL SYNERGY ACQUISITION-A	USD	7,470.00	7,470.00	9.8200	1.0000	7,335.54	7,335.54	-134.46	0.00	-134.46
2,252	GSEV	US	GORES HOLDINGS VII INC-A	USD	22,520.00	22,520.00	9.7600	1.0000	21,979.52	21,979.52	-540.48	0.00	-540.48
5,093	GSKY	US	GREENSKY INC-CLASS A	USD	60,207.09	60,207.09	11.4300	1.0000	58,212.99	58,212.99	-1,994.10	0.00	-1,994.10
450	GSQB	US	G SQUARED ASCEND II INC -A	USD	4,500.00	4,500.00	9.7800	1.0000	4,401.00	4,401.00	-99.00	0.00	-99.00
1,199	GSQD	US	G SQUARED ASCEND I INC-CL A	USD	11,927.00	11,927.00	9.9300	1.0000	11,906.07	11,906.07	-20.93	0.00	-20.93
1,500	GTPA	US	GORES TECHNOLOGY PARTNERS-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9100	1.0000	14,865.00	14,865.00	-135.00	0.00	-135.00
1,495	GTPB	US	GORES TECHNOLOGY PTRNR II-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.8100	1.0000	14,665.95	14,665.95	-284.05	0.00	-284.05
750	GWII	US	GOOD WORKS II ACQUISITION CO	USD	7,500.00	7,500.00	9.7900	1.0000	7,342.50	7,342.50	-157.50	0.00	-157.50
746	GXII	US	GX ACQUISITION CORP II-A	USD	7,460.00	7,460.00	9.7100	1.0000	7,243.66	7,243.66	-216.34	0.00	-216.34
1,493	HAAC	US	HEALTH ASSURANCE ACQUISIT-A	USD	6,000.00	6,000.00	9.7700	1.0000	14,586.61	14,586.61	8,586.61	0.00	8,586.61
750	HCAR	US	HEALTHCARE SERVICES ACQUI-A	USD	7,230.00	7,230.00	9.7700	1.0000	7,327.50	7,327.50	97.50	0.00	97.50
404	HCIU	US	HENNESSY CAPITAL INVESTMEN-A	USD	4,015.76	4,015.76	9.8000	1.0000	3,959.20	3,959.20	-56.56	0.00	-56.56
725	HCIU	US	HUDSON EXECUTIVE INVESTMENT	USD	7,213.33	7,213.33	9.7500	1.0000	7,068.75	7,068.75	-144.58	0.00	-144.58
1,500	HUNE	US	JAWS HURRICANE ACQUISITION-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8000	1.0000	14,700.00	14,700.00	-300.00	0.00	-300.00
1,502	HEGA	NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN GROWTH	EUR	0.00	0.00	9.9800	1.1325	14,989.96	16,976.13	16,976.13	0.00	16,976.13
2,785	HEIA	NA	HEINEKEN NV	EUR	250,098.69	278,997.47	99.4600	1.1325	276,996.10	313,698.09	30,461.31	4,239.31	34,700.62
-2,827	HEIO	NA	HEINEKEN HOLDING NV	EUR	-234,019.53	-260,830.77	82.2500	1.1325	-232,520.75	-263,329.75	1,697.37	-4,196.35	-2,498.98
1,495	HERA	US	FTAC HERA ACQUISITION CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7500	1.0000	14,576.25	14,576.25	-373.75	0.00	-373.75
527	HHLA	US	HH&L ACQUISITION CO -CLASS A	USD	5,089.62	5,089.62	9.7300	1.0000	5,127.71	5,127.71	38.09	0.00	38.09
1,506	HIGA	US	HIG ACQUISITION CORP-CLASS A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	14,758.80	14,758.80	14,758.80	0.00	14,758.80
831	HIII	US	HUDSON EXECUTIVE INVESTMEN-A	USD	8,310.00	8,310.00	9.7300	1.0000	8,085.63	8,085.63	-224.37	0.00	-224.37
750	HIAH	US	HAMILTON LANE ALL-CLASS A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7600	1.0000	7,320.00	7,320.00	-180.00	0.00	-180.00
588	HPA1	LN	HAMBRO PERKS ACQ-CLASS A	GBP	5,880.00	7,836.86	10.0750	1.3499	5,924.10	7,996.94	59.53	100.55	160.08
5,940	HPLT	US	HOME PLATE ACQUISITION -CL A	USD	59,400.00	59,400.00	9.7400	1.0000	57,855.60	57,855.60	-1,544.40	0.00	-1,544.40
1,800	HTPA	US	HIGHLAND TRANSCEND PART-CL A	USD	2,958.00	2,958.00	9.9200	1.0000	17,856.00	17,856.00	14,898.00	0.00	14,898.00
300	HWEL	US	HEALTHWELL ACQUISITION CORP-A	USD	3,000.00	3,000.00	9.6850	1.0000	2,905.50	2,905.50	-94.50	0.00	-94.50
1,048	HYAC	US	HAYMARKER ACQUISITION CORP-A	USD	10,372.00	10,372.00	9.8100	1.0000	10,280.88	10,280.88	-91.12	0.00	-91.12
1,462	HZON	US	HORIZON ACQUIS CORP II -CL A	USD	5,431.49	5,431.49	9.8500	1.0000	14,400.70	14,400.70	8,969.21	0.00	8,969.21
2,991	IACC	US	ION ACQUISITION CORP 3 LTD-A	USD	29,749.50	29,749.50	9.7500	1.0000	29,162.25	29,162.25	-587.25	0.00	-587.25
1,500	ICNC	US	ICONIC SPORTS ACQ CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9000	1.0000	14,850.00	14,850.00	-150.00	0.00	-150.00
752	IGAC	US	IG ACQUISITION CORP-CLASS A	USD	0.00	0.00	9.8200	1.0000	7,384.64	7,384.64	7,384.64	0.00	7,384.64
1,205	IIII	US	INSU ACQUISITION CORP III-A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	11,809.00	11,809.00	11,809.00	0.00	11,809.00
-5,934	IIVI	US	II-VI INC	USD	-388,474.69	-388,474.69	68.2000	1.0000	-404,698.80	-404,698.80	-16,224.11	0.00	-16,224.11
738	IMPX	US	AEA-BRIDGES IMPACT CORP-CL A	USD	1,971.82	1,971.82	9.9900	1.0000	7,372.62	7,372.62	5,401.10	0.00	5,401.10
2,187	INDUA	SS	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	SEK	627,781.72	69,324.59	288.4000	9.0427	630,730.80	69,750.27	326.13	99.55	425.68
-2,187	INDUC	SS	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	SEK	-615,624.27	-67,982.14	284.1000	9.0427	-621,326.70	-68,710.31	-630.60	-97.57	-728.17
47,610	INFO	US	IHS MARKIT LTD	USD	4,625,869.87	4,625,869.87	132.3300	1.0000	6,300,231.30	6,300,231.30	1,674,361.43	0.00	1,674,361.43

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	13,039	INTER NA	INTERTRUST NV	EUR	257,551.33	290,921.94	19.6200	1.1325	255,825.18	289,722.03	-1,954.85	754.94	-1,199.91
	1,500	IPOD US	SOCIAL CAPITAL HEDOSOPH-A	USD	0.00	0.00	10.2300	1.0000	15,345.00	15,345.00	0.00	0.00	15,345.00
	1,505	IPOF US	SOCIAL CAPITAL HEDOSOPH VI-A	USD	4,486.50	4,486.50	10.2100	1.0000	15,366.05	15,366.05	10,879.55	0.00	10,879.55
	2,119	IPVA US	INTERPRIVATE II ACQ-CLASS A	USD	21,190.00	21,190.00	9.7100	1.0000	20,575.49	20,575.49	-614.51	0.00	-614.51
	2,096	IPVF US	INTERPRIVATE III FINANCIAL-A	USD	20,960.00	20,960.00	9.9100	1.0000	20,771.36	20,771.36	-188.64	0.00	-188.64
	1,643	IPVI US	INTERPRIVATE IV INFRA TECH-A	USD	16,430.00	16,430.00	9.7600	1.0000	16,035.68	16,035.68	-394.32	0.00	-394.32
	600	ITQ US	ITIQVIRA ACQUISITION CORP-A	USD	6,000.00	6,000.00	9.7400	1.0000	5,844.00	5,844.00	-156.00	0.00	-156.00
	1,500	JAQC US	JUPLITER ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.6000	1.0000	14,400.00	14,400.00	-600.00	0.00	-600.00
	750	JATT US	JATT ACQUISITION CORP - A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8500	1.0000	7,387.50	7,387.50	-112.50	0.00	-112.50
	748	JCIC US	JACK CREEK INVESTMENT C-CL A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7500	1.0000	7,293.00	7,293.00	-187.00	0.00	-187.00
	750	JMAC US	MAXPRO CAPITAL ACQUISITION-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.9300	1.0000	7,447.50	7,447.50	-52.50	0.00	-52.50
	753	JOFF US	JOFF FINTECH ACQ CORP-A	USD	7,530.00	7,530.00	9.8500	1.0000	7,417.05	7,417.05	-112.95	0.00	-112.95
	1,500	JUGG US	JAWS JUGGERNAUT ACQUISITIO-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8200	1.0000	14,730.00	14,730.00	-270.00	0.00	-270.00
	2,250	JWSM US	JAWS MUSTANG ACQUISITION C-A	USD	22,500.00	22,500.00	9.7600	1.0000	21,960.00	21,960.00	-540.00	0.00	-540.00
	1,495	KAHC US	KKR ACQUISITION HOLDINGS I-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7500	1.0000	14,576.25	14,576.25	-373.75	0.00	-373.75
	1,199	KAIR US	KAIROS ACQUISITION CORP-A	USD	11,990.00	11,990.00	9.7900	1.0000	11,738.21	11,738.21	-251.79	0.00	-251.79
	2,206	KCGI US	KENSINGTON CAPITAL ACQ-A	USD	22,060.00	22,060.00	9.8300	1.0000	21,684.98	21,684.98	-375.02	0.00	-375.02
	1,349	KLAQ US	KL ACQUISITION CORP/MO-CLS A	USD	13,490.00	13,490.00	9.8000	1.0000	13,220.20	13,220.20	-269.80	0.00	-269.80
	1,117	KRA US	KRATON CORP	USD	51,548.48	51,548.48	46.3300	1.0000	51,750.61	51,750.61	202.13	0.00	202.13
	1,348	KRNL US	KERNEL GROUP HOLDINGS INC-A	USD	13,480.00	13,480.00	9.7400	1.0000	13,129.52	13,129.52	-350.48	0.00	-350.48
	753	KVSC US	KHOSLA VENTURES ACQUISITIO-A	USD	7,462.45	7,462.45	9.7600	1.0000	7,349.28	7,349.28	-113.17	0.00	-113.17
	1,494	LCA US	LANDCAPIA HOLDINGS IV INC-A	USD	14,940.00	14,940.00	9.7300	1.0000	14,536.62	14,536.62	-403.38	0.00	-403.38
	746	LCAA US	L CATTERTON ASIA ACQ-CLASS A	USD	7,460.00	7,460.00	9.7300	1.0000	7,258.58	7,258.58	-201.42	0.00	-201.42
	1,500	LWC US	LEARN CO INVESTMENT CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9900	1.0000	14,985.00	14,985.00	-15.00	0.00	-15.00
	1,498	LDHA US	LDH GROWTH CORP I-CLASS A	USD	14,934.38	14,934.38	9.8306	1.0000	14,726.25	14,726.25	-208.13	0.00	-208.13
	452	LEAP US	RIBBIT LEAP LTD - CLASS A	USD	20.31	20.31	10.0200	1.0000	4,529.04	4,529.04	4,508.73	0.00	4,508.73
	896	LEGA US	LEAD EDGE GROWTH OPPORTUNI-A	USD	8,960.00	8,960.00	9.7600	1.0000	8,744.96	8,744.96	-215.04	0.00	-215.04
	1,500	LEFR US	LEFTERIS ACQUISITION CORP -A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	14,700.00	14,700.00	14,700.00	0.00	14,700.00
	1,497	LGAC US	LAZARD GROWTH ACQUISITION CO	USD	14,970.00	14,970.00	9.7400	1.0000	14,580.78	14,580.78	-389.22	0.00	-389.22
	2,092	LGV US	LONGVIEW ACQUISITION CORP -A	USD	20,512.06	20,512.06	9.8100	1.0000	20,522.52	20,522.52	10.46	0.00	10.46
	2,242	LHAA US	LERER HIPPEAU ACQUISITION-A	USD	22,420.00	22,420.00	9.8000	1.0000	21,971.60	21,971.60	-448.40	0.00	-448.40
	1,498	LHC US	LEO HOLDINGS CORP II-CLASS A	USD	14,980.00	14,980.00	9.7500	1.0000	14,605.50	14,605.50	-374.50	0.00	-374.50
	585	LITT US	LOGISTICS INNOVATION TECH-A	USD	5,850.00	5,850.00	9.6800	1.0000	5,662.80	5,662.80	-187.20	0.00	-187.20
	445	LMACA US	LIBERTY MEDIA ACQUISITION -A	USD	4,532.79	4,532.79	10.2700	1.0000	4,570.15	4,570.15	37.36	0.00	37.36
	449	LNFA US	L&F ACQUISITION CORP/IL -A	USD	0.00	0.00	10.0200	1.0000	4,498.98	4,498.98	4,498.98	0.00	4,498.98
	1,620	LOCC US	LIVE OAK CRESTVIEW CLIMATE-A	USD	16,200.00	16,200.00	9.7500	1.0000	15,795.00	15,795.00	-405.00	0.00	-405.00
	1,510	LOKM US	LIVE OAK MOBILITY ACQUISIT-A	USD	15,064.54	15,064.54	9.7700	1.0000	14,752.70	14,752.70	-311.84	0.00	-311.84
	750	LUXA US	LUX HEALTH TECH ACQUIS-CL A	USD	0.00	0.00	9.8100	1.0000	7,357.50	7,357.50	7,357.50	0.00	7,357.50
	1,495	LVRA US	LEVERE HOLDINGS CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7500	1.0000	14,576.25	14,576.25	-373.75	0.00	-373.75
	448	MACC US	MISSION ADVANCEMENT CORP-A	USD	4,480.00	4,480.00	9.7200	1.0000	4,354.56	4,354.56	-125.44	0.00	-125.44
	300	MAQC US	MAQUIA CAPITAL ACQUISITION-A	USD	3,000.00	3,000.00	10.0300	1.0000	3,009.00	3,009.00	9.00	0.00	9.00
	1,496	MBAC US	M3-BRIGADE ACQUISITION II-A	USD	14,908.09	14,908.09	9.9200	1.0000	14,840.32	14,840.32	-67.77	0.00	-67.77
	1,200	MBSC US	M3-BRIGADE ACQUISITION -CL A	USD	12,000.00	12,000.00	9.8300	1.0000	11,796.00	11,796.00	-204.00	0.00	-204.00
	20,036	MCFE US	MCAFEES CORP - CLASS A	USD	513,738.45	513,738.45	25.7500	1.0000	515,927.00	515,927.00	2,188.55	0.00	2,188.55
	753	MDH US	MDH ACQUISITION CORP -CL A	USD	7,375.50	7,375.50	9.7900	1.0000	7,342.50	7,342.50	-33.00	0.00	-33.00
	1,050	MEAC US	MERCURY ECOMMERCE ACQUISIT-A	USD	10,500.00	10,500.00	9.8000	1.0000	10,290.00	10,290.00	-210.00	0.00	-210.00
	9,968	MGLN US	MAGELLAN HEALTH INC	USD	939,230.51	939,230.51	94.9800	1.0000	946,760.64	946,760.64	7,470.13	0.00	7,470.13
	37,391	MGP US	MGM GROWTH PROPERTIES LLC-A	USD	1,481,894.89	1,481,894.89	40.5500	1.0000	1,516,205.05	1,516,205.05	34,310.16	0.00	34,310.16
	8,833	MIME US	MIMECAST LTD	USD	699,167.39	699,167.39	79.3600	1.0000	700,986.88	700,986.88	1,819.49	0.00	1,819.49
	1,497	MIT US	MASON INDUSTRIAL TECHN-CL A	USD	14,898.00	14,898.00	9.7300	1.0000	14,565.81	14,565.81	-332.19	0.00	-332.19
	750	MITA US	COLISEUM ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7200	1.0000	7,290.00	7,290.00	-210.00	0.00	-210.00
	-303	MKSI US	MKS INSTRUMENTS INC	USD	-49,784.26	-49,784.26	174.7500	1.0000	-52,949.25	-52,949.25	-3,164.99	0.00	-3,164.99
	5,583	MNR US	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	USD	116,065.56	116,065.56	20.9900	1.0000	117,187.17	117,187.17	1,121.61	0.00	1,121.61

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
1,500	MON	US	MONUMENT CIRCLE ACQUI-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7500	1.0000	14,625.00	14,625.00	-375.00	0.00	-375.00
1,504	MOTV	US	MOTIVE CAPITAL CORP -CL A	USD	4,946.61	4,946.61	9.8900	1.0000	14,874.56	14,874.56	9,927.95	0.00	9,927.95
1,469	MSDA	US	MSD ACQUISITION CORP-A	USD	14,633.00	14,633.00	9.8900	1.0000	14,528.41	14,528.41	-104.59	0.00	-104.59
750	MTAL	US	METALS ACQUISITION CORP-CL A	USD	7,500.00	7,500.00	9.6900	1.0000	7,267.50	7,267.50	-232.50	0.00	-232.50
-3,502	MTB	US	M & T BANK CORP	USD	-555,282.57	-555,282.57	153.1800	1.0000	-536,436.36	-536,436.36	18,826.21	0.00	18,826.21
600	MTRY	US	MONTEREY BIO ACQUISITION COR	USD	6,000.00	6,000.00	9.8500	1.0000	5,910.00	5,910.00	-90.00	0.00	-90.00
751	MUDS	US	MUDRICK CAPITAL ACQUISITIO-A	USD	7,406.23	7,406.23	9.9400	1.0000	7,464.94	7,464.94	58.71	0.00	58.71
4,455	NAAC	US	NORTH ATLANTIC ACQUISITION-A	USD	44,550.00	44,550.00	9.8400	1.0000	43,837.20	43,837.20	-712.80	0.00	-712.80
1,500	NCAC	US	NEWCOURT ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8800	1.0000	14,820.00	14,820.00	-180.00	0.00	-180.00
1,196	NDAC	US	NIGHTDRAGON ACQUISITION CO-A	USD	11,960.00	11,960.00	9.7700	1.0000	11,684.92	11,684.92	-275.08	0.00	-275.08
610	NGC	US	NORTHERN GENESIS ACQUISITI-A	USD	6,100.00	6,100.00	9.7199	1.0000	5,929.14	5,929.14	-170.86	0.00	-170.86
5,197	NHIC	US	NEWHOLD INVESTMENT CORP II-A	USD	51,970.00	51,970.00	9.8899	1.0000	51,397.81	51,397.81	-572.19	0.00	-572.19
300	NLIT	US	NORTHERN LIGHTS ACQUISITI-A	USD	3,000.00	3,000.00	10.0500	1.0000	3,015.00	3,015.00	15.00	0.00	15.00
1,500	NMMC	US	NORTH MOUNTAIN MERGER CORP-A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	14,700.00	14,700.00	14,700.00	0.00	14,700.00
1,523	NOAC	US	NATURAL ORDER ACQUISITION CO	USD	0.00	0.00	9.7900	1.0000	14,910.17	14,910.17	14,910.17	0.00	14,910.17
454	NSTC	US	NORTHERN STAR INVESTMENT -A	USD	4,538.54	4,538.54	9.7500	1.0000	4,426.50	4,426.50	-112.04	0.00	-112.04
448	NSTD	US	NORTHERN STAR INVESTMENT -A	USD	4,480.00	4,480.00	9.7200	1.0000	4,354.56	4,354.56	-125.44	0.00	-125.44
114,134	NUAN	US	NUANCE COMMUNICATIONS INC	USD	6,168,885.07	6,168,885.07	55.3200	1.0000	6,313,892.88	6,313,892.88	145,007.81	0.00	145,007.81
452	NVSA	US	NEW VISTA ACQUISITION CORP-A	USD	4,519.68	4,519.68	9.7474	1.0000	4,405.83	4,405.83	-113.85	0.00	-113.85
608	NXU	US	NOVUS CAPITAL CORP II-A	USD	6,015.50	6,015.50	9.9225	1.0000	6,032.88	6,032.88	17.38	0.00	17.38
-21,569	NYCB	US	NEW YORK COMMUNITY BANCORP	USD	-251,293.30	-251,293.30	12.2100	1.0000	-263,357.49	-263,357.49	-12,064.19	0.00	-12,064.19
2,247	OACB	US	OAKTREE ACQ CORP II - CL A	USD	4,965.00	4,965.00	9.8700	1.0000	22,177.89	22,177.89	17,212.89	0.00	17,212.89
1,500	OEPW	US	ONE EQUITY PARTNERS OPEN-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7200	1.0000	14,580.00	14,580.00	-420.00	0.00	-420.00
748	OHPA	US	ORION ACQUISITION CORP-CL A	USD	7,480.00	7,480.00	9.7400	1.0000	7,285.52	7,285.52	-194.48	0.00	-194.48
1,500	ONYX	US	ONYX ACQUISITION CO I-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9100	1.0000	14,865.00	14,865.00	-135.00	0.00	-135.00
735	OPA	US	MAGNUM OPUS ACQUISITION LT-A	USD	7,232.40	7,232.40	9.9300	1.0000	7,298.55	7,298.55	66.15	0.00	66.15
747	ORIA	US	ORION BIOTECH OPPORTUNITI-A	USD	7,470.00	7,470.00	9.6716	1.0000	7,224.69	7,224.69	-245.31	0.00	-245.31
747	OSI	US	OSIRIS ACQUISITION CORP-A	USD	7,470.00	7,470.00	9.7000	1.0000	7,245.90	7,245.90	-224.10	0.00	-224.10
991	OTA	GR	OBOTECH ACQUISITION SE - A	EUR	9,563.15	11,480.56	9.8000	1.1325	9,711.80	10,998.61	168.34	-650.29	-481.95
750	OTEC	US	OCEANTECH ACQUISITIONS- CL A	USD	7,500.00	7,500.00	9.9800	1.0000	7,485.00	7,485.00	-15.00	0.00	-15.00
750	OXAC	US	OXBRIDGE ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	9.9000	1.0000	7,425.00	7,425.00	-75.00	0.00	-75.00
750	OXUS	US	OXUS ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8800	1.0000	7,410.00	7,410.00	-90.00	0.00	-90.00
597	PACE	NA	PEGASUS ACQUISITION CO EUR-A	EUR	5,970.00	7,086.39	10.0000	1.1325	5,970.00	6,761.03	0.00	-325.36	-325.36
434	PACX	US	PIONEER MERGER CORP -CLASS A	USD	4,340.00	4,340.00	9.8800	1.0000	4,287.92	4,287.92	-52.08	0.00	-52.08
30,041	PAE	US	PAE INC	USD	297,649.53	297,649.53	9.9200	1.0000	298,006.72	298,006.72	357.19	0.00	357.19
600	PBAX	US	PHOENIX BIOTECH ACQUI-CL A	USD	6,000.00	6,000.00	9.9200	1.0000	5,952.00	5,952.00	-48.00	0.00	-48.00
29,709	PBCT	US	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	USD	548,102.91	548,102.91	17.7000	1.0000	525,849.30	525,849.30	-22,253.61	0.00	-22,253.61
600	PCPC	US	PERIPHAS CAPITAL PARTNR-CL A	USD	0.00	0.00	24.3100	1.0000	14,586.00	14,586.00	14,586.00	0.00	14,586.00
2,941	PDOT	US	PERIDOT ACQUISITION CORP-A	USD	29,410.00	29,410.00	9.7000	1.0000	28,527.70	28,527.70	-882.30	0.00	-882.30
750	PEPL	US	PEPPERLIME HEALTH ACQ - A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7300	1.0000	7,297.50	7,297.50	-202.50	0.00	-202.50
756	PFDR	US	PATHFINDER ACQUISITION -CL A	USD	7,452.00	7,452.00	9.7150	1.0000	7,344.54	7,344.54	-107.46	0.00	-107.46
750	PFTA	US	PORTAGE FINTECH ACQUISITIO-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7200	1.0000	7,290.00	7,290.00	-210.00	0.00	-210.00
829	PHIC	US	POPULATION HEALTH INVEST-A	USD	3,000.00	3,000.00	9.8300	1.0000	8,149.07	8,149.07	5,149.07	0.00	5,149.07
1,505	PIAI	US	PRIME IMPACT ACQU I -CL A	USD	0.00	0.00	9.8100	1.0000	14,764.05	14,764.05	14,764.05	0.00	14,764.05
736	PICC	US	PIVOTAL INVESTMENT CORP III-A	USD	7,230.64	7,230.64	9.7700	1.0000	7,190.72	7,190.72	-39.92	0.00	-39.92
302	PIPP	US	PINE ISLAND ACQUISITION-CL A	USD	1,650.00	1,650.00	9.8500	1.0000	2,974.70	2,974.70	1,324.70	0.00	1,324.70
750	PLMI	US	PLUM ACQUISITION CORP I-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7300	1.0000	7,297.50	7,297.50	-202.50	0.00	-202.50
1,500	PMGM	US	PRIVETERA ACQUISITION COR-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7100	1.0000	14,565.00	14,565.00	-435.00	0.00	-435.00
1,500	PMVC	US	PMV CONSUMER ACQUISITION-A	USD	0.00	0.00	9.8100	1.0000	14,715.00	14,715.00	14,715.00	0.00	14,715.00
1,496	PNTM	US	PONTEM CORP-CLASS A	USD	14,960.00	14,960.00	9.7800	1.0000	14,630.88	14,630.88	-329.12	0.00	-329.12
750	POND	US	ANGEL POND HOLDINGS CORP-A	USD	7,237.50	7,237.50	9.7400	1.0000	7,305.00	7,305.00	67.50	0.00	67.50
1,500	POW	US	POWERED BRANDS - CLASS A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7900	1.0000	14,685.00	14,685.00	-315.00	0.00	-315.00
755	PPGH	US	POEMA GLOBAL HOLDINGS CORP-A	USD	7,509.60	7,509.60	9.8800	1.0000	7,459.40	7,459.40	-50.20	0.00	-50.20

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	1,769	PRPB US	CC NEUBERGER PRINCIPAL II-A	USD	17,659.35	17,659.35	9.9200	1.0000	17,548.48	17,548.48	-110.87	0.00	-110.87
	1,304	PRPC US	CC NEUBERGER PRINCIPAL III-A	USD	13,016.08	13,016.08	9.8700	1.0000	12,870.48	12,870.48	-145.60	0.00	-145.60
	1,497	PRSR US	PROSPECTOR CAPITAL CORP-CL A	USD	14,929.50	14,929.50	9.7371	1.0000	14,576.44	14,576.44	-353.06	0.00	-353.06
	857	PSAG US	PROPERTY SOLUTIONS ACQUISIT-A	USD	8,534.26	8,534.26	9.7000	1.0000	8,312.90	8,312.90	-221.36	0.00	-221.36
	1,500	PTIC US	PROPTECH INVESTMENT CORP-A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	14,700.00	14,700.00	14,700.00	0.00	14,700.00
	748	PTOC US	PINE TECHNOLOGY ACQUISIT-CL A	USD	7,480.00	7,480.00	9.8500	1.0000	7,367.80	7,367.80	-112.20	0.00	-112.20
	1,199	PV US	PRIMAVERA CAPITAL ACQUISIT-A	USD	11,776.40	11,776.40	9.7200	1.0000	11,654.28	11,654.28	-122.12	0.00	-122.12
	300	RACB US	RESEARCH ALLIANCE CORP II-A	USD	2,913.00	2,913.00	9.7700	1.0000	2,931.00	2,931.00	18.00	0.00	18.00
	235	RCLF US	ROSECLIFF ACQUISITION CORP-A	USD	2,317.10	2,317.10	9.8101	1.0000	2,305.37	2,305.37	-11.73	0.00	-11.73
	450	REVE US	ALPINE ACQUISITION CORP	USD	4,500.00	4,500.00	10.0100	1.0000	4,504.50	4,504.50	4.50	0.00	4.50
	1,496	REVH US	REVOLUTION HEALTHCARE ACQU-A	USD	19,460.00	19,460.00	9.7200	1.0000	18,915.12	18,915.12	-544.88	0.00	-544.88
	441	RICO US	AGRICO ACQUISITION CORP-A	USD	4,410.00	4,410.00	10.0600	1.0000	4,436.46	4,436.46	26.46	0.00	26.46
	1,186	RKTA US	ROCKET INTERNET GROWTH OPP-A	USD	11,764.30	11,764.30	9.7700	1.0000	11,587.22	11,587.22	-177.08	0.00	-177.08
	2,247	RMGC US	RMG ACQUISITION CORP III -A	USD	22,470.00	22,470.00	9.7600	1.0000	21,930.72	21,930.72	-539.28	0.00	-539.28
	600	ROCG US	ROTH CH ACQUISITION IV CO	USD	6,000.00	6,000.00	9.8500	1.0000	5,910.00	5,910.00	-90.00	0.00	-90.00
	2,703	ROG US	ROGERS CORP	USD	731,684.93	731,684.93	273.0800	1.0000	738,135.24	738,135.24	6,450.31	0.00	6,450.31
	1,500	RONI US	RICE ACQUISITION CORP II -A	USD	15,000.00	15,000.00	10.0300	1.0000	15,045.00	15,045.00	45.00	0.00	45.00
	750	ROSE US	ROSE HILL ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.9100	1.0000	7,432.50	7,432.50	-67.50	0.00	-67.50
	1,496	ROSS US	ROSS ACQUISITION CORP II -A	USD	14,960.00	14,960.00	9.7400	1.0000	14,571.04	14,571.04	-388.96	0.00	-388.96
	600	RVAC US	RIVERVIEW ACQUISITION CORP-A	USD	6,000.00	6,000.00	9.7400	1.0000	5,844.00	5,844.00	-156.00	0.00	-156.00
	1,500	RXRA US	RXR ACQUISITION CORP- CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7199	1.0000	14,579.86	14,579.86	-420.14	0.00	-420.14
	765	SANB US	SANABY HEALTH ACQ CORP - A	USD	7,650.00	7,650.00	9.9000	1.0000	7,573.50	7,573.50	-76.50	0.00	-76.50
	756	SBEA US	SILVERBOX ENGAGED MERGER C-A	USD	7,560.00	7,560.00	10.1000	1.0000	7,635.60	7,635.60	75.60	0.00	75.60
	2,096	SBII US	SANDBRIDGE X2 CORP-A	USD	20,699.00	20,699.00	9.7400	1.0000	20,415.04	20,415.04	-283.96	0.00	-283.96
	1,494	SCAQ US	STRATIM CLOUD ACQUISITION CO	USD	14,940.00	14,940.00	9.7300	1.0000	14,536.62	14,536.62	-403.38	0.00	-403.38
	1,793	SCLE US	BROADSCALE ACQUISITION -CL A	USD	17,788.65	17,788.65	9.8400	1.0000	17,643.12	17,643.12	-145.53	0.00	-145.53
	1,047	SCOA US	SCION TECH GROWTH I-CLASS A	USD	0.00	0.00	9.7600	1.0000	10,218.72	10,218.72	10,218.72	0.00	10,218.72
	750	SCOB US	SCION TECH GROWTH II-CLASS A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7200	1.0000	7,290.00	7,290.00	-210.00	0.00	-210.00
	496	SCPL US	SCIPLAY CORP-CLASS A	USD	7,537.60	7,537.60	13.6400	1.0000	6,765.44	6,765.44	-772.16	0.00	-772.16
	739	SCVX US	SCVX CORP - CLASS A	USD	7,390.00	7,390.00	9.9850	1.0000	7,378.92	7,378.92	-11.08	0.00	-11.08
	1,549	SDAC US	SUSTAINABLE DEVELOPMENT AC-A	USD	15,431.42	15,431.42	9.7300	1.0000	15,071.77	15,071.77	-359.65	0.00	-359.65
	825	SGII US_20190121	SEAPORT GLOBAL ACQUISITION-A	USD	8,250.00	8,250.00	9.8700	1.0000	8,142.75	8,142.75	-107.25	0.00	-107.25
	-124	SGMS US	SCIENTIFIC GAMES CORP	USD	-7,565.93	-7,565.93	67.1800	1.0000	-8,330.32	-8,330.32	-764.39	0.00	-764.39
	5,197	SHAC US	SCP & CO HEALTHCARE ACQUIS-A	USD	51,970.00	51,970.00	9.7600	1.0000	50,722.72	50,722.72	-1,247.28	0.00	-1,247.28
	750	SHQA US	SHELTER ACQUISITION CORP I-A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7300	1.0000	7,297.50	7,297.50	-202.50	0.00	-202.50
	18,300	SJR/B CN	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	CAD	676,252.05	533,286.79	38.3600	1.2741	698,152.00	547,957.04	17,188.55	-2,518.30	14,670.25
	509	SKYA US	SKYDECK ACQUISITION CORP-A	USD	4,953.53	4,953.53	9.8100	1.0000	4,993.29	4,993.29	39.76	0.00	39.76
	1,491	SLAC US	SOCIAL LEVERAGE ACQUISITIO-A	USD	14,910.00	14,910.00	9.7700	1.0000	14,567.07	14,567.07	-342.93	0.00	-342.93
	1,500	SLAM US	SLAM CORP-A	USD	14,842.50	14,842.50	9.7500	1.0000	14,625.00	14,625.00	-217.50	0.00	-217.50
	1,500	SLCR US	SILVER CREST ACQUISITION C-A	USD	14,865.00	14,865.00	9.8200	1.0000	14,730.00	14,730.00	-135.00	0.00	-135.00
	750	SMAP US	SPORTSMAP TECH ACQUISITION C	USD	7,500.00	7,500.00	9.8100	1.0000	7,357.50	7,357.50	-142.50	0.00	-142.50
	750	SNII US	SUPERNOVA PARTNERS ACQUISI-A	USD	7,640.70	7,640.70	10.3000	1.0000	7,725.00	7,725.00	84.30	0.00	84.30
	1,488	SNRH US	SENIOR CONNECT ACQUISITION-A	USD	7,111.08	7,111.08	9.7400	1.0000	14,493.12	14,493.12	7,382.04	0.00	7,382.04
	1,503	SPAQ US	SPARTAN ACQUISITION III-A	USD	14,948.36	14,948.36	9.9000	1.0000	14,879.70	14,879.70	-68.66	0.00	-68.66
	-13,504	SPGI US	S&P GLOBAL INC	USD	-4,780,626.96	-4,780,626.96	470.4800	1.0000	-6,353,361.92	-6,353,361.92	-1,572,734.96	0.00	-1,572,734.96
	751	SPGS US	SIMON PROPERTY GROUP ACQUI-A	USD	7,510.00	7,510.00	9.7500	1.0000	7,322.25	7,322.25	-187.75	0.00	-187.75
	1,948	SPKB US	SILVER SPIKE ACQUISITION-A	USD	19,480.00	19,480.00	9.7100	1.0000	18,915.08	18,915.08	-564.92	0.00	-564.92
	897	SPKC/U CN	SILVER SPIKE III ACQUISITI-A	USD	0.00	0.00	9.9500	1.0000	8,925.15	8,925.15	8,925.15	0.00	8,925.15
	1,050	SPRI NA	SPEAR INVESTMENTS I BV	EUR	10,489.50	12,011.53	10.0000	1.1325	10,500.00	11,891.25	11.89	-132.17	-120.28
	1,500	SSAA US	SCIENCE STRATEGIC ACQUISIT-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7400	1.0000	14,610.00	14,610.00	-390.00	0.00	-390.00
	4,436	STFC US	STATE AUTO FINANCIAL CORP	USD	226,107.68	226,107.68	51.6800	1.0000	229,252.48	229,252.48	3,144.80	0.00	3,144.80
	1,479	STRE US	SUPERNOVA PARTNERS ACQUISI-A	USD	14,790.00	14,790.00	9.7500	1.0000	14,420.25	14,420.25	-369.75	0.00	-369.75
	741	SVFA US	SVF INVESTMENT CORP-CL A	USD	7,410.00	7,410.00	10.0500	1.0000	7,447.05	7,447.05	37.05	0.00	37.05

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	749	SVFB US	SVF INVESTMENT CORP 2-CLS A	USD	7,381.66	7,381.66	9.8400	1.0000	7,370.16	7,370.16	-11.50	0.00	-11.50
	587	SVFC US	SVF INVESTMENT CORP 3-CLS A	USD	5,743.99	5,743.99	10.0000	1.0000	5,870.00	5,870.00	126.01	0.00	126.01
	1,205	SWAG US	SOFTWARE ACQUISITION GROUP-A	USD	12,050.00	12,050.00	9.8430	1.0000	11,860.82	11,860.82	-189.18	0.00	-189.18
	1,274	SWET US	ATHLON ACQUISITION CORP-A	USD	12,740.00	12,740.00	9.7500	1.0000	12,421.50	12,421.50	-318.50	0.00	-318.50
	600	SWSS US	SPRINGWATER SPECIAL SITUATIO	USD	6,000.00	6,000.00	9.7900	1.0000	5,874.00	5,874.00	-126.00	0.00	-126.00
	1,528	TACA US	TREPOINT ACQUISITION CORP 1-A	USD	3,712.50	3,712.50	9.9800	1.0000	15,249.44	15,249.44	11,536.94	0.00	11,536.94
	1,497	TBCP US	THUNDER BRIDGE CAPITAL PAR-A	USD	14,970.00	14,970.00	9.7600	1.0000	14,610.72	14,610.72	-359.28	0.00	-359.28
	1,455	TBSA US	TB SA ACQUISITION CORP -A	USD	14,550.00	14,550.00	9.7600	1.0000	14,200.80	14,200.80	-349.20	0.00	-349.20
	588	TCAC US	TUATARA CAPITAL ACQUISITIO-A	USD	5,980.00	5,980.00	9.8300	1.0000	5,878.34	5,878.34	-101.66	0.00	-101.66
	752	TCVA US	TCV ACQUISITION CORP-A	USD	7,422.74	7,422.74	9.8500	1.0000	7,407.20	7,407.20	-15.54	0.00	-15.54
	747	TEKK US	TEKKORP DIGITAL ACQUISITIO-A	USD	0.00	0.00	9.9600	1.0000	7,440.12	7,440.12	7,440.12	0.00	7,440.12
	1,495	TETC US	TECH AND ENERGY TRANSITION-A	USD	14,950.00	14,950.00	9.7400	1.0000	14,561.30	14,561.30	-388.70	0.00	-388.70
	7,590	TGP US	TEEKAY LNG PARTNERS LP	USD	128,271.00	128,271.00	16.9400	1.0000	128,574.60	128,574.60	303.60	0.00	303.60
	735	TGVC US	TG VENTURE ACQUISITION CORP	USD	7,350.00	7,350.00	9.8200	1.0000	7,217.70	7,217.70	-132.30	0.00	-132.30
	750	THAC US	THRIVE ACQUISITION CORP - A	USD	7,500.00	7,500.00	9.8801	1.0000	7,410.08	7,410.08	-89.92	0.00	-89.92
	1,502	THCP US	THUNDER BRIDGE CAPITAL PAR-A	USD	15,020.00	15,020.00	9.7600	1.0000	14,659.52	14,659.52	-360.48	0.00	-360.48
	2,250	TIOA US	TIO TECH A- CLASS A	USD	22,500.00	22,500.00	9.7307	1.0000	21,894.08	21,894.08	-605.92	0.00	-605.92
	747	TLGA US	TLG ACQUISITION ONE COR-CL A	USD	7,470.00	7,470.00	9.6900	1.0000	7,238.43	7,238.43	-231.57	0.00	-231.57
	1,350	TMAC US	MUSIC ACQUISITION CORP/THE-A	USD	13,500.00	13,500.00	9.7100	1.0000	13,108.50	13,108.50	-391.50	0.00	-391.50
	735	TMKR US	TASTEMAKER ACQUISITION COR-A	USD	7,178.46	7,178.46	9.8400	1.0000	7,232.40	7,232.40	53.94	0.00	53.94
	750	TPBA US	TPB ACQUISITION CORP 1-CL A	USD	7,500.00	7,500.00	9.7600	1.0000	7,320.00	7,320.00	-180.00	0.00	-180.00
	746	TRCA US	TWIN RIDGE CAPITAL ACQUISIT-A	USD	7,460.00	7,460.00	9.6900	1.0000	7,228.74	7,228.74	-231.26	0.00	-231.26
	2,285	TREB US	TREBIA ACQUISITION CORP-A	USD	22,850.00	22,850.00	9.9700	1.0000	22,781.45	22,781.45	-68.55	0.00	-68.55
	379	TRIS US	TRISTAR ACQUISITION I CORP-A	USD	3,790.00	3,790.00	9.7600	1.0000	3,699.04	3,699.04	-90.96	0.00	-90.96
	1,050	TRON US	CORNER GROWTH ACQUISITION -A	USD	10,500.00	10,500.00	9.8800	1.0000	10,374.00	10,374.00	-126.00	0.00	-126.00
	1,500	TRTL US	TORTOISECOFIN ACQUISITION-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.6750	1.0000	14,512.50	14,512.50	-487.50	0.00	-487.50
	742	TSIB US	TISHMAN SPEYER INNOVATI-CL A	USD	7,420.00	7,420.00	9.7800	1.0000	7,256.76	7,256.76	-163.24	0.00	-163.24
	752	TSPQ US	TOW SPECIAL PURPOSE ACQ-CL A	USD	7,386.35	7,386.35	9.7000	1.0000	7,294.40	7,294.40	-91.95	0.00	-91.95
	2,250	TWCB US	BILANDER ACQUISITION CORP-A	USD	22,500.00	22,500.00	9.7300	1.0000	21,892.50	21,892.50	-607.50	0.00	-607.50
	1,500	TWNI US	TAILWIND INTERNATIONAL ACQ-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7500	1.0000	14,625.00	14,625.00	-375.00	0.00	-375.00
	1,950	TWNT US	TAILWIND TWO ACQUISITION-A	USD	19,500.00	19,500.00	9.8900	1.0000	19,285.50	19,285.50	-214.50	0.00	-214.50
	750	TWOA US	TWO - CLASS A	USD	7,429.97	7,429.97	9.7100	1.0000	7,282.50	7,282.50	-147.47	0.00	-147.47
	1,500	TZPS US	TZP STRATEGIES ACQUISIT-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7700	1.0000	14,655.00	14,655.00	-345.00	0.00	-345.00
	1,794	VAQC US	VECTOR ACQUISITION CORP 1I-A	USD	17,940.00	17,940.00	9.7800	1.0000	17,545.32	17,545.32	-394.68	0.00	-394.68
	375	VCXA US	10X CAPITAL VENTURE ACQUIS-A	USD	3,750.00	3,750.00	9.7900	1.0000	3,671.25	3,671.25	-78.75	0.00	-78.75
	1,507	VELO US	VELOCITY ACQUISITION CORP-A	USD	14,939.45	14,939.45	9.7300	1.0000	14,663.11	14,663.11	-276.34	0.00	-276.34
	38,187	VG US	VONAGE HOLDINGS CORP	USD	788,783.47	788,783.47	20.7900	1.0000	793,907.73	793,907.73	5,124.26	0.00	5,124.26
	1,788	VGII US	VIRGIN GROUP ACQUISITION C-A	USD	17,838.84	17,838.84	9.8400	1.0000	17,593.92	17,593.92	-244.92	0.00	-244.92
	50,981	VICI US	VICI PROPERTIES INC	USD	-1,502,143.40	-1,502,143.40	29.9400	1.0000	-1,526,371.14	-1,526,371.14	-24,227.74	0.00	-24,227.74
	3,521	VIFN SW	VIFOR PHARMA AG	CHF	571,112.54	620,700.47	162.2500	1.0946	571,282.25	625,308.94	185.75	4,422.72	4,608.47
	747	VII US	7GC & CO HOLDINGS INC -CL A	USD	0.00	0.00	9.7500	1.0000	7,283.25	7,283.25	7,283.25	0.00	7,283.25
	300	VLAT US	VALOR LATITUDE ACQUISITION-A	USD	3,000.00	3,000.00	9.7600	1.0000	2,928.00	2,928.00	-72.00	0.00	-72.00
	14,944	VNE US	VEONEER INC	USD	527,019.07	527,019.07	35.6000	1.0000	532,006.40	532,006.40	4,987.33	0.00	4,987.33
	1,498	VPCB US	VPC IMPACT ACQUISITION HOL-A	USD	14,980.00	14,980.00	9.8150	1.0000	14,702.87	14,702.87	-277.13	0.00	-277.13
	717	VPCC US	VPC IMPACT ACQUISITION HOL-A	USD	7,170.00	7,170.00	9.7400	1.0000	6,983.58	6,983.58	-186.42	0.00	-186.42
	1,500	VTIQ US	VECTOIQ ACQUISITION CO-CL A	USD	15,000.00	15,000.00	9.7400	1.0000	14,610.00	14,610.00	-390.00	0.00	-390.00
	3,836	YVGG US	VY GLOBAL GROWTH-CL A	USD	6,594.75	6,594.75	9.8200	1.0000	37,669.52	37,669.52	31,074.77	0.00	31,074.77
	28,092	WBT US	WELBILT INC	USD	662,224.32	662,224.32	23.7700	1.0000	667,746.84	667,746.84	5,522.52	0.00	5,522.52
	722	WPCA US	WARBURG PINCUS CAPITAL COR-A	USD	7,220.00	7,220.00	9.7900	1.0000	7,068.38	7,068.38	-151.62	0.00	-151.62
	1,495	WPCB US	WARBURG PINCUS CAPITAL I-B	USD	14,950.00	14,950.00	9.7500	1.0000	14,576.25	14,576.25	-373.75	0.00	-373.75
	1,500	WQGA US	WORLD QUANTUM GROWTH ACQUI-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8150	1.0000	14,722.50	14,722.50	-277.50	0.00	-277.50
	1,260	WRAC US	WILLIAMS ROWLAND ACQUISITION	USD	12,600.00	12,600.00	9.8900	1.0000	12,461.40	12,461.40	-138.60	0.00	-138.60
	1,500	XFIN US	EXCELFIN ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.8600	1.0000	14,790.00	14,790.00	-210.00	0.00	-210.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	13,195	XLNX US	XILINX INC	USD	1,779,831.34	1,779,831.34	213.8900	1.0000	2,822,278.55	2,822,278.55	1,042,447.21	0.00	1,042,447.21
	1,957	XPOA US	DPCM CAPITAL INC - CLASS A	USD	0.00	0.00	9.8000	1.0000	19,178.60	19,178.60	19,178.60	0.00	19,178.60
	2,991	YTPG US	TPG PACE BENEFICIAL II COR-A	USD	29,766.00	29,766.00	9.7900	1.0000	29,281.89	29,281.89	-484.11	0.00	-484.11
	750	ZGN US	ERMENEGILDO ZEGNA HOLDITALIA	USD	0.00	0.00	10.9000	1.0000	8,175.00	8,175.00	8,175.00	0.00	8,175.00
	900	ZWRK US	Z-WORK ACQUISITION CORP-A	USD	9,000.00	9,000.00	9.7400	1.0000	8,766.00	8,766.00	-234.00	0.00	-234.00
			Subtotal - COMMON STOCK			27,785,751.73			26,586,663.19	26,586,663.19	-1,164,468.23	-34,620.31	-1,199,088.54

EQUITY

59,797	IGYB_CVR	IGYB_CVR	EUR	0.00	0.00	0.7800	1.1325	46,641.66	52,821.68	52,821.68	0.00	0.00	52,821.68
		Subtotal - EQUITY			0.00				52,821.68	52,821.68	0.00	0.00	52,821.68

ETF

-699	IYR US	ISHARES US REAL ESTATE ETF	USD	-65,780.73	-65,780.73	115.9500	1.0000	-70,613.55	-70,613.55	-4,832.82	0.00	0.00	-4,832.82
-476	KRE US	SPDR S&P REGIONAL BANKING	USD	-33,037.06	-33,037.06	70.8700	1.0000	-33,734.12	-33,734.12	-697.06	0.00	0.00	-697.06
		Subtotal - ETF			-98,817.79				-104,347.67	-5,529.88	0.00	0.00	-5,529.88

UNIT

1,500	ACAQ/U US	ATHENA CONSUMER ACQU CORP	USD	15,000.00	15,000.00	10.1100	1.0000	15,165.00	15,165.00	165.00	0.00	0.00	165.00
750	ACDI/U US	ASCENDANT DIGITAL ACQUISITIO	USD	7,533.00	7,533.00	10.1000	1.0000	7,575.00	7,575.00	42.00	0.00	0.00	42.00
1,619	ADALU US	ANHEMIS DIGITAL ACQUISITION	USD	16,190.00	16,190.00	10.1300	1.0000	16,400.47	16,400.47	210.47	0.00	0.00	210.47
1,200	AFACU US	ARENA FORTIFY ACQUISITION CO	USD	12,000.00	12,000.00	10.0200	1.0000	12,024.00	12,024.00	24.00	0.00	0.00	24.00
1,176	AHRNU US	AHREN ACQUISITION CORP	USD	11,760.00	11,760.00	10.0100	1.0000	11,771.76	11,771.76	11.76	0.00	0.00	11.76
1,275	ALORU US	ALSP ORCHID ACQUISITION CORP	USD	12,750.00	12,750.00	10.1000	1.0000	12,877.50	12,877.50	127.50	0.00	0.00	127.50
735	AOGOOU US	AROGO CAPITAL ACQUISITION CO	USD	7,350.00	7,350.00	10.0100	1.0000	7,357.35	7,357.35	7.35	0.00	0.00	7.35
882	APCA/U US	AP ACQUISITION CORP	USD	8,820.00	8,820.00	10.0850	1.0000	8,894.97	8,894.97	74.97	0.00	0.00	74.97
900	APN/U US	APEIRON CAPITAL INVESTMENT C	USD	9,000.00	9,000.00	10.0900	1.0000	9,081.00	9,081.00	81.00	0.00	0.00	81.00
882	APXIU US	APX ACQUISITION CORP I	USD	8,820.00	8,820.00	10.0500	1.0000	8,864.10	8,864.10	44.10	0.00	0.00	44.10
1,200	ARCKU US	ARBOR RAPHA CAPITAL BIOHOLDI	USD	12,000.00	12,000.00	10.1200	1.0000	12,144.00	12,144.00	144.00	0.00	0.00	144.00
750	AVHIU US	ACHARI VENTURES HOLDINGS COR	USD	7,510.26	7,510.26	10.1400	1.0000	7,605.00	7,605.00	94.74	0.00	0.00	94.74
2,940	BACEU NA	BRIGADE-M3 EUROPEAN ACQUISIT	USD	29,400.00	29,400.00	9.8500	1.0000	28,959.00	28,959.00	-441.00	0.00	0.00	-441.00
1,500	BCSAU US	BLOCKCHAIN COINVESTORS ACQUI	USD	15,000.00	15,000.00	10.0900	1.0000	15,135.00	15,135.00	135.00	0.00	0.00	135.00
735	BFACU US	BATTERY FUTURE ACQUISITION C	USD	7,357.33	7,357.33	10.0000	1.0000	7,350.00	7,350.00	-7.33	0.00	0.00	-7.33
1,470	BIOSU US	BIOPLUS ACQUISITION CORP	USD	14,700.00	14,700.00	10.0100	1.0000	14,714.70	14,714.70	14.70	0.00	0.00	14.70
1,800	BLEUU US	BLEUACACIA LTD	USD	18,000.00	18,000.00	10.0000	1.0000	18,000.00	18,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00
1,350	BMCAU US	BLACK MOUNTAIN ACQ CORP	USD	13,500.00	13,500.00	10.1500	1.0000	13,702.50	13,702.50	202.50	0.00	0.00	202.50
1,764	BOCNU US	BLUE OCEAN ACQUISITION CORP	USD	17,640.00	17,640.00	9.9900	1.0000	17,622.36	17,622.36	-17.64	0.00	0.00	-17.64
1,176	BPACU US	BULLPEN FARLAY ACQUISITION C	USD	11,760.00	11,760.00	10.2500	1.0000	12,054.00	12,054.00	294.00	0.00	0.00	294.00
1,544	BRD/U US	BEARD ENERGY TRANSITION ACQU	USD	15,440.00	15,440.00	10.0500	1.0000	15,517.20	15,517.20	77.20	0.00	0.00	77.20
882	BRKHU US	BURTECH ACQUISITION CORP	USD	8,820.00	8,820.00	9.9901	1.0000	8,811.27	8,811.27	-8.73	0.00	0.00	-8.73
2,100	CBRGU US	CHAIN BRIDGE I	USD	21,000.00	21,000.00	10.0300	1.0000	21,063.00	21,063.00	63.00	0.00	0.00	63.00
750	CCTSU US	CACTUS ACQUISITION CORP I LT	USD	7,527.00	7,527.00	10.6100	1.0000	7,957.50	7,957.50	430.50	0.00	0.00	430.50
1,176	CFFSU US	CF ACQUISITION CORP VII	USD	11,760.00	11,760.00	10.0200	1.0000	11,783.52	11,783.52	23.52	0.00	0.00	23.52
1,470	CMCAU US	CAPITALWORKS EMERGING MARKET	USD	14,700.00	14,700.00	10.0300	1.0000	14,744.10	14,744.10	44.10	0.00	0.00	44.10
1,050	CNDBU US	CONCORD ACQUISITION CORP III	USD	10,500.00	10,500.00	10.1900	1.0000	10,699.50	10,699.50	199.50	0.00	0.00	199.50
882	CNGLU US	CANNA-GLOBAL ACQUISITION COR	USD	8,820.00	8,820.00	10.1300	1.0000	8,934.66	8,934.66	114.66	0.00	0.00	114.66
382	DAOOU US	CRYPTO 1 ACQUISITION CORP	USD	3,820.00	3,820.00	10.0900	1.0000	3,854.38	3,854.38	34.38	0.00	0.00	34.38
2,100	DPCSU US	DP CAP ACQUISITION CORP I	USD	21,000.00	21,000.00	10.1200	1.0000	21,252.00	21,252.00	252.00	0.00	0.00	252.00
1,492	EFIC1 NA	EUROPEAN FINTECH IPO CO 1 BV	EUR	14,696.20	17,307.72	9.8700	1.1325	14,726.04	16,677.24	33.79	-664.27	0.00	-630.48
735	EMLDU US	FTAC EMERALD ACQUISITION COR	USD	7,338.89	7,338.89	9.9700	1.0000	7,327.95	7,327.95	-10.94	0.00	0.00	-10.94
750	ENCPU US	ENERGEM CORP	USD	7,500.00	7,500.00	10.1200	1.0000	7,590.00	7,590.00	90.00	0.00	0.00	90.00
735	EVE/U US	EVE MOBILITY ACQUISITION COR	USD	7,361.76	7,361.76	10.0000	1.0000	7,350.00	7,350.00	-11.76	0.00	0.00	-11.76

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)	
		750	FEXDU US	FINTECH ECOSYSTEM DEVELOPMEN	USD	7,500.00	7,500.00	10.1800	1.0000	7,635.00	7,635.00	135.00	0.00	135.00
	1,200	FIACU US	FOCUS IMPACT ACQUISITION COR	USD	12,000.00	12,000.00	10.0700	1.0000	12,084.00	12,084.00	84.00	0.00	84.00	
	588	FRNU US	FORBION EUROPEAN ACQUISITION	USD	5,880.00	5,880.00	10.0400	1.0000	5,903.82	5,903.82	23.82	0.00	23.82	
	1,470	GEEXU US	GAMES & ESPORTS EXPERIENCE A	USD	14,700.00	14,700.00	10.1100	1.0000	14,861.70	14,861.70	161.70	0.00	161.70	
	1,470	GFUDU US	GROWTH FOR GOOD ACQUISITION	USD	14,700.00	14,700.00	10.0999	1.0000	14,714.55	14,714.55	14.55	0.00	14.55	
	1,176	GGAU US	GENESIS GROWTH TECH ACQUISIT	USD	11,760.00	11,760.00	10.0300	1.0000	11,795.28	11,795.28	35.28	0.00	35.28	
	1,029	GMFIU US	AETHERIUM ACQUISITION CORP	USD	10,290.00	10,290.00	10.0000	1.0000	10,290.00	10,290.00	0.00	0.00	0.00	
	750	GTACU US	GLOBAL TECHNOLOGY ACQUISITIO	USD	7,500.00	7,500.00	10.1000	1.0000	7,575.00	7,575.00	75.00	0.00	75.00	
	1,200	GVCU US	GREEN VISOR FINANCIAL TECHNO	USD	12,000.00	12,000.00	10.2200	1.0000	12,264.00	12,264.00	264.00	0.00	264.00	
	2	HEGAU NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN-UNITS	EUR	20.00	24.28	9.8660	1.1325	19.72	22.33	-0.32	-1.63	-1.95	
	514	HORU US	EMERGING MARKETS HORIZON COR	USD	5,140.00	5,140.00	10.0200	1.0000	5,150.28	5,150.28	10.28	0.00	10.28	
	1,200	HTAQ/U US	HUNT COS ACQUISITION CORP I	USD	12,000.00	12,000.00	10.1400	1.0000	12,168.00	12,168.00	168.00	0.00	168.00	
	750	IFIN/U US	INFINT ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	10.0000	1.0000	7,500.00	7,500.00	0.00	0.00	0.00	
	735	IGTAU US	INCEPTION GROWTH ACQUISITION	USD	7,350.00	7,350.00	10.0700	1.0000	7,401.45	7,401.45	51.45	0.00	51.45	
	750	INTEU US	INTEGRAL ACQUISITION CORP I	USD	7,500.00	7,500.00	10.0304	1.0000	7,522.80	7,522.80	22.80	0.00	22.80	
	1,200	IOACU US	INNOVATIVE INTERNATIONAL ACQ	USD	12,000.00	12,000.00	10.0660	1.0000	12,072.00	12,072.00	72.00	0.00	72.00	
	1,200	IQMDU US	INTELLIGENT MEDICINE ACQUISIT	USD	12,000.00	12,000.00	10.1501	1.0000	12,180.12	12,180.12	180.12	0.00	180.12	
	735	IVCBU US	INVESTCORP EUROPE ACQUISITIO	USD	7,365.55	7,365.55	10.0800	1.0000	7,408.80	7,408.80	43.25	0.00	43.25	
	294	IVCPU US	SWIFTCORP ACQUISITION CORP	USD	2,915.24	2,915.24	9.9500	1.0000	2,925.30	2,925.30	10.06	0.00	10.06	
	1,800	JUN/U US	JUNIPER II CORP	USD	18,000.00	18,000.00	10.2200	1.0000	18,396.00	18,396.00	396.00	0.00	396.00	
	1,500	LFACU US	LF CAPITAL ACQUISITION CORP	USD	15,000.00	15,000.00	10.0200	1.0000	15,030.00	15,030.00	30.00	0.00	30.00	
	1,500	LGSTU US	SEMPER PARATUS ACQUISITION C	USD	15,000.00	15,000.00	10.0700	1.0000	15,105.00	15,105.00	105.00	0.00	105.00	
	900	LGTUO US	LEGATO MERGER CORP II	USD	9,000.00	9,000.00	10.0900	1.0000	9,081.00	9,081.00	81.00	0.00	81.00	
	1,200	LGVCU US	LAMP GLOBAL VENTURES CORP I	USD	12,012.00	12,012.00	10.0650	1.0000	12,078.00	12,078.00	66.00	0.00	66.00	
	900	LVACU US	LAVA MEDTECH ACQUISITION COR	USD	9,000.00	9,000.00	10.0800	1.0000	9,072.00	9,072.00	72.00	0.00	72.00	
	1,350	MCAAU US	MOUNTAIN & CO I ACQUISITION	USD	13,500.00	13,500.00	10.2200	1.0000	13,797.00	13,797.00	297.00	0.00	297.00	
	1,500	MLAIU US	MCLAREN TECHNOLOGY ACQUISITI	USD	15,000.00	15,000.00	10.0500	1.0000	15,075.00	15,075.00	75.00	0.00	75.00	
	1,029	MNTN/U US	EVEREST CONSOLIDATOR ACQUISIT	USD	10,290.00	10,290.00	10.0500	1.0000	10,341.45	10,341.45	51.45	0.00	51.45	
	1,200	MPRAU US	MERCATO PARTNERS ACQUISITION	USD	12,000.00	12,000.00	10.0401	1.0000	12,048.12	12,048.12	48.12	0.00	48.12	
	1,029	MTVC/U US	MOTIVE CAPITAL CORP II	USD	10,305.21	10,305.21	10.0000	1.0000	10,290.00	10,290.00	-15.21	0.00	-15.21	
	1,500	NETC/U US	NABORS ENERGY TRANSITION COR	USD	15,000.00	15,000.00	10.1000	1.0000	15,150.00	15,150.00	150.00	0.00	150.00	
	1,200	NFNT/U US	INFINITE ACQUISITION CORP	USD	12,000.00	12,000.00	10.0623	1.0000	12,074.76	12,074.76	74.76	0.00	74.76	
	6,682	NPABU US	NEW PROVIDENCE ACQUISITION C	USD	66,820.00	66,820.00	10.0400	1.0000	67,087.28	67,087.28	267.28	0.00	267.28	
	600	OLITU US	OMNILIT ACQUISITION CORP	USD	6,000.00	6,000.00	10.0400	1.0000	6,024.00	6,024.00	24.00	0.00	24.00	
	1	PACEU NA	PEGASUS ACQUISITION CO-UNIT	EUR	0.00	0.00	9.7700	1.1325	9.77	11.06	11.06	0.00	11.06	
	1,470	PACI/U US	PROOF ACQUISITION CORP I	USD	14,700.00	14,700.00	10.3000	1.0000	15,141.00	15,141.00	441.00	0.00	441.00	
	1,500	PCCTU US	PERCEPTION CAPITAL CORP II	USD	15,000.00	15,000.00	10.0700	1.0000	15,105.00	15,105.00	105.00	0.00	105.00	
	750	PEGRU US	PROJECT ENERGY REIMAGINED AC	USD	7,402.50	7,402.50	9.8800	1.0000	7,410.00	7,410.00	7.50	0.00	7.50	
	750	PHYTU US	PYROPHYTE ACQUISITION CORP	USD	7,582.50	7,582.50	10.1450	1.0000	7,608.75	7,608.75	26.25	0.00	26.25	
	1,176	PORT/U US	SOUTHPORT ACQUISITION CORP	USD	11,760.00	11,760.00	10.0000	1.0000	11,760.00	11,760.00	0.00	0.00	0.00	
	735	PRLHU US	PEARL HOLDINGS ACQUISITION C	USD	7,342.18	7,342.18	10.0000	1.0000	7,350.00	7,350.00	7.82	0.00	7.82	
	750	RCFAU US	RCF ACQUISITION CORP	USD	7,513.50	7,513.50	10.0300	1.0000	7,522.50	7,522.50	9.00	0.00	9.00	
	2,205	RJACU US	JACKSON ACQUISITION CO	USD	22,050.00	22,050.00	9.9600	1.0000	21,961.80	21,961.80	-88.20	0.00	-88.20	
	735	ROCAU US	ROC ENERGY ACQUISITION CORP	USD	7,350.00	7,350.00	10.1800	1.0000	7,482.30	7,482.30	132.30	0.00	132.30	
	294	ROCLU US	ROTH CH ACQUISITION V CO.	USD	2,940.00	2,940.00	9.9600	1.0000	2,928.24	2,928.24	-11.76	0.00	-11.76	
	1,500	RRAC/U US	RIGEL RESOURCE ACQUISITION C	USD	15,000.00	15,000.00	10.1400	1.0000	15,210.00	15,210.00	210.00	0.00	210.00	
	735	SAGAU US	SAGALIAM ACQUISITION CORP	USD	7,350.00	7,350.00	10.0100	1.0000	7,357.35	7,357.35	7.35	0.00	7.35	
	750	SCMAU US	SEAPORT CALIBRE MATERIALS AC	USD	7,515.00	7,515.00	10.0300	1.0000	7,522.50	7,522.50	7.50	0.00	7.50	
	1,176	SCUA/U US	SCULPTOR ACQUISITION CORP I	USD	11,760.00	11,760.00	10.0500	1.0000	11,818.80	11,818.80	58.80	0.00	58.80	
	750	SEDAU US	SDCL EDGE ACQUISITION CORP	USD	7,470.00	7,470.00	9.9399	1.0000	7,454.93	7,454.93	-15.07	0.00	-15.07	
	1,500	SHCAU US	SPINDLETOP HEALTH ACQUISITIO	USD	15,000.00	15,000.00	10.0800	1.0000	15,120.00	15,120.00	120.00	0.00	120.00	
	882	STET/U US	ST ENERGY TRANSITION I LTD	USD	8,820.00	8,820.00	9.9701	1.0000	8,793.63	8,793.63	-26.37	0.00	-26.37	
	1,875	SUACU US	SHOULDER TECHNOLOGY ACQUISIT	USD	18,750.00	18,750.00	10.0700	1.0000	18,881.25	18,881.25	131.25	0.00	131.25	
	1,200	SVNAU US	7 ACQUISITION CORP	USD	12,000.00	12,000.00	10.0300	1.0000	12,036.00	12,036.00	36.00	0.00	36.00	

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	750	SZZLU US	SIZZLE ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	10.0300	1.0000	7,522.50	7,522.50	22.50	0.00	22.50
	736	TLGY US	TLGY ACQUISITION CORP	USD	7,350.00	7,350.00	10.0300	1.0000	7,372.06	7,372.06	22.06	0.00	22.06
	1,500	TOACU US	TALON 1 ACQUISITION CORP	USD	15,000.00	15,000.00	10.1500	1.0000	15,225.00	15,225.00	225.00	0.00	225.00
	5,250	TRAQ/U US	TRINE II ACQUISITION CORP	USD	52,500.00	52,500.00	10.0900	1.0000	52,972.50	52,972.50	472.50	0.00	472.50
	1,200	USCTU US	TKB CRITICAL TECHNOLOGIES 1	USD	12,000.00	12,000.00	10.1900	1.0000	12,228.00	12,228.00	228.00	0.00	228.00
	1,617	UTAAU US	UTA ACQUISITION CORPORATION	USD	16,170.00	16,170.00	10.0100	1.0000	16,186.17	16,186.17	16.17	0.00	16.17
	735	VHNAU US	VAHANNA TECH EDGE ACQUISITIO	USD	7,350.00	7,350.00	9.9000	1.0000	7,276.50	7,276.50	-73.50	0.00	-73.50
	1,275	VMGAU US	VMG CONSUMER ACQUISITION COR	USD	12,750.00	12,750.00	10.1750	1.0000	12,973.13	12,973.13	223.13	0.00	223.13
	825	VSACU US	VISION SENSING ACQUISITION C	USD	8,250.00	8,250.00	10.1500	1.0000	8,373.75	8,373.75	123.75	0.00	123.75
	588	WEL/U US	INTEGRATED WELLNESS ACQUISIT	USD	5,880.00	5,880.00	10.1200	1.0000	5,950.56	5,950.56	70.56	0.00	70.56
	2,250	ZINGU US	FTAC ZEUS ACQUISITION CORP	USD	22,500.00	22,500.00	10.0343	1.0000	22,577.18	22,577.18	77.18	0.00	77.18
	1,500	ZTAQU US	ZIMMER ENERGY TRANSITION ACQ	USD	15,003.76	15,003.76	9.8900	1.0000	14,835.00	14,835.00	-168.76	0.00	-168.76
			Subtotal - UNIT			1,217,597.68			1,224,951.22	1,224,951.22	8,019.44	-665.90	7,353.54
			Subtotal - Equity			28,798,839.01			27,958,291.04	27,958,291.04	-805,261.76	-35,286.21	-840,547.97

Forward

FX FORWARD

7,665,971,756	JPY. FWD	JPY	JPY per USD @ 114.9141 : 01/31/2022	7,665,971,756.00	66,710,438.06	1.0000	115.0521	7,665,971,756.00	66,630,437.48	0.00	-80,000.58	-80,000.58
-66,710,438	USD. FWD	USD	JPY per USD @ 114.9141 : 01/31/2022	-66,710,438.06	-66,710,438.06	1.0000	1.0000	-66,710,438.06	-66,710,438.06	0.00	0.00	0.00
			Subtotal - FX FORWARD		0.00				-80,000.58	0.00	-80,000.58	-80,000.58
			Subtotal - Forward		0.00				-80,000.58	0.00	-80,000.58	-80,000.58

Medium

CASH AND EQUIVALENTS

-56,997	AUD	Australian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	AUD	-56,996.65	-42,435.79	1.0000	0.7256	-56,996.65	-41,356.77	0.00	1,079.02	1,079.02
49,573	AUD	Australian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	AUD	49,572.72	37,335.58	1.0000	0.7256	49,572.72	35,969.97	0.00	-1,365.61	-1,365.61
0	AUD	Australian Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	AUD	0.39	0.30	1.0000	0.7256	0.39	0.28	0.00	-0.02	-0.02
20,917	AUD	Australian Dollar - 74991 JPHQ CFD - OnHand	AUD	20,917.09	15,163.02	1.0000	0.7256	20,917.09	15,177.44	0.00	14.42	14.42
-3,317	CAD	Canadian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	CAD	-3,317.16	-2,607.42	1.0000	1.2741	-3,317.16	-2,603.53	0.00	3.89	3.89
2,031	CAD	Canadian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	CAD	2,031.05	1,604.94	1.0000	1.2741	2,031.05	1,594.11	0.00	-10.83	-10.83
-643,706	CAD	Canadian Dollar - 74991 FBCO INTL - OnHand	CAD	-643,706.01	-508,009.60	1.0000	1.2741	-643,706.01	-505,224.09	0.00	2,785.51	2,785.51
-625	CAD	Canadian Dollar - 74991-MSCO-DOMESTIC - OnHand	CAD	-625.10	-504.19	1.0000	1.2741	-625.10	-490.62	0.00	13.57	13.57
-8,061	CHF	Swiss Franc - 74991 BARC INTL - OnHand	CHF	-8,060.77	-8,816.81	1.0000	1.0946	-8,060.77	-8,823.08	0.00	-6.27	-6.27
8,062	CHF	Swiss Franc - 74991 CITI INTL - OnHand	CHF	8,061.61	8,834.13	1.0000	1.0946	8,061.61	8,824.00	0.00	-10.13	-10.13
-984,252	EUR	Euro - 74991 BARC INTL - OnHand	EUR	-984,251.87	-1,164,872.77	1.0000	1.1325	-984,251.87	-1,114,665.24	0.00	50,207.53	50,207.53
25	EUR	Euro - 74991 CITI CFD - OnHand	EUR	25.05	28.36	1.0000	1.1325	25.05	28.37	0.00	0.01	0.01
-4,387	EUR	Euro - 74991 CITI INTL - OnHand	EUR	-4,387.47	-4,887.48	1.0000	1.1325	-4,387.47	-4,968.81	0.00	-81.33	-81.33
-8	EUR	Euro - 74991 FBCO CFD - OnHand	EUR	-7.53	-9.17	1.0000	1.1325	-7.53	-8.53	0.00	0.64	0.64
392,748	EUR	Euro - 74991 JPHQ INTL - OnHand	EUR	392,748.44	476,819.77	1.0000	1.1325	392,748.44	444,787.61	0.00	-32,032.16	-32,032.16
5,815	EUR	Euro - 74991 GSCO CFD - OnHand	EUR	5,814.65	6,586.73	1.0000	1.1325	5,814.65	6,585.09	0.00	-1.64	-1.64
100,709	EUR	Euro - 74991 JPHQ CFD - OnHand	EUR	100,708.60	114,294.20	1.0000	1.1325	100,708.60	114,052.49	0.00	-241.71	-241.71
73	EUR	Euro - 74991 JPHQ INTL - OnHand	EUR	72.97	85.24	1.0000	1.1325	72.97	82.64	0.00	-2.60	-2.60
1,020	EUR	Euro - 74991 MSCO CFD - OnHand	EUR	1,019.63	1,153.31	1.0000	1.1325	1,019.63	1,154.73	0.00	1.42	1.42

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	25	EUR	Euro - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	EUR	25.01	29.20	1.0000	1.1325	25.01	28.32	0.00	-0.88	-0.88
	-10,254	EUR	Euro - 74991-GSCO-INTL - OnHand	EUR	-10,254.21	-11,455.44	1.0000	1.1325	-10,254.21	-11,612.89	0.00	-157.45	-157.45
	49,520	GBP	Pound Sterling - 74991 BARC INTL - OnHand	GBP	49,519.99	66,482.77	1.0000	1.3499	49,519.99	66,847.03	0.00	364.26	364.26
	0	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI CFD - OnHand	GBP	0.02	0.03	1.0000	1.3499	0.02	0.03	0.00	0.00	0.00
	-49,025	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI INTL - OnHand	GBP	-49,025.44	-65,556.77	1.0000	1.3499	-49,025.44	-66,179.44	0.00	-622.67	-622.67
	0	GBP	Pound Sterling - 74991 FBCO CFD - OnHand	GBP	0.05	0.07	1.0000	1.3499	0.05	0.07	0.00	0.00	0.00
	169	GBP	Pound Sterling - 74991 GSCO CFD - OnHand	GBP	169.33	228.43	1.0000	1.3499	169.33	228.58	0.00	0.15	0.15
	-2	GBP	Pound Sterling - 74991 JPHQ CFD - OnHand	GBP	-1.87	-3.46	1.0000	1.3499	-1.87	-2.52	0.00	0.94	0.94
	-254	GBP	Pound Sterling - 74991 MSCO CFD - OnHand	GBP	-253.60	-342.11	1.0000	1.3499	-253.60	-342.33	0.00	-0.22	-0.22
	-85	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	GBP	-84.95	-112.25	1.0000	1.3499	-84.95	-114.68	0.00	-2.43	-2.43
	-9,844	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO- INTL - OnHand	GBP	-9,843.85	-12,830.00	1.0000	1.3499	-9,843.85	-13,288.21	0.00	-458.21	-458.21
	-1	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	HKD	-1.43	-0.18	1.0000	7.7994	-1.43	-0.18	0.00	0.00	0.00
	-3	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	HKD	-2.53	-0.32	1.0000	7.7994	-2.53	-0.32	0.00	0.00	0.00
	-1	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	HKD	-0.68	-0.09	1.0000	7.7994	-0.68	-0.09	0.00	0.00	0.00
	678,064	JPY	Japanese yen - 74991 BARC INTL - OnHand	JPY	678,063.62	5,972.02	1.0000	115.0800	678,063.62	5,892.11	0.00	-79.91	-79.91
	-180,509	JPY	Japanese yen - 74991 CITI INTL - OnHand	JPY	-180,509.04	-1,693.39	1.0000	115.0800	-180,509.04	-1,568.55	0.00	124.84	124.84
	-19,047,538	JPY	Japanese yen - 74991 FBCO INTL - OnHand	JPY	-19,047,537.52	-174,652.02	1.0000	115.0800	-19,047,537.52	-165,515.62	0.00	9,136.40	9,136.40
	-0	JPY	Japanese yen - 74991 JPHQ CFD - OnHand	JPY	-0.01	2.79	1.0000	115.0800	-0.01	0.00	0.00	-2.79	-2.79
	14,715,215	JPY	Japanese yen - 74991-CAYM-FX - OnHand	JPY	14,715,215.10	127,869.44	1.0000	115.0800	14,715,215.10	127,869.44	0.00	0.00	0.00
	-137,295	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	JPY	-137,294.79	-1,234.09	1.0000	115.0800	-137,294.79	-1,193.04	0.00	41.05	41.05
	-50,884,862	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO- INTL - OnHand	JPY	-50,884,862.06	-462,016.21	1.0000	115.0800	-50,884,862.06	-442,169.47	0.00	19,846.74	19,846.74
	0	JPY	Japanese yen - MFG Cayman - OnHand	JPY	0.44	0.00	1.0000	115.0800	0.44	0.00	0.00	0.00	0.00
	82,284	NZD	New Zealand Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	NZD	82,283.83	49,667.05	1.0000	0.6832	82,283.83	56,216.31	0.00	6,549.26	6,549.26
	-82,286	NZD	New Zealand Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	NZD	-82,285.74	-50,007.73	1.0000	0.6832	-82,285.74	-56,217.62	0.00	-6,209.89	-6,209.89
	-11,631	PLN	Polish zlot - 74991 BARC INTL - OnHand	PLN	-11,631.47	-3,120.66	1.0000	4.0578	-11,631.47	-2,866.45	0.00	254.21	254.21
	11,636	PLN	Polish zlot - 74991 CITI INTL - OnHand	PLN	11,635.80	3,086.36	1.0000	4.0578	11,635.80	2,867.51	0.00	-218.85	-218.85
	0	PLN	Polish zlot - 74991 FBCO CFD - OnHand	PLN	0.21	0.06	1.0000	4.0578	0.21	0.05	0.00	-0.01	-0.01
	411,352	SEK	Swedish Krona - 74991 BARC INTL - OnHand	SEK	411,351.92	47,314.25	1.0000	9.0427	411,351.92	45,489.94	0.00	-1,824.31	-1,824.31
	-497,137	SEK	Swedish Krona - 74991 CITI INTL - OnHand	SEK	-497,136.65	-56,345.12	1.0000	9.0427	-497,136.65	-54,976.57	0.00	1,368.55	1,368.55
	1,277,430	USD	U. S. Dollars - 74991 BARC INTL - OnHand	USD	1,277,429.82	1,277,429.82	1.0000	1.0000	1,277,429.82	1,277,429.82	0.00	0.00	0.00
	-3,957	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI CFD - OnHand	USD	-3,957.26	-3,957.26	1.0000	1.0000	-3,957.26	-3,957.26	0.00	0.00	0.00
	-3,633,919	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI DOMESTIC - OnHand	USD	-3,633,918.68	-3,633,918.68	1.0000	1.0000	-3,633,918.68	-3,633,918.68	0.00	0.00	0.00
	1,596,423	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI INTL - OnHand	USD	1,596,423.15	1,596,423.15	1.0000	1.0000	1,596,423.15	1,596,423.15	0.00	0.00	0.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	0	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO CFD - OnHand	USD	0.22	0.22	1.0000	1.0000	0.22	0.22	0.00	0.00	0.00
	-45	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO COLLATERAL - OnHand	USD	-45.45	-45.45	1.0000	1.0000	-45.45	-45.45	0.00	0.00	0.00
	-3,004,526	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO DOMESTIC - OnHand	USD	-3,004,526.41	-3,004,526.41	1.0000	1.0000	-3,004,526.41	-3,004,526.41	0.00	0.00	0.00
	5,854,257	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO INTL - OnHand	USD	5,854,256.53	5,854,256.53	1.0000	1.0000	5,854,256.53	5,854,256.53	0.00	0.00	0.00
	260,000	USD	U.S. Dollars - 74991 GS OTC Collateral - OnHand	USD	260,000.00	260,000.00	1.0000	1.0000	260,000.00	260,000.00	0.00	0.00	0.00
	-6,544	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ CFD - OnHand	USD	-6,543.56	-6,543.56	1.0000	1.0000	-6,543.56	-6,543.56	0.00	0.00	0.00
	-370,109	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ DOMESTIC - OnHand	USD	-370,109.09	-370,109.09	1.0000	1.0000	-370,109.09	-370,109.09	0.00	0.00	0.00
	602,361	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ INTL - OnHand	USD	602,360.61	602,360.61	1.0000	1.0000	602,360.61	602,360.61	0.00	0.00	0.00
	475,005	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ OTC Collateral - OnHand	USD	475,005.48	475,005.48	1.0000	1.0000	475,005.48	475,005.48	0.00	0.00	0.00
	11,906	USD	U.S. Dollars - 74991 MSCO CFD - OnHand	USD	11,906.09	11,906.09	1.0000	1.0000	11,906.09	11,906.09	0.00	0.00	0.00
	520,000	USD	U.S. Dollars - 74991 MSCO Collateral - OnHand	USD	520,000.00	520,000.00	1.0000	1.0000	520,000.00	520,000.00	0.00	0.00	0.00
	2,512,536	USD	U.S. Dollars - 74991-CAYM-FX - OnHand	USD	2,512,535.93	2,512,535.93	1.0000	1.0000	2,512,535.93	2,512,535.93	0.00	0.00	0.00
	20,075,500	USD	U.S. Dollars - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	USD	20,075,499.74	20,075,499.74	1.0000	1.0000	20,075,499.74	20,075,499.74	0.00	0.00	0.00
	-11,120	USD	U.S. Dollars - 74991-GSCO-INTL - OnHand	USD	-11,120.10	-11,120.10	1.0000	1.0000	-11,120.10	-11,120.10	0.00	0.00	0.00
	12,689,673	USD	U.S. Dollars - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	USD	12,689,672.54	12,689,672.54	1.0000	1.0000	12,689,672.54	12,689,672.54	0.00	0.00	0.00
	0	USD	U.S. Dollars - WFG Cayman - OnHand	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-92,810	ZAR	South African rand - 74991 BARC INTL - OnHand	ZAR	-92,810.08	-6,225.10	1.0000	15.9295	-92,810.08	-5,826.30	0.00	398.80	398.80
	129,049	ZAR	South African rand - 74991 CITI INTL - OnHand	ZAR	129,049.43	7,344.40	1.0000	15.9295	129,049.43	8,101.29	0.00	756.89	756.89
	-0	ZAR	South African rand - 74991 JPHQ CFD - OnHand	ZAR	-0.03	-314.82	1.0000	15.9295	-0.03	0.00	0.00	314.82	314.82
	-3,019	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-DMESTIC - OnHand	ZAR	-3,019.05	-192.41	1.0000	15.9295	-3,019.05	-189.53	0.00	2.88	2.88
	-33,222	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-INTL - OnHand	ZAR	-33,221.81	-2,286.01	1.0000	15.9295	-33,221.81	-2,085.55	0.00	200.46	200.46
			Subtotal - CASH AND EQUIVALENTS			37,234,240.60				37,284,376.94	0.00	50,136.34	50,136.34
			Subtotal - Medium			37,234,240.60				37,284,376.94	0.00	50,136.34	50,136.34

Option
EQUITY OPTION

-7	DRNA	220121C00040000	DRNA US 01/22 C40.00	USD	-196.19	-196.19	0.0250	1.0000	-17.50	-17.50	178.69	0.00	178.69
3	SPT	220121P00420000	SPY US 01/22 P420.00	USD	643.56	643.56	0.4450	1.0000	133.50	133.50	-510.06	0.00	-510.06
			Subtotal - EQUITY OPTION			447.37			116.00	116.00	-331.37	0.00	-331.37

EQUITY WRT

1,500	2MXBS	FP	2MX ORGANIC SA-CW25	EUR	810.00	953.94	0.1800	1.1325	270.00	305.77	-611.55	-36.62	-648.17
360	AAC/WS	US	ARES ACQUISITION CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8905	1.0000	320.58	320.58	320.58	0.00	320.58
525	AACIW	US	ARMADA ACQUISITION I -CW23	USD	0.00	0.00	0.5198	1.0000	272.89	272.89	272.89	0.00	272.89
500	AAQC/WS	US	ACCELERATE ACQUISITION -CW27	USD	0.00	0.00	0.8700	1.0000	435.00	435.00	435.00	0.00	435.00
714	ACAHW	US	ATLANTIC COASTAL ACQ A -CW27	USD	200.66	200.66	0.7101	1.0000	507.01	507.01	306.35	0.00	306.35
300	ACIIW/WS	US	ATLAS CREST INV CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8000	1.0000	240.00	240.00	240.00	0.00	240.00
637	ACKIW	US	ACKRELL SPAC PARTNERS -CW26	USD	75.75	75.75	0.5150	1.0000	328.09	328.09	252.34	0.00	252.34

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	299	ACQRW US	INDEPENDENCE HDS CORP-CL A	USD	0.00	0.00	0.8900	1.0000	266.11	266.11	266.11	0.00	266.11
	500	ACRO/WS US	ACROPOLIS INFRASTRUCTURE -CW26	USD	0.00	0.00	0.8306	1.0000	415.30	415.30	415.30	0.00	415.30
	299	ACTDW US	ARCLIGHT CLEAN TR CL A -CW27	USD	354.32	354.32	1.6000	1.0000	478.40	478.40	124.08	0.00	124.08
	750	ADERW US	26 CAPITAL ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6600	1.0000	495.00	495.00	495.00	0.00	495.00
	452	ADEX/WS US	ADIT EDTECH ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.7400	1.0000	334.48	334.48	334.48	0.00	334.48
	525	ADRA/WS US	ADARA ACQUISITION CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.4982	1.0000	261.56	261.56	261.56	0.00	261.56
	350	ADTHW US	ADTHEORENT HOLDINGS CO-CW27	USD	0.00	0.00	0.6201	1.0000	217.04	217.04	217.04	0.00	217.04
	602	AEACW US	AUTHENTIC EQUITY ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.5418	1.0000	326.16	326.16	326.16	0.00	326.16
	750	AEAEW US	ALTENERGY ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	390.00	390.00	390.00	0.00	390.00
	249	AFAQW US	AF ACQUISITION CORP -CW28	USD	0.00	0.00	0.6100	1.0000	151.89	151.89	151.89	0.00	151.89
	2,000	AFTR/WS US	AFTERNEXT HEALTHTECH -CW23	USD	0.00	0.00	0.6850	1.0000	1,369.90	1,369.90	1,369.90	0.00	1,369.90
	740	AGAC/WS US	AFRICAN GOLD ACQUISITION CORP -CW28	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	370.00	370.00	370.00	0.00	370.00
	498	AGGRW US	AGILE GROWTH CORP-A	USD	0.00	0.00	0.6700	1.0000	333.66	333.66	333.66	0.00	333.66
	500	AHPAW US	AVISTA PUBLIC ACQUISITION -CW26	USD	0.00	0.00	0.5600	1.0000	280.00	280.00	280.00	0.00	280.00
	650	AKICW US	SPORTS VENT ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6100	1.0000	396.50	396.50	396.50	0.00	396.50
	750	ALTUW US	ALTITUDE ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	435.00	435.00	435.00	0.00	435.00
	735	AMAOW US	AMERICAN ACQ -CL A -CW26	USD	299.02	299.02	0.5765	1.0000	423.73	423.73	124.71	0.00	124.71
	1,125	AMCIW US	AMCI ACQUISITION II A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5101	1.0000	573.86	573.86	573.86	0.00	573.86
	124	AMPI/WS US	ADVANCED MERGER PART -CW26	USD	0.00	0.00	0.7700	1.0000	95.48	95.48	95.48	0.00	95.48
	376	ANAC/WS US	ARCTOS NORTHSTAR ACQ -CW28	USD	0.00	0.00	0.7600	1.0000	285.76	285.76	285.76	0.00	285.76
	598	ANZUW US	ANZU SPECIAL ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.7701	1.0000	460.52	460.52	460.52	0.00	460.52
	450	APACW US	STONEBRIDGE ACQUISITION-CW23	USD	0.00	0.00	0.4813	1.0000	216.59	216.59	216.59	0.00	216.59
	450	APGB/WS US	APOLLO STRATEGIC CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9500	1.0000	427.50	427.50	427.50	0.00	427.50
	750	APSG/WS US	APOLLO STRATEGIC GROWTH -CW27	USD	0.00	0.00	1.2860	1.0000	964.50	964.50	964.50	0.00	964.50
	300	APTMW US	ALPHA PARTNERS TECHNOLOGY-CW	USD	0.00	0.00	0.6600	1.0000	198.00	198.00	198.00	0.00	198.00
	499	ARBGW US	AEQUIT ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5700	1.0000	284.43	284.43	284.43	0.00	284.43
	750	ARGUW US	ARGUS CAPITAL CORP -CW23	USD	0.00	0.00	0.5598	1.0000	419.85	419.85	419.85	0.00	419.85
	373	ARRRW US	ARROWROOT ACQUISITION -CW26	USD	0.00	0.00	0.5349	1.0000	199.50	199.50	199.50	0.00	199.50
	239	ARTAW US	ARTISAN ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.7000	1.0000	167.30	167.30	167.30	0.00	167.30
	600	ARTEW US	ARTEMIS STRATEGIC INVEST -CW23	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	300.00	300.00	300.00	0.00	300.00
	1,557	ASAQ/WS US	ATLANTIC AVENUE ACQUISITION -CW25	USD	759.78	759.78	0.5000	1.0000	778.50	778.50	18.72	0.00	18.72
	525	ASAXW US	ASTREA ACQUISITION CORP-CW26	USD	0.00	0.00	0.4931	1.0000	258.88	258.88	258.88	0.00	258.88
	1,088	ASZ/WS US	AUSTERLITZ ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9330	1.0000	1,015.10	1,015.10	1,015.10	0.00	1,015.10
	187	ATA/WS US	AMERICAS TECH ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.4398	1.0000	82.23	82.23	82.23	0.00	82.23
	299	ATAQ/WS US	ALTIMAR ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8399	1.0000	251.13	251.13	251.13	0.00	251.13
	112	ATVCW US	TRIBE CAPITAL GROWTH CORP-CW	USD	0.00	0.00	0.8699	1.0000	97.43	97.43	97.43	0.00	97.43
	384	AURCW US	AURORA ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8098	1.0000	310.96	310.96	310.96	0.00	310.96
	375	AUS/WS US	AUSTERLITZ ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	1.0300	1.0000	386.25	386.25	386.25	0.00	386.25
	563	AVACW US	AVALON ACQUISITION INC-CW23	USD	0.00	0.00	0.3999	1.0000	225.14	225.14	225.14	0.00	225.14
	738	AVAN/WS US	AVANTI ACQUISITION A -CW25	USD	0.00	0.00	0.6125	1.0000	452.03	452.03	452.03	0.00	452.03
	375	BBLN/WS US	BABYLON HOLDINGS A -CW26	USD	0.00	0.00	0.7500	1.0000	281.25	281.25	281.25	0.00	281.25
	321	BGSX/WS US	BUILD ACQUIS CORP -A -CW26	USD	0.00	0.00	0.7164	1.0000	229.96	229.96	229.96	0.00	229.96
	375	BHACW US	CRUXUS BH3 ACQUISITION -CW26	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	187.50	187.50	187.50	0.00	187.50
	278	BIOTW US	BIOTECH ACQUISITION A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5976	1.0000	166.13	166.13	166.13	0.00	166.13
	448	BITE/WS US	BITE ACQUISITION CORP -CW27	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	232.96	232.96	232.96	0.00	232.96
	226	BLNGW US	BELONG ACQUISITION A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5299	1.0000	119.76	119.76	119.76	0.00	119.76
	600	BLTSW US	BRIGHT LIGHTS ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8299	1.0000	497.94	497.94	497.94	0.00	497.94
	499	BLUA/WS US	BLUIERIVER ACQUISITION -CW26	USD	0.00	0.00	0.6100	1.0000	304.39	304.39	304.39	0.00	304.39
	85	ENNRW US	BANNER ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	44.20	44.20	44.20	0.00	44.20
	738	BOAC/WS US	BLUESCAPE OPPORTUNITIES -CW26	USD	582.12	582.12	0.8900	1.0000	656.82	656.82	74.70	0.00	74.70
	250	BOAS/WS US	BOA ACQUISITION CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5497	1.0000	137.41	137.41	137.41	0.00	137.41
	100	BRIVW US	B RILEY PRINCIPAL 250 -CW27	USD	0.00	0.00	0.8500	1.0000	85.00	85.00	85.00	0.00	85.00
	187	BSKYW US	BIG SKY GROWTH PARTNERS-CW	USD	0.00	0.00	0.7500	1.0000	140.25	140.25	140.25	0.00	140.25

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
738	BTAQW	US	BURGUNDY TECHNOLOGY ACQ-CW25	USD	309.96	309.96	0.5799	1.0000	427.97	427.97	118.01	0.00	118.01
750	BWACW	US	BETTER WORLD ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.5102	1.0000	382.65	382.65	382.65	0.00	382.65
672	BYTSW	US	BYTE ACQUISITION COR A -CW28	USD	685.44	685.44	0.5302	1.0000	356.29	356.29	-329.15	0.00	-329.15
799	CAS/WS	US	CASCADE ACQUISITION COR-CW27	USD	0.00	0.00	0.4899	1.0000	391.43	391.43	391.43	0.00	391.43
1,807	CCAC/WS	US	CITIC CAPITAL ACQUISIT-CW27	USD	2,312.96	2,312.96	0.6200	1.0000	1,120.34	1,120.34	-1,192.62	0.00	-1,192.62
750	CCV/WS	US	CHURCHILL CAP V CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9700	1.0000	727.50	727.50	727.50	0.00	727.50
298	CCVI/WS	US	CHURCHILL CAP VI CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9801	1.0000	292.07	292.07	292.07	0.00	292.07
175	CDROW	US	CODERE ONLINE LUXEMBOU -CW	USD	0.00	0.00	0.9450	1.0000	165.38	165.38	165.38	0.00	165.38
223	CENQW	US	CENQA ENERGY CORP CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4200	1.0000	93.66	93.66	93.66	0.00	93.66
205	CFFEW	US	CF ACQUISITION VIII A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8697	1.0000	178.29	178.29	178.29	0.00	178.29
511	CFIVW	US	CF ACQUISITION CORP IV CW21	USD	8.21	8.21	0.7300	1.0000	373.03	373.03	364.82	0.00	364.82
99	CHAA/WS	US	CATCHA INVESTMENT -CW27	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	57.42	57.42	57.42	0.00	57.42
3,774	CHPMW	US	CHP MERGER CORP -CW24	USD	4,396.71	4,396.71	0.4737	1.0000	1,787.74	1,787.74	-2,608.97	0.00	-2,608.97
753	CIIGW	US	CIIG CAPITAL PART IIA -CW28	USD	0.00	0.00	0.7800	1.0000	587.34	587.34	587.34	0.00	587.34
298	CLAA/WS	US	COLONNADE ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6951	1.0000	207.14	207.14	207.14	0.00	207.14
187	CLAQW	US	CLEANTECH ACQUISITION CORPCW	USD	0.00	0.00	0.5764	1.0000	107.79	107.79	107.79	0.00	107.79
452	CLAS/WS	US	CLASS ACCELERATION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	235.04	235.04	235.04	0.00	235.04
500	CLBR/WS	US	COLOMBIER ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5300	1.0000	265.00	265.00	265.00	0.00	265.00
390	CLIM/WS	US	CLIMATE REAL IMPACT SOL-CW27	USD	0.00	0.00	1.1400	1.0000	444.60	444.60	444.60	0.00	444.60
600	CLRMW	US	CLARIM ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6600	1.0000	396.00	396.00	396.00	0.00	396.00
394	CNTQW	US	CHARDAN NEXTECH ACQUISIT-CW27	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	228.52	228.52	228.52	0.00	228.52
150	COLIW	US	COLICITY INC-A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7603	1.0000	114.05	114.05	114.05	0.00	114.05
1,500	CONXW	US	CONX CORP-CLASS A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8700	1.0000	1,305.00	1,305.00	1,305.00	0.00	1,305.00
1,000	COOLW	US	CORNER GROWTH ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6720	1.0000	672.00	672.00	672.00	0.00	672.00
168	CORS/WS	US	CORSAIR PARTNERING A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9900	1.0000	166.32	166.32	166.32	0.00	166.32
600	COVAW	US	CRESCENT COVE ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4956	1.0000	297.36	297.36	297.36	0.00	297.36
3,250	CPAAW	US	CONY P III -CW23	USD	0.00	0.00	1.0100	1.0000	3,282.50	3,282.50	3,282.50	0.00	3,282.50
179	CPARW	US	CATALYST PARTNERS AC A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8799	1.0000	157.50	157.50	157.50	0.00	157.50
1,603	CPSR/WS	US	CAPSTAR SPECIAL PURPOSE-CW27	USD	1,218.07	1,218.07	0.6102	1.0000	978.15	978.15	-239.92	0.00	-239.92
499	CPTK/WS	US	CROWN PROPTech ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5802	1.0000	289.52	289.52	289.52	0.00	289.52
562	CPUH/WS	US	COMPUTE HEALTH ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9000	1.0000	505.80	505.80	505.80	0.00	505.80
275	CRCQW	US	CALIFORNIA RESOURCES -CW27	USD	221.64	221.64	12.2500	1.0000	3,368.75	3,368.75	3,147.11	0.00	3,147.11
4,000	CRHC/WS	US	COHN ROBBINS HOLDINGS -CW25	USD	0.00	0.00	0.8025	1.0000	3,210.00	3,210.00	3,210.00	0.00	3,210.00
475	CRU/WS	US	CRUCIBLE ACQ CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.7196	1.0000	341.81	341.81	341.81	0.00	341.81
250	CRZNW	US	CORAZON CAPITAL V838 A -CW28	USD	230.03	230.03	0.6300	1.0000	157.50	157.50	-72.53	0.00	-72.53
600	CSTA/WS	US	CONSTELLATION ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6690	1.0000	401.40	401.40	401.40	0.00	401.40
500	CTAQW	US	CARNEY TECHNOLOGY ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.7425	1.0000	371.25	371.25	371.25	0.00	371.25
628	CVII/WS	US	CHURCHILL CAPITAL VII -CW28	USD	0.00	0.00	1.0250	1.0000	643.70	643.70	643.70	0.00	643.70
375	DCACW	NA	DISRUPTIVE CAPITAL ACQ -CW26	GBP	7.50	10.21	0.5500	1.3499	206.25	278.42	268.30	-0.09	268.21
736	DCRDW	US	DECARBONIZATION PLUS A -CW28	USD	0.00	0.00	0.9497	1.0000	698.98	698.98	698.98	0.00	698.98
165	DCRNW	US	DECARBONIZATION CL A -CW25	USD	216.98	216.98	1.5800	1.0000	260.70	260.70	43.72	0.00	43.72
498	DHBCW	US	DHB CAPITAL CORP-CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6499	1.0000	323.65	323.65	323.65	0.00	323.65
498	DHCAW	US	DHC ACQUISITION CORP A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5780	1.0000	287.84	287.84	287.84	0.00	287.84
525	DHHCW	US	DIAMONHEAD HOLDINGS A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5601	1.0000	294.05	294.05	294.05	0.00	294.05
417	DISAW	US	DISRUPTIVE ACQ CL A -CW26	USD	341.90	341.90	0.6799	1.0000	283.52	283.52	-58.38	0.00	-58.38
301	DLCAW	US	DEEP LAKE CAPITAL CL B -CW27	USD	0.00	0.00	0.6500	1.0000	195.65	195.65	195.65	0.00	195.65
1,650	DMYS/WS	US	DMY TECHNOLOGY GROUP -CW23	USD	0.00	0.00	1.2800	1.0000	1,344.00	1,344.00	1,344.00	0.00	1,344.00
400	DNZ/WS	US	D AND Z MEDIA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5798	1.0000	231.92	231.92	231.92	0.00	231.92
501	DRAYW	US	MACONDRAY CAPITAL AC A -CW23	USD	0.00	0.00	0.5672	1.0000	284.17	284.17	284.17	0.00	284.17
294	DSAQ/WS	US	DIRECT SEL -CW28	USD	0.00	0.00	0.4900	1.0000	144.06	144.06	144.06	0.00	144.06
261	DTOCW	US	DIGITAL TRANSFORMATION OPP-A	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	153.99	153.99	153.99	0.00	153.99
750	DTRTW	US	DTRI HEALTH ACQUISITIO -CW22	USD	0.00	0.00	0.4968	1.0000	365.10	365.10	365.10	0.00	365.10
562	DUNEW	US	DUNE ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5191	1.0000	291.73	291.73	291.73	0.00	291.73

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	750	DWIN/WS US	DELWINDS INSURANC CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5299	1.0000	397.43	397.43	397.43	0.00	397.43
	525	EACPW US	EDIFV ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4976	1.0000	261.24	261.24	261.24	0.00	261.24
	450	EDTXW US	EDTECHX HOLDINGS ACQUIS-CW25	USD	0.00	0.00	0.4940	1.0000	222.30	222.30	222.30	0.00	222.30
	497	EPICW NA	EUROPEAN FINTECH IPO CO-CW26	EUR	0.00	0.00	0.7500	1.1325	372.75	422.14	422.14	0.00	422.14
	111	EGGF/WS US	EG ACQUISITION CORP-A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6582	1.0000	73.06	73.06	73.06	0.00	73.06
	375	ENERW US	ACCRETION ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.4000	1.0000	150.00	150.00	150.00	0.00	150.00
	375	ENJYW US	MARQUEE RAINE ACQ CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.5300	1.0000	198.75	198.75	198.75	0.00	198.75
	450	ENNVW US	ECP ENVIRONMENTAL GROW -CW28	USD	0.00	0.00	0.7499	1.0000	337.46	337.46	337.46	0.00	337.46
	1,198	ENPC/WS US	EXECUTIVE NETWORK PART -CW28	USD	0.00	0.00	0.6791	1.0000	813.56	813.56	813.56	0.00	813.56
	900	ENTFW US	ENTERPRISE 4.0 TECHNOL -CW23	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	468.00	468.00	468.00	0.00	468.00
	897	ENVIW US	ENVIRONMENTAL IMPACT -CW27	USD	0.00	0.00	1.2000	1.0000	1,076.40	1,076.40	1,076.40	0.00	1,076.40
	562	EOCW/WS US	ELLIOTT OPPORTUNITY II-CW23	USD	0.00	0.00	1.0401	1.0000	584.54	584.54	584.54	0.00	584.54
	500	EPHYW US	EPIPHANY TECHNOLOGY AC -CW27	USD	0.00	0.00	0.7101	1.0000	355.05	355.05	355.05	0.00	355.05
	514	EPICW NA	EPIC ACQUISITION CORP -WT	EUR	10.28	11.60	0.2800	1.1325	143.92	162.99	151.35	0.04	151.39
	675	EPWR/WS US	EMPOWERMENT & INC CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5497	1.0000	371.05	371.05	371.05	0.00	371.05
	730	EQD/WS US	EQUITY DISTRIBUTION A -CW25	USD	0.00	0.00	0.7585	1.0000	554.40	554.40	554.40	0.00	554.40
	765	EQHA/WS US	EQ HEALTH ACQ A -CW28	USD	94.86	94.86	0.5499	1.0000	420.67	420.67	325.81	0.00	325.81
	867	ERESW US	EAST RESOURCES ACQUIS -CW27	USD	579.59	579.59	0.5400	1.0000	468.18	468.18	-111.41	0.00	-111.41
	750	ESACW US	ESGEN ACQUISITION A -CW23	USD	0.00	0.00	0.4999	1.0000	374.93	374.93	374.93	0.00	374.93
	168	ESGWA NA	ESG CORE INVESTMENTS -CW27	EUR	169.68	199.83	0.6533	1.1325	109.75	124.29	-67.87	-7.67	-75.54
	498	ESM/WS US	ESM ACQUISITION CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.7300	1.0000	363.54	363.54	363.54	0.00	363.54
	750	ETACW US	E.MERGE TECHNOLOGY ACQ -CW25	USD	711.82	711.82	0.5623	1.0000	421.73	421.73	-290.09	0.00	-290.09
	2,250	EVLVW US	NEWHOLD INVESTMENT A -CW25	USD	1,530.22	1,530.22	0.8200	1.0000	1,845.00	1,845.00	314.78	0.00	314.78
	225	FACA/WS US	FIGURE ACQ I CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.1700	1.0000	263.25	263.25	263.25	0.00	263.25
	112	FACT/WS US	FREEDOM ACQ I CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5997	1.0000	67.17	67.17	67.17	0.00	67.17
	313	FATH/WS US	ALTIMAR ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7500	1.0000	234.75	234.75	234.75	0.00	234.75
	750	FATPW US	FAT PROJECTS ACQUISIT -CW22	USD	0.00	0.00	0.3701	1.0000	277.58	277.58	277.58	0.00	277.58
	300	FCAX/WS US	FORTRESS CAP ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7500	1.0000	225.00	225.00	225.00	0.00	225.00
	250	FICVW US	FRONTIER INVESTMENT A -CW23	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	147.50	147.50	147.50	0.00	147.50
	450	FIMMW US	MARLIN TECHNOLOGY -CW26	USD	0.00	0.00	0.6998	1.0000	314.91	314.91	314.91	0.00	314.91
	675	FLME/WS US	FLAME ACQUISITION CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	405.00	405.00	405.00	0.00	405.00
	571	FLYA/WS US	SOAR TECH ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5499	1.0000	313.99	313.99	313.99	0.00	313.99
	900	FMAC/WS US	FIRSTMARK HORIZON ACQU -CW25	USD	0.00	0.00	0.9800	1.0000	882.00	882.00	882.00	0.00	882.00
	299	FMIVW US	FORUM MERGER IV CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9200	1.0000	275.08	275.08	275.08	0.00	275.08
	506	FNVTW US	FINOVATE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.3900	1.0000	197.34	197.34	197.34	0.00	197.34
	750	FOUNW US	FOUNDER SPAC -CW23	USD	0.00	0.00	0.7401	1.0000	555.08	555.08	555.08	0.00	555.08
	207	FPAC/WS US	FAR PEAK ACQ CL A -CW25	USD	348.84	348.84	1.9500	1.0000	403.65	403.65	54.81	0.00	54.81
	187	FRONW US	FRONTIER ACQUISITION - CW28	USD	0.00	0.00	0.8672	1.0000	162.17	162.17	162.17	0.00	162.17
	224	FRSGW US	FIRST RESERVE SUST A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8099	1.0000	181.42	181.42	181.42	0.00	181.42
	149	FRWAW US	PWP FORWARD ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8796	1.0000	131.06	131.06	131.06	0.00	131.06
	239	FRXB/WS US	FOREST ROAD ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.7600	1.0000	181.64	181.64	181.64	0.00	181.64
	750	FSNB/WS US	FUSION ACQ II CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6200	1.0000	465.00	465.00	465.00	0.00	465.00
	919	FSRXW US	FINSERV ACQUISITION CO-CW26	USD	0.00	0.00	0.5725	1.0000	526.13	526.13	526.13	0.00	526.13
	450	FSSIW US	FORTISTAR SUSTAIN A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6100	1.0000	274.50	274.50	274.50	0.00	274.50
	150	FTAAW US	FTAC ATHENA ACQUISITION CO-A	USD	0.00	0.00	1.1500	1.0000	172.50	172.50	172.50	0.00	172.50
	249	FTEV/WS US	FINTECH EVOLUTION ACQUISIT-A	USD	0.00	0.00	0.5750	1.0000	143.17	143.17	143.17	0.00	143.17
	205	FTPAW US	FTAC PARNASSUS ACQ A -CW26	USD	0.00	0.00	1.0627	1.0000	217.85	217.85	217.85	0.00	217.85
	375	FTVIW US	FINTECH ACQUISITION A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8301	1.0000	311.29	311.29	311.29	0.00	311.29
	280	FVIV/WS US	FORTRESS VALUE ACQ IV -CW28	USD	295.40	295.40	0.8628	1.0000	241.58	241.58	-53.82	0.00	-53.82
	450	FVT/WS US	FORTRESS VALUE ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8000	1.0000	360.00	360.00	360.00	0.00	360.00
	307	FZT/WS US	FAST ACQUISITION II A -CW26	USD	0.00	0.00	0.9550	1.0000	293.19	293.19	293.19	0.00	293.19
	547	GACQW US	GLOBAL CONSUMER ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.5798	1.0000	317.15	317.15	317.15	0.00	317.15
	441	GAMCW US	GOLDEN ARROW MERGER A -CW26	USD	0.00	0.00	0.5079	1.0000	223.98	223.98	223.98	0.00	223.98

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
973	GAPA/WS	US	G&P ACQUISITION CL A -CW27	USD	465.75	465.75	0.4900	1.0000	467.04	467.04	1.29	0.00	1.29
825	GFJW	GR	GFJ ESG ACQUISITION I SE-CW	EUR	16.50	19.14	0.4500	1.1325	371.25	420.44	401.75	-0.45	401.30
600	GFX/WS	US	GOLDEN FALCON ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.6400	1.0000	384.00	384.00	384.00	0.00	384.00
150	GGMCW	US	GLENFARNE MERGER CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6095	1.0000	91.43	91.43	91.43	0.00	91.43
499	GHACW	US	GAMING & HOSPITALITY A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	299.40	299.40	299.40	0.00	299.40
600	GIA/WS	US	GIGACAPITAL5 INC -CW28	USD	0.00	0.00	0.5022	1.0000	301.32	301.32	301.32	0.00	301.32
1,485	GIACW	US	GESHER I ACQUISITION -CW28	USD	0.00	0.00	0.5998	1.0000	890.70	890.70	890.70	0.00	890.70
187	GIIXW	US	GORES HOLD VIII CL A -CW27	USD	0.00	0.00	2.0000	1.0000	374.00	374.00	374.00	0.00	374.00
301	GLBLW	US	CARTESIAN GROWTH CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.1100	1.0000	334.11	334.11	334.11	0.00	334.11
94	GLEEW	US	GLADSTONE ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	47.00	47.00	47.00	0.00	47.00
67	GLHAW	US	GLASS HOUSES ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.6300	1.0000	42.21	42.21	42.21	0.00	42.21
446	GLSPW	US	GLOBAL SPAC PARTNERS -CW27	USD	0.00	0.00	0.4995	1.0000	218.32	218.32	218.32	0.00	218.32
375	GLTA/WS	US	GALATA ACQ CORP CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.4500	1.0000	168.75	168.75	168.75	0.00	168.75
499	GMBTW	US	QUEEN'S GAMBIT GRTH -A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6300	1.0000	314.37	314.37	314.37	0.00	314.37
690	GMIIW	US	GORES METROPOLIS II -CW28	USD	0.00	0.00	1.6700	1.0000	1,152.30	1,152.30	1,152.30	0.00	1,152.30
499	GNACW	US	GROUP NINE ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	259.48	259.48	259.48	0.00	259.48
1,043	GOAC/WS	US	GO ACQUISITION CORP -CW27G0	USD	1,121.22	1,121.22	0.6606	1.0000	689.01	689.01	-432.21	0.00	-432.21
375	GOEN/WS	US	GOGREEN INVESTMENTS -CW23	USD	0.00	0.00	0.4600	1.0000	172.50	172.50	172.50	0.00	172.50
125	GPACW	US	GLOBAL PARTNER ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8202	1.0000	102.53	102.53	102.53	0.00	102.53
750	GSAQW	US	GLOBAL SYNERGY ACQUIS -CW27	USD	0.00	0.00	0.4992	1.0000	374.40	374.40	374.40	0.00	374.40
281	GSEVW	US	GORES HOLDINGS VII A -CW27	USD	0.00	0.00	1.3600	1.0000	382.16	382.16	382.16	0.00	382.16
150	GSQB/WS	US	G SQUARED ASCEND II -CW26	USD	0.00	0.00	0.5999	1.0000	89.99	89.99	89.99	0.00	89.99
180	GSQD/WS	US	G SQUARED ASCEND I -CW27	USD	0.00	0.00	0.8699	1.0000	156.58	156.58	156.58	0.00	156.58
300	GTPAW	US	GORES TECH PARTN CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.3200	1.0000	396.00	396.00	396.00	0.00	396.00
299	GTPBW	US	GORES TECH PARTN II A -CW27	USD	0.00	0.00	1.3000	1.0000	388.70	388.70	388.70	0.00	388.70
375	GWIIW	US	GOOD WORKS II ACQUISITION CW	USD	0.00	0.00	0.5822	1.0000	218.33	218.33	218.33	0.00	218.33
299	GXIIW	US	GX ACQUISITION II A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5500	1.0000	164.45	164.45	164.45	0.00	164.45
525	HAACW	US	HEALTH ASSURANCE ACQU-CW25	USD	0.00	0.00	0.8723	1.0000	457.96	457.96	457.96	0.00	457.96
225	HCAW	US	HEALTHCARE SERVICES -CW27	USD	0.00	0.00	0.4900	1.0000	110.25	110.25	110.25	0.00	110.25
262	HCIW	US	HENNESSY CAPITAL INVES-CW26	USD	0.00	0.00	0.8345	1.0000	218.64	218.64	218.64	0.00	218.64
187	HCIIW	US	HUDSON EXECUTIVE INV -CW27	USD	0.00	0.00	0.7350	1.0000	137.45	137.45	137.45	0.00	137.45
375	HCNW	US	JAWS HURRICANE ACQUISITI-CW	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	375.00	375.00	375.00	0.00	375.00
572	HEGAW	NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN-CW27	EUR	0.00	0.00	1.0000	1.1325	572.00	647.79	647.79	0.00	647.79
373	HERAW	US	FTAC HERA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8800	1.0000	328.24	328.24	328.24	0.00	328.24
1,000	HIGA/WS	US	HIG ACQUISITION CORP A -CW25	USD	0.00	0.00	0.7000	1.0000	700.00	700.00	700.00	0.00	700.00
360	HIIW	US	HUDSON EXECUTIVE INVESTMEN-A	USD	0.00	0.00	0.7100	1.0000	255.60	255.60	255.60	0.00	255.60
250	HLAHW	US	HAMILTON LANE ALL-CLAS-CW26	USD	0.00	0.00	0.6199	1.0000	154.98	154.98	154.98	0.00	154.98
2,970	HPLTW	US	HOME PLATE ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.5449	1.0000	1,618.35	1,618.35	1,618.35	0.00	1,618.35
750	HPX/WS	US	HPX CORP-A -CW25	USD	315.00	315.00	0.5901	1.0000	442.58	442.58	127.58	0.00	127.58
300	HTGW	GR	HOMETOGO SE - CW25	EUR	315.00	370.97	0.6000	1.1325	180.00	203.85	-152.89	-14.23	-167.12
600	HTPA/WS	US	HIGHLAND TRANSCEN CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.5700	1.0000	942.00	942.00	942.00	0.00	942.00
150	HWELW	US	HEALTHWELL ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	88.50	88.50	88.50	0.00	88.50
738	HZON/WS	US	HORIZON ACQUIS CORP II -CW27	USD	0.00	0.00	0.9900	1.0000	730.62	730.62	730.62	0.00	730.62
750	ICNC/WS	US	ICONIC SPORTS ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	435.00	435.00	435.00	0.00	435.00
750	IGACW	US	IG ACQUISITION CORP A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8102	1.0000	607.69	607.69	607.69	0.00	607.69
500	IIIIW	US	INSU ACQUISITION III -CW26	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	290.00	290.00	290.00	0.00	290.00
886	IMPX/WS	US	AEA-BRIDGES IMPACT COR -CW25	USD	0.00	0.00	1.1300	1.0000	1,001.18	1,001.18	1,001.18	0.00	1,001.18
750	INKAW	US	KLUDEIN I ACQUISITION-CW27	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	450.00	450.00	450.00	0.00	450.00
600	IPOD/WS	US	SOCIAL CAPITAL HEDOSOP -CW25	USD	0.00	0.00	2.0300	1.0000	1,218.00	1,218.00	1,218.00	0.00	1,218.00
562	IPOF/WS	US	SOCIAL CAPITAL HED VI - CW25	USD	0.00	0.00	1.9300	1.0000	1,084.66	1,084.66	1,084.66	0.00	1,084.66
424	IPVA/WS	US	INTERPRIVATE II ACQU-CLASS A	USD	0.00	0.00	0.8931	1.0000	378.66	378.66	378.66	0.00	378.66
419	IPVF/WS	US	INTERPRIVATE III FIN A -CW27	USD	0.00	0.00	1.4900	1.0000	624.31	624.31	624.31	0.00	624.31
328	IPVIW	US	INTERPRIVATE IV INFRAT -CW27	USD	0.00	0.00	0.8100	1.0000	265.68	265.68	265.68	0.00	265.68

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	300	ISLEW US	ISLEWORTH HEALTHCARE -CW27	USD	0.00	0.00	0.5120	1.0000	153.60	153.60	153.60	0.00	153.60
	600	ITHXW US	ITHAX ACQU CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5499	1.0000	329.94	329.94	329.94	0.00	329.94
	300	ITQRW US	ITIQUIRA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5300	1.0000	159.00	159.00	159.00	0.00	159.00
	750	JACQW US	JUPITER ACQUISITION A -CW23	USD	0.00	0.00	0.4853	1.0000	363.98	363.98	363.98	0.00	363.98
	375	JATT/WS US	JATT ACQUISITION CORP -CW23	USD	0.00	0.00	0.5099	1.0000	191.21	191.21	191.21	0.00	191.21
	525	JCICW US	JACK CREEK INVESTMENT -CW27	USD	0.00	0.00	0.5400	1.0000	283.50	283.50	283.50	0.00	283.50
	750	JMACW US	JADE MOUNTAIN ACQUIS -CW23	USD	0.00	0.00	0.4000	1.0000	300.00	300.00	300.00	0.00	300.00
	1,464	JOFFW US	JOFF FINTECH ACQ -CW27	USD	561.00	561.00	0.6700	1.0000	980.88	980.88	419.88	0.00	419.88
	525	JUGGW US	JAWS JUGGERNAUT ACQUI-CW23	USD	0.00	0.00	1.0200	1.0000	535.50	535.50	535.50	0.00	535.50
	362	JWSM/WS US	JAWS MUSTANG ACQ C -CW26	USD	0.00	0.00	1.0100	1.0000	567.62	567.62	567.62	0.00	567.62
	373	KAHC/WS US	KKR ACQ HOLDING I CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9800	1.0000	365.54	365.54	365.54	0.00	365.54
	250	KALIW US	KISMET ACQ TWO CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4980	1.0000	124.50	124.50	124.50	0.00	124.50
	750	KAIRW US	KAIROS ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5300	1.0000	397.50	397.50	397.50	0.00	397.50
	1,800	KCGI/WS US	KENSINGTON CAPITAL ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.9701	1.0000	1,746.18	1,746.18	1,746.18	0.00	1,746.18
	250	KIIW US	KISMET ACQ THREE A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5100	1.0000	127.50	127.50	127.50	0.00	127.50
	450	KINZW US	KINS TECH GROUP CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.4865	1.0000	218.93	218.93	218.93	0.00	218.93
	500	KLAQW US	KL ACQUISITION CORP -CW28	USD	0.00	0.00	0.5007	1.0000	250.35	250.35	250.35	0.00	250.35
	618	KORE/WS US	KING PUBCO INC -CW28	USD	0.00	0.00	1.0500	1.0000	648.90	648.90	648.90	0.00	648.90
	750	KRNW US	KERNEL GROUP HLDG -A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4811	1.0000	360.83	360.83	360.83	0.00	360.83
	248	KSLCW US	KADEM SUSTAINABLE CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.5300	1.0000	131.44	131.44	131.44	0.00	131.44
	562	KWAC/WS US	KINGSWOOD ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4370	1.0000	245.59	245.59	245.59	0.00	245.59
	349	LCAAW US	L CATTERTON ASIA ACQ-CW	USD	0.00	0.00	0.7900	1.0000	275.71	275.71	275.71	0.00	275.71
	373	LCAHW US	LANDCADIA HOLDINGS IV -CW28	USD	0.00	0.00	1.0300	1.0000	384.19	384.19	384.19	0.00	384.19
	750	LCW/WS US	LEARN CW INVESTMENT A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5500	1.0000	412.50	412.50	412.50	0.00	412.50
	263	LDHAW US	LDH GROWTH CORP I CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.7600	1.0000	199.88	199.88	199.88	0.00	199.88
	120	LEAP/WS US	RIBBIT LEAP LTD -A -CW25	USD	0.00	0.00	1.3200	1.0000	158.40	158.40	158.40	0.00	158.40
	224	LEGAW US	LEAD EDGE GROWTH OPP A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6500	1.0000	145.60	145.60	145.60	0.00	145.60
	499	LPTRW US	LEFTERIS ACQUISITION A -CW25	USD	0.00	0.00	0.7947	1.0000	396.56	396.56	396.56	0.00	396.56
	450	LGACW US	LAZARD GROWTH ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8750	1.0000	393.75	393.75	393.75	0.00	393.75
	418	LGV/WS US	LONGVIEW ACQUIS -A -CW26	USD	549.67	549.67	0.7700	1.0000	321.86	321.86	-227.81	0.00	-227.81
	487	LHC/WS US	LEO HOLDINGS II CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	287.33	287.33	287.33	0.00	287.33
	300	LIONW US	LIONHEART III CL A -CW23	USD	0.00	0.00	0.4400	1.0000	132.00	132.00	132.00	0.00	132.00
	195	LITW US	LOGISTICS INNOVATION T-CW28	USD	0.00	0.00	0.9101	1.0000	177.47	177.47	177.47	0.00	177.47
	525	LJAQW US	LIGHTJUMP ACQUISITION -CW27	USD	0.00	0.00	0.5650	1.0000	296.63	296.63	296.63	0.00	296.63
	675	LNFA/WS US	L&F ACQUISITION CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6500	1.0000	438.75	438.75	438.75	0.00	438.75
	540	LOCC/WS US	LIVE OAK CRESTVIEW -CW26	USD	0.00	0.00	1.4000	1.0000	756.00	756.00	756.00	0.00	756.00
	269	LOKM/WS US	LIVE OAK MOBILITY ACQ -CW28	USD	0.00	0.00	1.0800	1.0000	290.52	290.52	290.52	0.00	290.52
	250	LUXAW US	LUX HEALTH TECH ACQUIS -CW27	USD	0.00	0.00	0.8896	1.0000	217.40	217.40	217.40	0.00	217.40
	498	LVRAW US	LEVERE HOLDINGS CORP A -CW28	USD	0.00	0.00	0.7099	1.0000	353.55	353.55	353.55	0.00	353.55
	301	MACAW US	MORINGA ACQUISITION COR-CW26	USD	0.00	0.00	0.5499	1.0000	165.52	165.52	165.52	0.00	165.52
	149	MACC/WS US	MISSION ADVANCEMENT A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5198	1.0000	77.45	77.45	77.45	0.00	77.45
	600	MACUW US	MALLARD ACQUISITION -CW27	USD	0.00	0.00	0.2701	1.0000	162.06	162.06	162.06	0.00	162.06
	150	MAQCW US	MAQUIA CAPITAL ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4996	1.0000	74.94	74.94	74.94	0.00	74.94
	398	MBAC/WS US	M3-BRIGADE ACQ II -CW27	USD	0.00	0.00	1.1700	1.0000	465.66	465.66	465.66	0.00	465.66
	400	MBSC/WS US	M3-BRIGADE ACQ III -CW23	USD	0.00	0.00	0.5401	1.0000	216.04	216.04	216.04	0.00	216.04
	450	MDH/WS US	MDH ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.4599	1.0000	206.96	206.96	206.96	0.00	206.96
	525	MEACW US	MERCURY ECOMMERCE ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.4480	1.0000	234.15	234.15	234.15	0.00	234.15
	300	MIMO/WS US	AIRSPAN NETWORKS HOLDINGS-CW	USD	0.00	0.00	0.7900	1.0000	359.45	359.45	359.45	0.00	359.45
	700	MIT/WS US	MASON INDUSTRIAL CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6300	1.0000	441.00	441.00	441.00	0.00	441.00
	250	MITAW US	COLISEUM ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.7100	1.0000	177.50	177.50	177.50	0.00	177.50
	750	MONCW US	MONUMENT CIRC ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4919	1.0000	368.93	368.93	368.93	0.00	368.93
	435	MSDAW US	MSD ACQUISITION CORP A -CW28	USD	150.75	150.75	1.2000	1.0000	522.00	522.00	371.25	0.00	371.25
	250	MTAL/WS US	METALS ACQUISITION A -CW23	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	147.50	147.50	147.50	0.00	147.50

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	600	MTRYW US	MONTEREY BIO ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.3900	1.0000	234.00	234.00	234.00	0.00	234.00
	1,486	NAACW US	NORTH ATLANTIC ACQ -CW25	USD	0.00	0.00	0.8399	1.0000	1,247.25	1,247.25	1,247.25	0.00	1,247.25
	259	NBSTW US	NEWBURY STREET ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.4985	1.0000	129.11	129.11	129.11	0.00	129.11
	750	NCACW US	NEWCOURT ACQUISITION -CW28	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	375.00	375.00	375.00	0.00	375.00
	239	NDACW US	NIGHTDRAGON ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.8650	1.0000	206.72	206.72	206.72	0.00	206.72
	152	NGC/WS US	NORTHERN GENESIS ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.8900	1.0000	135.28	135.28	135.28	0.00	135.28
	295	NGCAW US	NEXTGEN ACQ CORP II -A -CW27	USD	289.13	289.13	1.4200	1.0000	418.90	418.90	129.77	0.00	129.77
	2,598	NHICW US	NEWHOLD INVESTM II-A -CW23	USD	0.00	0.00	0.4997	1.0000	1,298.09	1,298.09	1,298.09	0.00	1,298.09
	150	NLITW US	NORTHERN LIGHTS ACQUIS -CW22	USD	0.00	0.00	0.5097	1.0000	76.46	76.46	76.46	0.00	76.46
	721	NMCMW US	NORTH MOUNTAIN MERGER -CW25	USD	0.00	0.00	0.8102	1.0000	584.15	584.15	584.15	0.00	584.15
	2,475	NOACW US	NATURAL ORDER ACQ -CW25	USD	0.00	0.00	0.4300	1.0000	1,064.25	1,064.25	1,064.25	0.00	1,064.25
	1,347	NPF-WU CN	NEXTPPOINT ACQUISITION-CW25	USD	1,232.50	1,232.50	0.4800	1.0000	646.56	646.56	-585.94	0.00	-585.94
	375	NRACW US	NOBLE ROCK ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5701	1.0000	213.77	213.77	213.77	0.00	213.77
	75	NSTC/WS US	NORTHERN STAR INV CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9100	1.0000	68.25	68.25	68.25	0.00	68.25
	75	NSTD/WS US	NORTHERN STAR INV CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8700	1.0000	65.25	65.25	65.25	0.00	65.25
	150	NVSAW US	NEW VISTA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7699	1.0000	115.49	115.49	115.49	0.00	115.49
	528	NXU/WS US	NOVUS CAPITAL II CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.2500	1.0000	660.00	660.00	660.00	0.00	660.00
	951	OACB/WS US	OAKTREE ACQ CORP II A -CW27	USD	0.00	0.00	1.0900	1.0000	1,036.59	1,036.59	1,036.59	0.00	1,036.59
	705	OCA/WS US	OMNICHANNEL ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	423.00	423.00	423.00	0.00	423.00
	375	OCAXW US	OCA ACQ CORP -CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4800	1.0000	180.00	180.00	180.00	0.00	180.00
	499	OEPWW US	ONE EQUITY PARTNERS A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5651	1.0000	281.98	281.98	281.98	0.00	281.98
	187	OHPAW US	ORION ACQUISITION CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.6500	1.0000	121.55	121.55	121.55	0.00	121.55
	150	ONYXW US	ONYX ACQ CO I CL A -CW23	USD	0.00	0.00	0.4650	1.0000	348.75	348.75	348.75	0.00	348.75
	149	ORIAW US	ORION BIOTECH OPPORTU -CW27	USD	0.00	0.00	0.9600	1.0000	143.04	143.04	143.04	0.00	143.04
	373	OSI/WS US	OSIRIS ACQUISITION CORP-CW28	USD	0.00	0.00	0.5600	1.0000	208.88	208.88	208.88	0.00	208.88
	375	OSTRW US	OSTER ENTERPRISE ACQUIS-W27	USD	0.00	0.00	0.4602	1.0000	172.58	172.58	172.58	0.00	172.58
	330	OTAW GR	OBOTECH ACQUISITION SE -CW	EUR	247.50	297.12	0.7000	1.1325	231.00	261.61	-18.69	-16.82	-35.51
	750	OTEWC US	OCEANTECH ACQUISITIONS- CW A	USD	0.00	0.00	0.4600	1.0000	345.00	345.00	345.00	0.00	345.00
	375	OTRAW US	OTR ACQUISITION -CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	187.50	187.50	187.50	0.00	187.50
	750	OXACW US	OXBRIDGE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.4189	1.0000	314.18	314.18	314.18	0.00	314.18
	595	OXUSW US	OXUS ACQUISITION CORP -CW23	USD	0.00	0.00	0.5998	1.0000	356.88	356.88	356.88	0.00	356.88
	198	PACEW NA	PEGASUS ACQUISITION CO CW27	EUR	0.00	0.00	1.2500	1.1325	247.50	280.29	280.29	0.00	280.29
	250	PACXW US	PIONEER MERGER CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7001	1.0000	175.02	175.02	175.02	0.00	175.02
	300	PAQCW US	PROVIDENT ACQUISITION-CW26	USD	0.00	0.00	0.5399	1.0000	161.97	161.97	161.97	0.00	161.97
	300	PBAXW US	PHOENIX BIOTECH ACQ -CW26	USD	0.00	0.00	0.4429	1.0000	132.87	132.87	132.87	0.00	132.87
	150	PCPC/WS US	PERIPHAS CAPITAL CL A -CW28	USD	0.00	0.00	1.5050	1.0000	225.75	225.75	225.75	0.00	225.75
	721	PDOT/WS US	PERIDOT ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8198	1.0000	591.09	591.09	591.09	0.00	591.09
	375	PEPLW US	PEPPERLINE HEALTH ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.4500	1.0000	168.75	168.75	168.75	0.00	168.75
	300	PFDWR US	PATHFINDER ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5999	1.0000	179.97	179.97	179.97	0.00	179.97
	250	PFTA W US	PORTAGE FINTECH ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.6200	1.0000	155.00	155.00	155.00	0.00	155.00
	375	PGRWW US	PROGRESS ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.4997	1.0000	187.39	187.39	187.39	0.00	187.39
	400	PHICW US	POPULATION HEALTH CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	208.00	208.00	208.00	0.00	208.00
	738	PIAI/WS US	PRIME IMPACT ACQ I -CW30	USD	0.00	0.00	0.5420	1.0000	400.00	400.00	400.00	0.00	400.00
	105	PIVOC/WS US	PIVOTAL INV 3 CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9545	1.0000	100.22	100.22	100.22	0.00	100.22
	555	PIPP/WS US	PINE ISLAND ACQ-CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8800	1.0000	488.40	488.40	488.40	0.00	488.40
	239	PLMIW US	PLJM ACQUISITION I A -CW28	USD	0.00	0.00	0.7576	1.0000	181.07	181.07	181.07	0.00	181.07
	499	PMGMW US	PRIVETERRA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5102	1.0000	254.59	254.59	254.59	0.00	254.59
	750	PMVC/WS US	PMV CONSUMER ACQUISIT -CW27	USD	0.00	0.00	0.6372	1.0000	477.86	477.86	477.86	0.00	477.86
	737	PNTM/WS US	PONTEM CORP-CLASS A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8798	1.0000	648.41	648.41	648.41	0.00	648.41
	500	POWRW US	POWERED BRANDS CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6001	1.0000	300.05	300.05	300.05	0.00	300.05
	750	PPGHW US	POEMA GLOBAL HOLD CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.5200	1.0000	1,140.00	1,140.00	1,140.00	0.00	1,140.00
	1,181	PRPB/WS US	CC NEUBERGER PRINCIPAL -CW25	USD	1,978.17	1,978.17	1.3000	1.0000	1,535.30	1,535.30	-442.87	0.00	-442.87
	240	PRPC/WS US	CC NEUBERGER PRINCIPAL -CW27	USD	0.00	0.00	1.0800	1.0000	259.20	259.20	259.20	0.00	259.20

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
600	PRSRW	US	PROSPECTOR CAPITAL CORP-CW25	USD	0.00	0.00	0.6225	1.0000	373.50	373.50	373.50	0.00	373.50
280	PSAGW	US	PROPERTY SOLUTIONS A -CW26	USD	0.00	0.00	0.5650	1.0000	158.20	158.20	158.20	0.00	158.20
750	PTICW	US	PROPTech INV CORP 2 -CW27	USD	0.00	0.00	0.6499	1.0000	487.43	487.43	487.43	0.00	487.43
249	PTOCW	US	PINE TECHNOLOGY ACQ A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6311	1.0000	157.14	157.14	157.14	0.00	157.14
919	PUCKW	US	GOAL ACQUISITIONS CORP-CW	USD	0.00	0.00	0.5500	1.0000	505.45	505.45	505.45	0.00	505.45
375	PV/WS	US	PRIMAVERA CAP ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.6200	1.0000	232.50	232.50	232.50	0.00	232.50
295	QFTA/WS	US	QUANTUM FINTECH ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.4800	1.0000	141.60	141.60	141.60	0.00	141.60
590	RBAC/WS	US	REDBALL ACQUISITION -CW22	USD	814.20	814.20	1.1650	1.0000	687.35	687.35	-126.85	0.00	-126.85
750	RCHGW	US	RECHARGE ACQUISITION -CW27	USD	0.00	0.00	0.4957	1.0000	371.78	371.78	371.78	0.00	371.78
398	RCLFW	US	ROSECLIFF ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7000	1.0000	278.60	278.60	278.60	0.00	278.60
225	REVIEW	US	ALPINE ACQUISITION COR -CW23	USD	0.00	0.00	0.4749	1.0000	106.85	106.85	106.85	0.00	106.85
389	REVHW	US	REVOLUTION HEALTHCARE -CW28	USD	0.00	0.00	0.7299	1.0000	283.94	283.94	283.94	0.00	283.94
262	RICOW	US	AGRICO ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.4201	1.0000	110.07	110.07	110.07	0.00	110.07
224	RKTA/WS	US	ROCKET INTERNET GROWTH -CW27	USD	0.00	0.00	0.7400	1.0000	165.76	165.76	165.76	0.00	165.76
600	RMGCW	US	RMG ACQUISITION CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8000	1.0000	480.00	480.00	480.00	0.00	480.00
300	ROCGW	US	ROTH CH ACQUISITION IV -CW23	USD	0.00	0.00	0.8100	1.0000	243.00	243.00	243.00	0.00	243.00
375	RONI/WS	US	RICE ACQUISITION CORP II-CW	USD	0.00	0.00	1.5000	1.0000	562.50	562.50	562.50	0.00	562.50
372	ROSEW	US	ROSE HILL ACQUISITION -CW24	USD	0.00	0.00	0.4606	1.0000	172.73	172.73	172.73	0.00	172.73
498	ROSS/WS	US	ROSS ACQUISITION CORP -CW26	USD	0.00	0.00	0.8498	1.0000	423.20	423.20	423.20	0.00	423.20
300	RVACW	US	RIVERVIEW ACQUISITION -CW28	USD	0.00	0.00	0.4982	1.0000	149.46	149.46	149.46	0.00	149.46
359	RXRW	US	RXR ACQUISITION CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.7100	1.0000	254.89	254.89	254.89	0.00	254.89
456	SANBW	US	SANABY HEALTH ACQ -CW28	USD	0.00	0.00	0.4600	1.0000	209.76	209.76	209.76	0.00	209.76
651	SBEAW	US	SILVERBOX ENGAGED MERG -CW27	USD	0.00	0.00	1.3999	1.0000	911.33	911.33	911.33	0.00	911.33
399	SBII/WS	US	SANDBRIDGE X2 CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5601	1.0000	223.48	223.48	223.48	0.00	223.48
598	SCAQW	US	STRATIM CLOUD ACQ -CW28	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	352.82	352.82	352.82	0.00	352.82
298	SCLEW	US	BROADSCALE ACQ CL A -CW26	USD	0.00	0.00	1.0200	1.0000	303.96	303.96	303.96	0.00	303.96
441	SCOAW	US	SCION TECH GROWTH I-CW25	USD	0.00	0.00	0.6099	1.0000	268.97	268.97	268.97	0.00	268.97
1,547	SCVX/WS	US	CVX CORP - CLASS A -CW25	USD	2,274.09	2,274.09	0.3201	1.0000	495.19	495.19	-1,778.90	0.00	-1,778.90
738	SDACW	US	SUSTAINABLE DEVELOP A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5999	1.0000	442.73	442.73	442.73	0.00	442.73
412	SGLIW	US	SEAPORT GLOBAL ACQ II -CW23	USD	0.00	0.00	0.4999	1.0000	205.96	205.96	205.96	0.00	205.96
2,599	SHACW	US	SCP & CO HEALTHCARE A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5494	1.0000	1,427.89	1,427.89	1,427.89	0.00	1,427.89
375	SHQAW	US	SHELTER ACQ I CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	187.50	187.50	187.50	0.00	187.50
560	SLAC/WS	US	SOCIAL LEVERAGE ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8011	1.0000	448.62	448.62	448.62	0.00	448.62
300	SLAMW	US	SLAM CORP-A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6285	1.0000	188.55	188.55	188.55	0.00	188.55
375	SLCRW	US	SILVER CREST ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5999	1.0000	224.96	224.96	224.96	0.00	224.96
562	SMAPW	US	SPORTSMAP TECH ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.4710	1.0000	264.70	264.70	264.70	0.00	264.70
523	SNII/WS	US	SUPERNOVA PARTNERS ACQ -CW27	USD	562.23	562.23	2.4200	1.0000	1,265.66	1,265.66	703.43	0.00	703.43
750	SNRHW	US	SENIOR CONNECT ACQ A -CW27	USD	228.75	228.75	0.5725	1.0000	429.38	429.38	200.63	0.00	200.63
439	SPAQ/WS	US	SPARTAN ACQ III CL A -CW26	USD	0.00	0.00	1.4200	1.0000	623.38	623.38	623.38	0.00	623.38
150	SPGS/WS	US	SIMON PROPERTY GROUP -CW26	USD	0.00	0.00	0.8500	1.0000	127.50	127.50	127.50	0.00	127.50
340	SPKBW	US	SILVER SPIKE ACQ -A CW26	USD	0.00	0.00	0.9364	1.0000	318.38	318.38	318.38	0.00	318.38
448	SPKC-WU	CN	SILVER SPIKE III ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.6600	1.0000	295.68	295.68	295.68	0.00	295.68
525	SPRIW	NA	SPRIW	EUR	10.50	12.02	0.5500	1.1325	288.75	327.01	315.12	-0.13	314.99
337	SPTKW	US	SPORTSTEK ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	198.83	198.83	198.83	0.00	198.83
499	SSAAW	US	SCIENCE STRATEGIC A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5500	1.0000	274.45	274.45	274.45	0.00	274.45
408	SSI/WS	US	SIGNA SPORTS UNITED BV-RRNT	USD	306.00	306.00	0.8300	1.0000	338.64	338.64	32.64	0.00	32.64
446	STRE/WS	US	SUPERNOVA PARTNERS -A -CW27	USD	0.00	0.00	0.8800	1.0000	392.48	392.48	392.48	0.00	392.48
450	SVFAW	US	SVF INVESTMENT CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.3000	1.0000	585.00	585.00	585.00	0.00	585.00
602	SWAGW	US	SOFTWARE ACQ GROUP III -CW27	USD	0.00	0.00	0.5400	1.0000	325.08	325.08	325.08	0.00	325.08
712	SWETW	US	ATHLON ACQUISITION WTS-CW26	USD	0.00	0.00	0.5850	1.0000	416.52	416.52	416.52	0.00	416.52
300	SWSSW	US	SPRINGWATER SPECIAL SIT-CW26	USD	0.00	0.00	0.5200	1.0000	156.00	156.00	156.00	0.00	156.00
829	TACA/WS	US	TREPOINT ACQUISITION COR-CW26	USD	0.00	0.00	0.5848	1.0000	484.80	484.80	484.80	0.00	484.80
450	TBCPW	US	THUNDER BRIDGE CAP A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8302	1.0000	373.59	373.59	373.59	0.00	373.59

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
498	TBSAW	US	TB SA ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	298.80	298.80	298.80	0.00	298.80
290	TCACW	US	TUATARA CAP ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5900	1.0000	176.41	176.41	176.41	0.00	176.41
750	TEKKW	US	TEKKORP DIGITAL ACQUI -CW27	USD	0.00	0.00	0.6680	1.0000	501.00	501.00	501.00	0.00	501.00
498	TETCW	US	TECH AND ENERGY TRANSI -CW27	USD	0.00	0.00	0.7299	1.0000	363.49	363.49	363.49	0.00	363.49
793	TGVCW	US	TG VENTURE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.4201	1.0000	333.14	333.14	333.14	0.00	333.14
375	THACW	US	THRIVE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.4300	1.0000	161.25	161.25	161.25	0.00	161.25
294	THCPW	US	THUNDER BRIDGE CAPITAL-CW	USD	0.00	0.00	0.8900	1.0000	261.66	261.66	261.66	0.00	261.66
375	TINV/WS	US	TIGA ACQUISITION CORP-CW26	USD	0.00	0.00	0.7000	1.0000	282.50	282.50	282.50	0.00	282.50
868	TIOAW	US	TIO TECH A -CW28	USD	0.00	0.00	0.9090	1.0000	789.01	789.01	789.01	0.00	789.01
273	TLGA/WS	US	TLG ACQUISITION ONE A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5353	1.0000	124.72	124.72	124.72	0.00	124.72
635	TMAC/WS	US	MUSIC ACQUISITION CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5599	1.0000	377.93	377.93	377.93	0.00	377.93
964	TMCWW	US	SUSTAINABLE OPPORTUNIT-CW25I	USD	1,677.36	1,677.36	0.2800	1.0000	269.92	269.92	-1,407.44	0.00	-1,407.44
750	TMKRW	US	TASTEMAKER ACQ CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.5075	1.0000	380.62	380.62	380.62	0.00	380.62
398	TRCA/WS	US	TWIN RIDGE CAPITAL ACQ -CW28	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	238.80	238.80	238.80	0.00	238.80
1,438	TREB/WS	US	TREBIA ACQUISITION -CW	USD	2,006.01	2,006.01	1.2700	1.0000	1,826.26	1,826.26	-179.75	0.00	-179.75
189	TRISAR	US	TRISAR ACQ I CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5507	1.0000	104.08	104.08	104.08	0.00	104.08
350	TRONW	US	CORNER GROWTH ACQUISITI-CW23	USD	0.00	0.00	0.8800	1.0000	308.00	308.00	308.00	0.00	308.00
375	TRLT/WS	US	TORTOISECOFIN ACQUISIT-CW	USD	0.00	0.00	0.9100	1.0000	341.25	341.25	341.25	0.00	341.25
179	TSIBW	US	TISHMAN SPEYER IN CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.7711	1.0000	138.03	138.03	138.03	0.00	138.03
398	TSPQ/WS	US	TOW SPECIAL PURPOSE AC -CW28	USD	0.00	0.00	0.6270	1.0000	249.55	249.55	249.55	0.00	249.55
750	TVACW	US	THAYER VENTURES ACQ -CW30	USD	0.00	0.00	0.9400	1.0000	704.96	704.96	704.96	0.00	704.96
562	TWCBW	US	BILANDER ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9198	1.0000	516.93	516.93	516.93	0.00	516.93
300	TWLWV	US	TWELVE SEAS INV II A -CW28	USD	0.00	0.00	0.5488	1.0000	164.04	164.04	164.04	0.00	164.04
750	TWND/WS	US	TAILWIND ACQUISITION -CW27	USD	517.50	517.50	0.5499	1.0000	412.43	412.43	-105.07	0.00	-105.07
650	TWNI/WS	US	TAILWIND INTERNATIONAL -CW28	USD	0.00	0.00	0.5850	1.0000	380.25	380.25	380.25	0.00	380.25
733	TWNT/WS	US	TAILWIND TWO ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.8673	1.0000	635.73	635.73	635.73	0.00	635.73
499	TZPSW	US	TZP STRATEGIES -CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.5099	1.0000	254.44	254.44	254.44	0.00	254.44
200	VCXAW	US	10X CAPITAL VENTURE AC -CW27	USD	0.00	0.00	2.0000	1.0000	400.00	400.00	400.00	0.00	400.00
202	VELOW	US	VELOCITY ACQUISITION-CW27	USD	0.00	0.00	0.5000	1.0000	101.00	101.00	101.00	0.00	101.00
299	VGLI/WS	US	VIRGIN GROUP ACQ C A -CW26	USD	0.00	0.00	0.8300	1.0000	248.17	248.17	248.17	0.00	248.17
455	VIIAW	US	7GC & CO HOLDINGS CL A -CW26	USD	0.00	0.00	0.6301	1.0000	286.70	286.70	286.70	0.00	286.70
100	VLATW	US	VALOR LATITUDE ACQ A -CW28	USD	0.00	0.00	0.6100	1.0000	61.00	61.00	61.00	0.00	61.00
374	VPCBW	US	VPC IMPACT ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	374.00	374.00	374.00	0.00	374.00
374	VPCW/WS	US	VPC IMPACT ACQ HOLD A -CW27	USD	0.00	0.00	1.0650	1.0000	398.31	398.31	398.31	0.00	398.31
300	VTIQW	US	VECTOIQ ACQUISITION CO-CW23	USD	0.00	0.00	0.8400	1.0000	252.00	252.00	252.00	0.00	252.00
960	VWE-WU	CN	BESPOKE CAPITAL ACQUI -CW24	USD	1,152.00	1,152.00	2.2000	1.0000	2,112.00	2,112.00	960.00	0.00	960.00
1,200	VYGG/WS	US	VY GLOBAL GROWTH-CL A -CW30	USD	0.00	0.00	1.1500	1.0000	1,380.00	1,380.00	1,380.00	0.00	1,380.00
399	WALDW	US	WALDENCAST ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	1.1900	1.0000	474.81	474.81	474.81	0.00	474.81
300	WARR/WS	US	WARRIOR TECHNOLOGIES A -CW28	USD	0.00	0.00	0.4994	1.0000	149.82	149.82	149.82	0.00	149.82
435	WINVW	US	WINVEST ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.2000	1.0000	87.00	87.00	87.00	0.00	87.00
145	WPCB/WS	US	WARBURG PINCUS CAP A -CW27	USD	0.00	0.00	0.9900	1.0000	143.55	143.55	143.55	0.00	143.55
298	WPCB/WS	US	WARBURG PINCUS CAPITAL-CW	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	298.00	298.00	298.00	0.00	298.00
750	WQCA/WS	US	WORLD QUANTUM GROWTH -CW28	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	435.00	435.00	435.00	0.00	435.00
630	WRAC/WS	US	WILLIAMS ROWLAND ACQ -CW22	USD	0.00	0.00	0.5100	1.0000	321.30	321.30	321.30	0.00	321.30
750	XFINW	US	EXCELFIN ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.5800	1.0000	435.00	435.00	435.00	0.00	435.00
1,195	XOSWW	US	NEXTGEN ACQUISITION -CW26	USD	0.00	0.00	0.3850	1.0000	460.08	460.08	460.08	0.00	460.08
799	XPOA/WS	US	DPCM CAPITAL INC -A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6200	1.0000	495.38	495.38	495.38	0.00	495.38
299	YSACW	US	YELLOWSTONE ACQUISIT A -CW25	USD	0.00	0.00	0.8801	1.0000	263.15	263.15	263.15	0.00	263.15
1,693	ZGN/WS	US	EMENEGILDO ZEGNA HOLD -CW27	USD	0.00	0.00	2.0800	1.0000	3,521.44	3,521.44	3,521.44	0.00	3,521.44
375	ZNTEW	US	ZANITE ACQ CL A -CW25	USD	0.00	0.00	0.8802	1.0000	330.08	330.08	330.08	0.00	330.08
300	ZWRKW	US	Z-WORK ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.6493	1.0000	194.79	194.79	194.79	0.00	194.79
Subtotal - EQUITY WRT						33,850.44				174,455.87	140,681.40	-75.97	140,605.43

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
RIGHT													
	375	CLAQR US	CLEANTECH ACQUISITION CO-RTS	USD	0.00	0.00	0.3814	1.0000	143.03	143.03	143.03	0.00	143.03
	750	ENERR US	ACCRETION ACQUISITION COR-RT	USD	0.00	0.00	0.3200	1.0000	240.00	240.00	240.00	0.00	240.00
	435	WINVR US	WINVEST ACQUISITION CORP-RTS	USD	0.00	0.00	0.2894	1.0000	125.89	125.89	125.89	0.00	125.89
			Subtotal - RIGHT			0.00				508.92	508.92	0.00	508.92
			Subtotal - Option			34,297.81				175,080.79	140,858.95	-75.97	140,782.98
Swap													
EQUITY SWAP													
	637	ESW_AAC FP	ESW_ACCOR ACQUISITION CO SA	EUR	0.00	0.00	9.8290	1.1325	5.73	6.49	6.49	0.00	6.49
	637	ESW_AACW FP	ESW_ACCOR ACQUISITION CO SA	EUR	0.00	0.00	0.4000	1.1325	143.32	162.31	162.31	0.00	162.31
	1,653	ESW_APT AU	AFTERPAY TOUCH GROUP LTD SWAP	AUD	0.00	0.00	84.6058	0.7256	-783.85	-568.76	-568.76	0.00	-568.76
	74,095	ESW_AVST LN_USD	ESW_AVAST PLC	USD	0.00	0.00	8.2182	1.0000	-2,549.67	-2,141.99	-2,549.67	407.68	-2,141.99
	6,544	ESW_BIO3 GR	ESW_BIOTEST AG	EUR	0.00	0.00	38.6000	1.1325	1,963.20	2,223.33	2,223.33	0.00	2,223.33
	1,751	ESW_BMG1624R1079	ESW_BROOKFIELD PROP PPD LP 6.250% 07/26/81	USD	0.00	0.00	25.7400	1.0000	1,498.35	1,498.35	1,498.35	0.00	1,498.35
	-2,116	ESW_BP US	ESW_BP PLC	USD	0.00	0.00	26.6900	1.0000	-577.08	-577.08	-577.08	0.00	-577.08
	3,689	ESW_BPMP US	ESW_BP MIDSTREAM PARTNERS LP	USD	0.00	0.00	15.3100	1.0000	9,046.47	9,046.47	9,046.47	0.00	9,046.47
	33,462	ESW_CNP FP	ESW_CNP ASSURANCES	EUR	0.00	0.00	21.7500	1.1325	3,183.03	3,604.78	3,604.78	0.00	3,604.78
	382,739	ESW_EUCAR FP	ESW_EUROPCAR GROUPE SA	EUR	0.00	0.00	0.5076	1.1325	-870.57	-985.93	-985.93	0.00	-985.93
	-10,603	ESW_GRF SM_USD	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	19.1109	1.0000	-1,260.84	-834.09	-1,260.84	426.75	-834.09
	14,898	ESW_GRP5 US	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	11.3800	1.0000	297.96	297.96	297.96	0.00	297.96
	2,869	ESW_HLEO GR	ESW_HELLA GMBH & CO KGAA	EUR	0.00	0.00	59.6000	1.1325	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	164,798	ESW_MGGT LN	ESW_MEGGITT PLC	GBP	0.00	0.00	7.4000	1.3499	-230.76	-311.50	-311.50	0.00	-311.50
	-2,239	ESW_NLOK US	ESW_NORTONLIFELOCK INC	USD	0.00	0.00	26.2000	1.0000	-156.73	-156.73	-156.73	0.00	-156.73
	13,580	ESW_PRSM LN	ESW_BLUE PRISM GROUP PLC	GBP	0.00	0.00	12.6400	1.3499	221.56	299.09	299.09	0.00	299.09
	-10,695	ESW_RYA ID_USD	ESW_RYANAIR HOLDINGS PLC	USD	0.00	0.00	17.5538	1.0000	-391.10	-391.10	-787.28	396.18	-391.10
	72,238	ESW_SEV FP	ESW_SUEZ	EUR	0.00	0.00	19.8300	1.1325	722.38	818.09	818.09	0.00	818.09
	47,369	ESW_SNN LN	ESW_SANNE GROUP PLC	GBP	0.00	0.00	9.1100	1.3499	426.98	576.40	576.40	0.00	576.40
	-1,845	ESW_SPY US	ESW_SPDR S&P 500 ETF TRUST	USD	0.00	0.00	476.1600	1.0000	-47,342.70	-47,342.70	-47,342.70	0.00	-47,342.70
	-615	ESW_SQ US_AUD	ESW_SQUARE INC	AUD	0.00	0.00	227.8666	0.7256	-2,844.50	-2,063.97	-2,063.97	0.00	-2,063.97
	127,031	ESW_SYD AU	ESW_SYDNEY AIRPORT	AUD	0.00	0.00	8.6900	0.7256	-10.26	-7.45	-7.45	0.00	-7.45
	1,775	ESW_ULE LN	ESW_ULTRA ELECTRONICS HOLDINGS PLC	GBP	0.00	0.00	31.7200	1.3499	248.50	335.45	335.45	0.00	335.45
	24,388	ESW_UNO1 GR	ESW_UNIPER SE	EUR	0.00	0.00	41.8000	1.1325	-7,560.28	-8,562.02	-8,562.02	0.00	-8,562.02
	691	ESW_WAF GR	ESW_SILTRONIC AG	EUR	0.00	0.00	141.4500	1.1325	760.10	860.82	860.82	0.00	860.82
	60,956	ESW_ZOT SM	ESW_ZARDOYA OTIS SA	EUR	0.00	0.00	7.1100	1.1325	3,177.85	3,598.90	3,598.90	0.00	3,598.90
			Subtotal - EQUITY SWAP			0.00				-40,624.88	-41,855.49	1,230.61	-40,624.88
			Subtotal - Swap			0.00				-40,624.88	-41,855.49	1,230.61	-40,624.88
			Report Totals:			67,406,872.91				66,630,435.14	-711,441.96	-63,995.81	-775,437.77

中小型株式 マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2022年6月29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2008年9月22日から無期限です。
運用方針	わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要運用対象	わが国の中小型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1万口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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数1		参考指数2		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	円	期中騰落率%		期中騰落率%		期中騰落率%			
第10期(2018年6月29日)	42,749	27.1	1,730.89	6.6	22,378	10.1	96.0	—	百万円 31,661
第11期(2019年7月1日)	37,007	△13.4	1,584.85	△8.4	20,210	△9.7	94.8	—	40,226
第12期(2020年6月29日)	42,753	15.5	1,549.22	△2.2	20,056	△0.8	95.6	—	38,070
第13期(2021年6月29日)	54,048	26.4	1,949.48	25.8	25,102	25.2	96.9	—	32,634
第14期(2022年6月29日)	47,268	△12.5	1,893.57	△2.9	24,702	△1.6	94.8	—	29,267

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指数1		参考指数2		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率%		騰落率%		騰落率%		
(当期首) 2021年 6月29日	54,048	—	1,949.48	—	25,102	—	96.9	—
6月末	54,457	0.8	1,943.57	△0.3	25,048	△0.2	96.2	—
7月末	52,309	△3.2	1,901.08	△2.5	24,504	△2.4	94.8	—
8月末	54,168	0.2	1,960.70	0.6	25,280	0.7	94.6	—
9月末	56,689	4.9	2,030.16	4.1	26,248	4.6	93.6	—
10月末	56,635	4.8	2,001.18	2.7	25,839	2.9	94.9	—
11月末	54,668	1.1	1,928.35	△1.1	24,507	△2.4	93.7	—
12月末	55,133	2.0	1,992.33	2.2	25,235	0.5	94.2	—
2022年 1月末	46,924	△13.2	1,895.93	△2.7	23,938	△4.6	92.0	—
2月末	47,541	△12.0	1,886.93	△3.2	24,208	△3.6	96.7	—
3月末	50,037	△7.4	1,946.40	△0.2	24,890	△0.8	95.5	—
4月末	47,620	△11.9	1,899.62	△2.6	24,331	△3.1	95.0	—
5月末	48,014	△11.2	1,912.67	△1.9	24,545	△2.2	94.9	—
(当期末) 2022年 6月29日	47,268	△12.5	1,893.57	△2.9	24,702	△1.6	94.8	—

(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」で算出しております。

参考指数1は、TOPIX(東証株価指数)です。

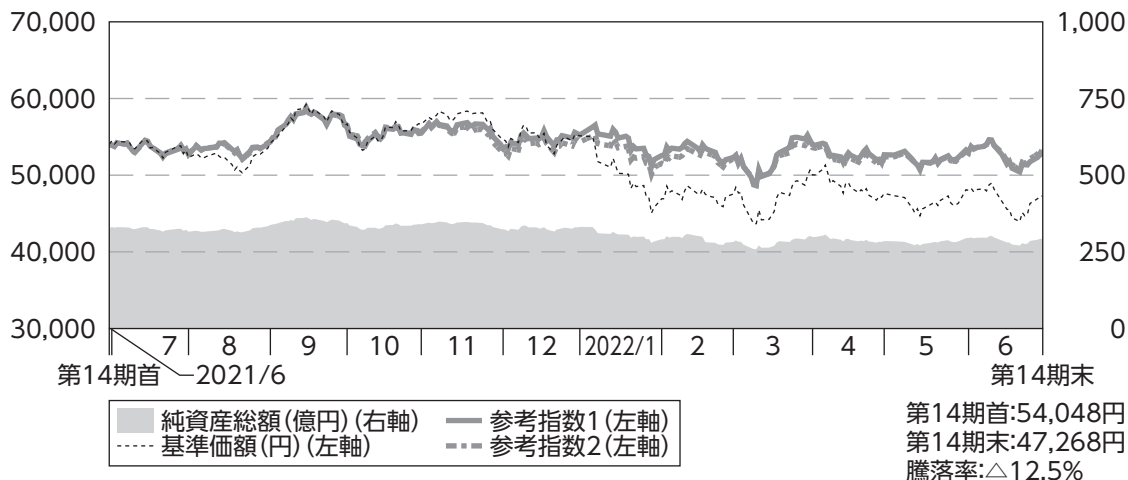
「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及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。

参考指数2は、ラッセル野村中小型インデックス(配当込み)です。

ラッセル野村中小型インデックスの知的財産権及びその他一切の権利は野村證券株式会社及びFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村證券株式会社及びFrank Russell Companyは、ラッセル野村中小型インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性及び適合性を保証するものではなく、ラッセル野村中小型インデックスを用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して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



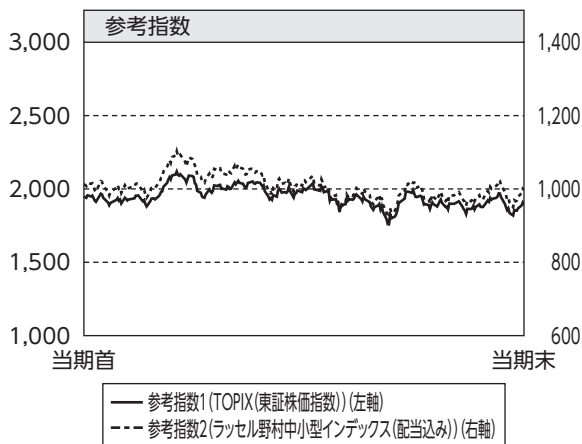
(注)参考指数は、2021年6月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期末の基準価額は、前期末比で下落しました。

企業業績は総じて堅調に推移しましたが、米金利上昇により株価バリュエーション(割高・割安を評価する指標)には下押し圧力が働き、当ファンドが主な投資対象とする中小型成長株にはネガティブに影響しました。PER(株価収益率)などの株価バリュエーションが高い銘柄ほど下押し圧力が強くなることから、保有銘柄ではオイシックス・ラ・大地やサイバーエージェントなどがマイナスに影響しました。一方で、株価バリュエーションが低くて業績が好調な銘柄がプラスに寄与しました。具体的には、ハイブリッド車や電気自動車向けにセラミック部品の販売が伸びているMARUWAや企業の積極的なネットワーク投資を背景に業績が拡大しているインターネットイニシアティブなどです。

投資環境



当期はTOPIX(東証株価指数)もラッセル野村中小型インデックス(配当込み)も概ね類似した動きとなりました。2021年8月から9月にかけて首相の予想外の退陣表明を受けて株価が急上昇する局面がありましたが、期待された新政権の景気対策は目新しさに欠けたことから一時的な動きとなりました。

その後は米国において景気や雇用情勢が改善してきたものの、供給網の混乱や人手不足を背景に物価が上昇し始めたことから、FRB(米連邦準備理事会)は金融政策を転換して正常化に舵を切りました。米金融政策の想定外の変更を受けて2022年初から大きく下落しました。

FRBが金融政策を変更した一方で、日銀は金融緩和政策を維持したことから、日米金利差が拡大して円安が進行しました。輸出関連銘柄を中心に円安が業績にプラスに働くことから、株式市場は落ち着きを取り戻し、底堅く推移して期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

中長期的に高い利益成長が期待できる銘柄に投資しました。

米金融政策の転換やウクライナ情勢、中国での新型コロナウイルスの感染拡大など事業環境に不透明感が増してきたことから、外部環境に左右されず自助努力で利益成長が期待できる銘柄を購入しました。具体的には、差別化製品の販売が好調なデクセリアルズや自社配給作品が大ヒットした東宝、美容室向けヘアケア製品の海外販売を強化し始めたミルボンなどを購入しました。一方で、子会社において不適切な会計処理が発覚したアウトソーシングや半導体関連製品の販売に陰りが見え始めたイビデンなどを売却しました。また、米金利上昇を受けて、SHIFTなど好業績が期待されるものの株価バリュエーションが高い一部の銘柄についても売却しました。

当ファンドの組入資産の内容

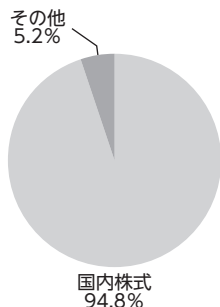
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	富士電機	日本	3.3%
2	MARUWA	日本	3.3%
3	インターネットイニシアティブ	日本	3.2%
4	デクセリアルズ	日本	2.8%
5	物語コーポレーション	日本	2.6%
6	東宝	日本	2.5%

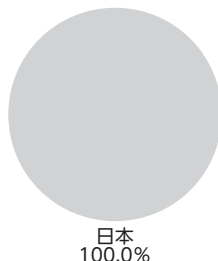
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ダイセキ	日本	2.5%
8	ジャパンマテリアル	日本	2.3%
9	エスプール	日本	2.3%
10	ネクソン	日本	2.2%
組入銘柄数			71

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

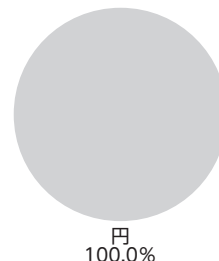
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

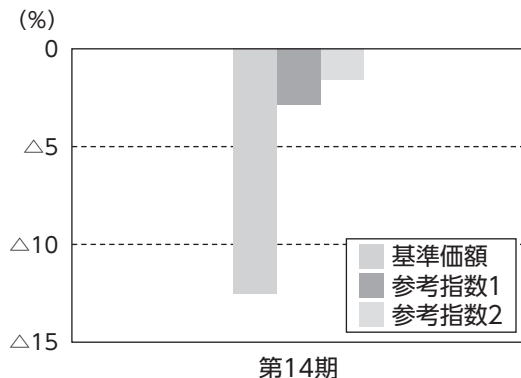


(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

主として、わが国の取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。

市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月30日~2022年6月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	40円 (40) (-) (-) (-) (-) (-) (-)	0.076% (0.076) (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	40	0.076	

(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(52,016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
国内	上 場	千株 7,676 (412)	千円 21,829,137 (-)	千株 8,158	千円 21,391,509

(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。

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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	43,220,647千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	29,784,839千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	1.45

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 394,052	百万円 11,005	% 2.8	百万円 394,183	百万円 10,822	% 2.7

(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

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
建設業(1.5%)			
五洋建設	200	—	—
日揮ホールディングス	—	233	421,963
食料品(1.7%)			
寿スピリッツ	78	63	473,130
繊維製品(1.6%)			
セーレン	125	220	447,480
化学(10.3%)			
KHネオケム	190	165	409,200
恵和	—	75	286,875
トリケミカル研究所	90	200	452,800
ミルボン	—	65	309,400
デクセリアルズ	—	218.8	830,346
ニフコ	180	180	569,700
医薬品(2.8%)			
ロート製薬	—	92	363,400
JCRファーマ	40	180	412,560
ペプチドリーム	110	—	—
ステムリム	190	—	—
ガラス・土石製品(3.4%)			
MARUWA	78.5	60	957,600
金属製品(2.2%)			
横河ブリッジホールディングス	—	150	294,600
三益半導体工業	200	145	312,910
機械(2.5%)			
日本製鋼所	—	70	214,550
芝浦機械	—	90	243,450
ヒラノテクシード	98	13	22,165
技研製作所	69	70	218,050
IHI	60	—	—
スター精密	310	—	—
電気機器(8.9%)			
イビデン	170	85	334,475
富士電機	200	166	957,820
大泉製作所	160	—	—
ローランド ディー. ジー.	—	95	313,975
マクセル	—	200	269,000
スタンレー電気	128	—	—
日本セラミック	180	178	368,282
大真空	—	230	214,590

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
精密機器(3.5%)			
ナカニシ	—	105	254,100
インターアクション	200	210	414,330
メニコン	70	95	296,400
その他製品(4.3%)			
ブシロード	—	95	140,695
スノーピーク	—	115	306,935
前田工織	—	95	273,125
SHOEI	139	87	465,450
電気・ガス業(—%)			
レノバ	110	—	—
倉庫・運輸関連業(1.0%)			
トランコム	44.1	42	285,600
情報・通信業(20.2%)			
手間いらず	—	90	482,400
ネクソン	—	220	645,700
エニグモ	170	—	—
FFRIセキュリティ	50	—	—
SHIFT	30	—	—
GMOペイメントゲートウェイ	10	18	172,800
インターネットイニシアティブ	270	190	931,950
カナミックネットワーク	260	170	97,240
ユーザベース	71	—	—
ニューラルポケット	45	—	—
ヤブリ	26	130	287,170
Kaizen Platform	100	—	—
ビジョナル	—	60	369,000
シンプレクス・ホールディングス	—	65	116,155
J TOWER	45	10	65,400
ビザスク	78.5	77	167,860
サイバーセキュリティクラウド	55	—	—
ウェザーニューズ	67	45	289,350
ビジョン	—	190	251,560
KADOKAWA	110	165	492,030
東宝	60	150	737,250
カブコン	—	150	498,000
卸売業(3.2%)			
神戸物産	95	185	604,950
アズワン	30	50	276,000
阪和興業	143	—	—

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
PAL TAC	86	—	—
パリュエンスホールディングス	53.5	—	—
小売業(7.7%)			
サンエー	90	95	392,350
物語コーポレーション	75	125	751,250
シュッピン	440	360	529,560
オイシックス・ラ・大地	130	—	—
ネクステージ	—	200	475,800
ほぼ日	10.7	—	—
良品計画	320	—	—
ワークマン	55	—	—
証券、商品先物取引業(0.6%)			
ウェルスナビ	—	100	176,800
保険業(1.1%)			
アニコム ホールディングス	385	450	294,750
その他金融業(1.8%)			
アルヒ	105	—	—
イー・ギランティ	200	230	491,510
不動産業(2.0%)			
スター・マイカ・ホールディングス	230	202	352,288
SREホールディングス	75	95	212,420
サービス業(19.7%)			
日本M&Aセンターホールディングス	100	165	233,475
エス・エム・エス	—	140	374,360
アイ・ケイ・ケイホールディングス	78	—	—
カカクコム	140	—	—
エムスリー	54	—	—
アウトソーシング	470	—	—
エスプール	640	590	673,780
手間いらず	95	—	—
サイバーエージェント	320	350	482,650

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
弁護士ドットコム	—	62	243,040
アイ・アールジャパンホールディングス	35	—	—
Keeper 技研	—	170	601,800
ジャパンマテリアル	315	345	684,825
エラン	195	235	248,865
ベルシステム24ホールディングス	194	—	—
アトラエ	—	112	197,456
インソース	240	220	506,660
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	220	180	253,980
LITALICO	109	105	232,260
ダイセキ	228	170	729,300
合 計	株 数 ・ 金 額	10,823	27,758,950
	銘柄数<比率>	74	<94.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 27,758,950	% 94.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,551,195	5.3
投 資 信 託 財 産 総 額	29,310,145	100.0

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 2022年6月29日現在
(A)資 産	29,310,145,177円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,431,055,024
株 式(評価額)	27,758,950,000
未 収 入 金	59,689,653
未 収 配 当 金	60,450,500
(B)負 債	42,786,650
未 払 金	42,784,657
未 払 利 息	1,993
(C)純 資 産 総 額(A-B)	29,267,358,527
元 本	6,191,809,864
次 期 繰 越 損 益 金	23,075,548,663
(D)受 益 権 総 口 数	6,191,809,864口
1万口当たり基準価額(C/D)	47,268円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月30日 至 2022年6月29日
(A)配 当 等 収 益	339,155,371円
受 取 配 当 金	339,858,700
受 取 利 息	9,647
そ の 他 収 益 金	4,500
支 払 利 息	△717,476
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,295,815,983
売 買 益	3,422,309,800
売 買 損	△7,718,125,783
(C)当 期 損 益 金(A+B)	△3,956,660,612
(D)前 期 繰 越 損 益 金	26,596,139,126
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	4,748,585,322
(F)解 約 差 損 益 金	△4,312,515,173
(G)計 (C+D+E+F)	23,075,548,663
次 期 繰 越 損 益 金(G)	23,075,548,663

(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)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) (F)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6,038,012,524円、期中追加設定元本額は1,181,172,448円、期中一部解約元本額は1,027,375,108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。

国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	3,016,312,358円
中小型株式オープン	2,960,863,773円
中小型株式オープン(SMA専用)	161,484,356円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	53,149,377円

お知らせ

株式会社東京証券取引所による株価指数の見直しにより参考指数の変更を行いました。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30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2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所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1万口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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	98.3	497,213

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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		株式先物率 株式先物率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2021年 5月31日	18,550	—	1,922.98	—	1.5
6月末	18,770	1.2	1,943.57	1.1	0.9
7月末	18,361	△1.0	1,901.08	△1.1	0.8
8月末	18,942	2.1	1,960.70	2.0	0.7
9月末	19,766	6.6	2,030.16	5.6	1.4
10月末	19,486	5.0	2,001.18	4.1	1.4
11月末	18,779	1.2	1,928.35	0.3	1.3
12月末	19,433	4.8	1,992.33	3.6	1.1
2022年 1月末	18,495	△0.3	1,895.93	△1.4	0.8
2月末	18,414	△0.7	1,886.93	△1.9	0.6
3月末	19,205	3.5	1,946.40	1.2	1.6
4月末	18,745	1.1	1,899.62	△1.2	1.8
(当期末) 2022年 5月30日	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

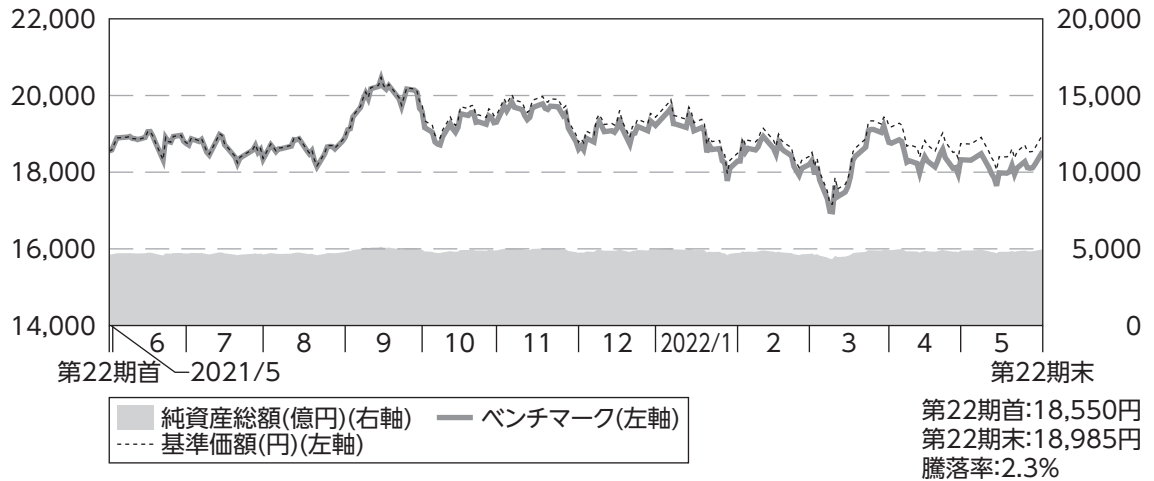
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及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。

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、2021年5月31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TOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首と比べて上昇しました。

投資環境



国内株式市場は下落しました。

期初は、堅調な米国株式市場が下支えとなった一方で、国内での新型コロナウイルス新規感染拡大に歯止めがかからず、緊急事態宣言が発出されたことなどから上値の重い展開となりました。9月に入ると、新政権による国内経済対策への期待感から大幅に上昇した後、中国大手不動産開発会社の債務問題やインフレ懸念の高まりなどから下落しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米国の金融引き締めへの警戒感、ウクライナを巡る地政学リスクが高まった一方で、円安・米ドル高の進行による輸出関連企業の業績改善が期待されたこと、米国のインフレ加速への警戒感が後退したことなどを受けて、国内株式市場はやや値を戻しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

- (1) 株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。
- (2) TOPIX構成銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

当ファンドの組入資産の内容

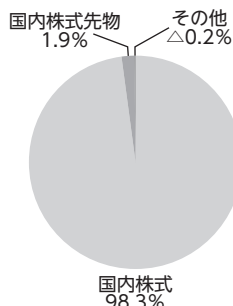
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.9%
2	ソニーグループ	日本	2.9%
3	東証株価指数先物 2206	日本	1.9%
4	キーエンス	日本	1.8%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.7%
6	日本電信電話	日本	1.7%

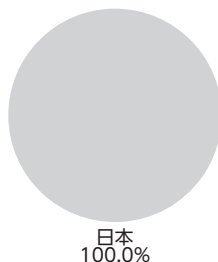
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	1.5%
8	リクルートホールディングス	日本	1.3%
9	任天堂	日本	1.3%
10	日立製作所	日本	1.3%
組入銘柄数			2,103

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

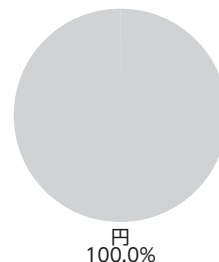
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

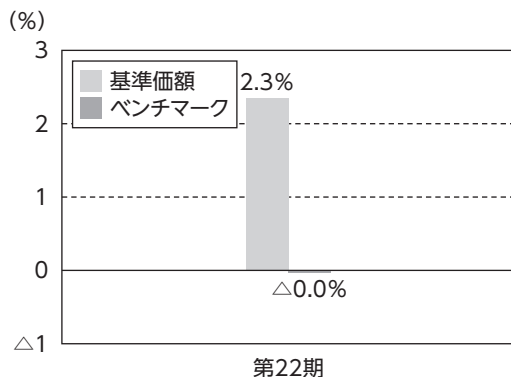


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%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、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)です。

今後の運用方針

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

(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(18,912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
国内	上 場	千株 29,302 (7,372)	千円 71,828,645 (-)	千株 16,256	千円 39,141,522

(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。

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 — (5,300)	千円 — (-)	証券 — (5,300)	千円 — (-)

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<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
国内	株式先物取引	百万円 59,969	百万円 56,982	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	110,970,168千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	475,292,667千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.23

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 809,836	百万円 20,042	% 2.5	百万円 811,443	百万円 19,690	% 2.4

(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	136百万円	106百万円	1,292百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	7.6	8.8	29,524
日本水産	217.9	250.3	131,407
マルハニチロ	36.7	36.9	83,430
雪国まいたけ	19.3	19.2	16,204
カネコ種苗	7.1	7.4	13,238
サカタのタネ	28	29.4	129,507
ホクト	19.7	20.7	39,764
ホクリヨウ	3.6	3.6	2,289
鉱業(0.4%)			
住石ホールディングス	41.1	46	9,660
日鉄鉱業	5.4	5.4	32,022
三井松島ホールディングス	9.8	11	33,275
I N P E X	862.8	944.2	1,492,780
石油資源開発	30.7	30.9	90,258
K&Oエナジーグループ	11.4	10.8	16,621
建設業(2.1%)			
ヒノキヤグループ	5.8	—	—
ショーボンドホールディングス	33.5	33	189,750
ミライト・ホールディングス	81.3	84.6	138,151
タマホーム	14.2	15.9	39,765
サンヨーホームズ	2.7	3	2,232
日本アクア	9.3	10.4	6,520
ファーストコーポレーション	7.2	6.4	4,736
ベストテラ	4.5	5.3	6,487
Robot Home	44	43.8	8,497
キャンディル	4	4.1	2,189
スペースバリューホールディングス	28.6	—	—
ダイセキ環境ソリューション	4.5	5.1	4,962
第一カッター興業	5.8	6	7,926
安藤・間	150.4	123.3	97,776
東急建設	68.7	72.7	43,256
コムシスホールディングス	83.2	84.7	208,023
ピーアールホールディングス	31.4	33.9	10,915
高松コンストラクショングループ	14.6	16	32,848
東建コーポレーション	7.2	7.3	64,605
ソネック	2.4	2.7	2,721
ヤマウラ	10.2	11.8	11,021
オリエンタル白石	78.9	88.3	20,838
大成建設	168.6	164.9	653,004
大林組	541.8	578	531,760

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
清水建設	507.5	536.9	367,776
飛鳥建設	15.5	16.2	16,459
長谷工コーポレーション	177.5	168.7	260,978
松井建設	21.3	21.4	14,402
銭高組	2.4	2.4	8,556
鹿島建設	397	423.5	590,359
不動テトラ	13.3	12.9	20,549
大末建設	6.8	6.4	10,195
鉄建建設	10.9	12.6	22,541
西松建設	38.8	36.7	153,039
三井住友建設	130.9	136.8	60,328
大豊建設	11.9	8.9	39,471
前田建設工業	135.7	—	—
佐田建設	12.5	13.1	6,288
ナカノフドー建設	13	14.5	4,611
奥村組	29.8	31.7	90,535
東鉄工業	23.2	25.3	55,204
イチケン	3.9	4.4	8,179
富士ビー・エス	7	7.8	4,001
浅沼組	6.5	6.8	35,768
戸田建設	225	239.1	162,109
熊谷組	25.1	30	80,400
北野建設	3.3	3.7	8,269
植木組	4.8	5.1	7,481
矢作建設工業	23.9	25	19,850
ピーエス三菱	17.8	20	12,060
日本ハウスホールディングス	37	41	17,630
大東建託	59.1	62.1	693,657
新日本建設	23	25.8	19,117
N I P P O	44.8	—	—
東亜道路工業	3.4	3.1	16,554
前田道路	33.5	—	—
日本道路	5.2	5.3	34,609
東亜建設工業	14.5	14	33,194
日本国土開発	52.7	51.2	26,316
若築建設	9.7	9.6	19,017
東洋建設	60.7	68	58,412
五洋建設	230.1	229.1	145,478
世紀東急工業	26	29.1	23,774
福田組	6.3	6.5	30,127
住友林業	127.4	140.4	278,132

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本基礎技術	16.5	15.4	8,978	
バコーポレーション	24.1	23.7	10,072	
大和ハウス工業	500.3	507	1,621,893	
ライト工業	31	34.5	57,787	
積水ハウス	587.6	603.3	1,393,321	
日特建設	14.1	12.5	9,650	
北陸電気工事	9.4	11.4	8,675	
ユアテック	31	34.7	24,255	
日本リーテック	11.3	11.9	12,709	
四電工	2.9	6.1	10,321	
中電工	24.9	25.6	53,248	
関電工	88.1	98.7	80,243	
きんでん	110	127.4	190,080	
東京エネシス	18	18.7	17,578	
トーエネック	5.4	6.1	19,520	
住友電設	15.3	15	35,115	
日本電設工業	29.7	28.3	45,053	
エクシオグループ	82.1	86.6	180,820	
新日本空調	14.3	14.1	25,563	
九電工	38	41.2	110,251	
三機工業	38.4	39.4	56,381	
日揮ホールディングス	180.7	176.6	315,584	
中外炉工業	5.9	5.8	9,784	
ヤマト	17.3	15.6	11,466	
太平電業	12	11.8	31,600	
高砂熱学工業	49	49.2	77,637	
三晃金属工業	2.1	2.4	6,700	
朝日工業社	4	7.6	11,985	
明星工業	35	32.7	24,067	
大気社	26.3	26.7	81,969	
ダイダン	12	12.1	24,405	
日比谷総合設備	17.4	17.5	32,970	
フィル・カンパニー	3.1	3.2	3,891	
テスホールディングス	9.9	16.9	23,254	
インフロア・ホールディングス	—	235.4	222,453	
東洋エンジニアリング	22.8	25.5	16,218	
レイズネクスト	29.1	27.1	31,246	
食料品(3.2%)				
ニッポン	50.7	50.5	81,002	
日清製粉グループ本社	195.9	195.1	297,137	
日東富士製粉	1.3	2.8	11,704	
昭和産業	14.6	16.3	39,869	
鳥越製粉	15.4	15.1	9,648	
中部飼料	21.2	20.7	21,072	
フィード・ワン	23.3	23.9	15,750	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東洋精糖	2.9	3.3	3,144	
日本甜菜製糖	9	10.1	17,069	
DM三井製糖ホールディングス	13.7	16.3	30,578	
塩水港精糖	20.7	23.1	4,943	
日新製糖	8.2	9.2	16,385	
森永製菓	40.7	41.2	162,946	
中村屋	4.2	4.2	12,936	
江崎グリコ	47.7	48	182,880	
名糖産業	7.6	7.5	11,880	
井村屋グループ	9.8	10	23,320	
不二家	11.1	10.8	26,103	
山崎製パン	130	127.9	193,512	
第一屋製パン	3.3	3.7	1,916	
モロゾフ	2.8	5.9	19,411	
亀田製菓	9.9	10.4	44,512	
寿スピリッツ	16.7	17.5	127,750	
カルビー	79	88.5	213,639	
森永乳業	32.1	33.9	157,974	
六甲バター	11.5	13.3	19,298	
ヤクルト本社	119.3	130.2	910,098	
明治ホールディングス	114.7	112.9	728,205	
雪印メグミルク	41.7	43.9	76,693	
プリマハム	24.4	24.3	51,831	
日本ハム	66.3	70.1	277,946	
林兼産業	5.7	5.9	2,967	
丸大食品	17.1	18	26,568	
S F o o d s	15.6	17.4	52,809	
柿安本店	6	6.7	16,260	
伊藤ハム米久ホールディングス	111.6	125	82,750	
サッポロホールディングス	59.2	60	168,060	
アサヒグループホールディングス	378.8	416.3	1,813,819	
キリンホールディングス	735.4	713.8	1,424,744	
宝ホールディングス	128.5	116	111,128	
オエノンホールディングス	49.3	52.5	15,592	
養命酒製造	5.3	5.5	9,537	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	132.8	128.1	179,596	
サントリー食品インターナショナル	116	129.9	633,262	
ダイドーグループホールディングス	9.8	10	49,000	
伊藤園	52.6	59	323,320	
キーコーヒー	17	18.2	37,692	
ユニカフェ	5.2	5.8	5,469	
ジャパンフーズ	2.5	2.8	3,298	
日清オイリオグループ	22.2	23	69,460	
不二製油グループ本社	42.3	42.1	74,938	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
かどや製油	1.9	1.8	6,120
Jーオイルミルズ	16.2	18.1	27,837
キッコーマン	124.8	124.3	856,427
味の素	412.4	397.9	1,254,180
ブルドックソース	7.9	7.3	13,183
キュービー	96.5	90.7	195,549
ハウス食品グループ本社	64.8	64.6	175,776
カゴメ	70.9	73.7	245,789
焼津水産化学工業	8.4	8.4	7,921
アリアケジャパン	15.8	17.7	86,287
ビエトロ	2.3	2.5	4,500
エバラ食品工業	3.8	4.2	12,747
やまみ	1.9	1.7	2,701
ニチレイ	82.6	77.8	177,150
東洋水産	89.2	88.8	426,240
イートアンドホールディングス	6	7.3	16,979
大冷	1.9	2.2	4,180
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9.7	10	5,470
日清食品ホールディングス	68	66.8	565,796
永谷園ホールディングス	8.5	8.6	17,621
一正蒲鉾	6.7	7.8	6,427
フジッコ	18.8	18.1	34,752
ロック・フィールド	18.7	19.8	27,937
日本たばこ産業	929.7	1,041.3	2,457,468
ケンコーマヨネーズ	10.6	10.2	13,800
わらべや日洋ホールディングス	11.3	12	19,836
なとり	9.7	10.8	22,140
イフジ産業	2.7	3.4	3,423
ビックスコーポレーション	4.1	9.3	12,657
ファーマフーズ	16.4	24.5	39,322
北の達人コーポレーション	60.5	—	—
ユウグレナ	88.3	99.8	86,526
紀文食品	10.1	15.1	14,994
ミヨシ油脂	6.1	7	7,252
理研ビタミン	16.4	17.7	29,151
繊維製品(0.4%)			
片倉工業	23	18.6	39,134
グンゼ	12.5	11.5	42,147
東洋紡	67.2	75.4	78,114
ユニチカ	50.9	54.1	13,038
富士紡ホールディングス	8.3	8.1	27,499
倉敷紡績	15.9	14.8	28,401
シキボウ	9.5	9.9	8,959
日本毛織	56.2	50.8	47,498
トーア紡コーポレーション	6.7	7	2,681

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
帝国繊維	19.3	20.6	30,405
帝人	159.5	170.8	230,409
東レ	1,225.8	1,242.3	833,831
サカイオーベックス	4.6	—	—
住江織物	3.7	3.4	5,895
日本フェルト	10.7	11.9	5,140
イチカワ	2.6	2.7	3,720
日東製網	1.8	2	2,754
アツギ	13.3	14.3	7,607
ダイニック	6.4	6.5	4,537
セーレン	41.8	36.5	74,715
ソトー	7	7.2	6,307
東海染工	2.3	2.4	2,822
小松マテーレ	28	29.5	40,120
ワコールホールディングス	42.3	42.1	85,673
ホギメディカル	22.9	24.3	75,330
T S I ホールディングス	52.1	60.1	19,833
マツオカコーポレーション	5.5	5.9	5,941
ワールド	22.3	24.9	35,905
三陽商会	8.8	8.6	7,748
ナイガイ	6.8	7.1	2,172
オンワードホールディングス	102.4	108.4	28,292
ルックホールディングス	5.9	6.2	10,223
ゴールドウイン	28	32.3	254,201
デサント	29	34	83,164
キング	9.4	9.3	5,022
ヤマトインターナショナル	15.5	15.7	4,474
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	10.4	10.4	33,176
王子ホールディングス	761.7	751.6	426,908
日本製紙	74.8	81.5	77,914
三菱製紙	24	25.1	7,555
北越コーポレーション	121	116.7	70,953
中越パルプ工業	6.4	7.2	6,595
巴川製紙所	5.6	5.6	3,550
大王製紙	81.6	84.6	119,962
阿波製紙	4.4	4.5	1,426
レンゴー	174.5	157.4	110,967
トーモク	10.4	10.1	14,756
ザ・バック	12.8	12.8	28,633
化学(6.4%)			
北の達人コーポレーション	—	67.8	12,543
クラレ	266.5	262.9	287,875
旭化成	1,121.5	1,200.3	1,263,915
共和レザー	9.2	10.8	6,177

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
昭和電工	128.5	165.9	415,745	
住友化学	1,331.9	1,326.1	701,506	
住友精化	8.2	7.8	22,573	
日産化学	93.3	91.6	676,008	
ラサ工業	5.5	6.7	12,864	
クレハ	14.5	14.2	144,982	
多木化学	6.6	6.6	29,304	
テイカ	12.4	11.8	14,136	
石原産業	30.3	33.2	34,561	
片倉コープアグリ	4.4	4.3	5,878	
日本曹達	23.6	21.9	87,928	
東ソー	261.5	247.4	466,349	
トクヤマ	50.3	57.7	98,436	
セントラル硝子	32.3	29.3	82,245	
東亜合成	103.2	95.3	98,444	
大阪ソーダ	17.2	15.5	47,507	
関東電化工業	40.1	36.9	34,501	
デンカ	61.7	65.6	213,528	
信越化学工業	312.9	308.7	5,633,775	
日本カーバイド工業	6.2	6.8	9,805	
堺化学工業	11.9	12.6	23,990	
第一稀元素化学工業	17	16.6	17,546	
エア・ウォーター	172.5	161	280,623	
日本酸素ホールディングス	139.4	164.8	408,704	
日本化学工業	4.8	5.5	11,451	
東邦アセチレン	2.5	3.9	4,430	
日本パーカライジング	85.4	85	78,200	
高圧ガス工業	26.8	27.8	17,958	
チタン工業	2.1	2.2	3,960	
四国化成工業	22.5	22.7	28,375	
戸田工業	3.6	4	10,544	
ステラ ケミファ	9.2	9.5	24,576	
保土谷化学工業	5	5.4	19,440	
日本触媒	30.6	28.6	149,578	
大日精化工業	14	14.2	26,255	
カネカ	43.8	43.6	145,842	
三菱瓦斯化学	169.5	158.2	329,214	
三井化学	146.1	155.7	489,676	
J S R	169.8	176.6	712,581	
東京応化工業	29	29	216,630	
大阪有機化学工業	15.6	14.4	40,046	
三菱ケミカルホールディングス	1,131.1	1,206.6	934,391	
KHネオケム	27.9	29.8	74,827	
ダイセル	227.5	260.9	214,981	
住友ベークライト	26.6	27.8	122,181	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
積水化学工業	357.8	377.7	693,079	
日本ゼオン	152.6	151.9	207,039	
アイカ工業	47.1	47.4	135,801	
UBE	85.4	89.3	178,957	
積水樹脂	27.9	26.9	44,546	
タキロンシーアイ	36.6	41	21,853	
旭有機材	9.6	10.7	21,838	
ニチバン	8.9	10.4	16,764	
リケンテクノス	41.3	41.1	17,590	
大倉工業	8	8.7	14,607	
積水化成工業	22.7	23.5	9,470	
群栄化学工業	3.9	4	10,480	
タイガースポリマー	8.9	9.4	3,985	
ミライアル	5.4	6.1	10,949	
ダイキアクシス	6.5	7.4	5,698	
ダイキョーニシカワ	35.7	40	19,480	
竹本容器	6	6.8	5,548	
森六ホールディングス	9.1	9.5	17,746	
恵和	3.3	5.2	24,622	
日本化薬	104.7	136.6	149,713	
カーリットホールディングス	16.8	16.9	10,883	
日本精化	12.2	13.2	27,218	
扶桑化学工業	13.3	15.6	61,074	
トリケミカル研究所	15.7	19.5	50,329	
ADEKA	77.9	79	198,922	
日油	63.7	58.1	280,623	
新日本理化	28	28.4	7,213	
ハリマ化成グループ	12.6	13.1	9,890	
花王	413.7	409	2,149,704	
第一工業製薬	5.7	6.6	14,902	
石原ケミカル	4.3	9.1	11,547	
日華化学	5.7	6.4	5,222	
ニイタカ	3.5	3.7	8,010	
三洋化成工業	10.1	11.3	52,149	
有機合成薬品工業	13	13.2	3,735	
大日本塗料	19.1	22	16,500	
日本ペイントホールディングス	698	712	694,912	
関西ペイント	190.1	174.7	280,393	
神東塗料	13.3	14.9	2,324	
中国塗料	40.8	42.2	36,629	
日本特殊塗料	12.7	12.3	11,168	
藤倉化成	22.8	23.6	11,328	
太陽ホールディングス	12.4	27.9	91,233	
D I C	71.5	72.4	181,072	
サカタインクス	36.9	37.6	35,607	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東洋インキSCホールディングス	35.8	37.6		73,207
T&K TOKA	11.8	15.3		13,050
富士フィルムホールディングス	303.6	340.1		2,370,156
資生堂	343.3	360.4		1,979,677
ライオン	224.6	205.1		288,370
高砂香料工業	10.8	11.7		27,261
マンダム	36.2	38.7		55,263
ミルボン	23.1	23.9		124,041
ファンケル	62.9	78.3		169,362
コーセー	32.5	36.4		435,344
コタ	10.9	13.5		19,615
シーボン	2.2	2.5		4,422
ポーラ・オルビスホールディングス	73.7	82.6		131,416
ノエビアホールディングス	14.7	15		83,700
アジュバンホールディングス	3.9	4.3		4,420
新日本製薬	4.7	7.9		10,404
エステー	11.1	12.4		18,141
アグロ カネショウ	6.5	6.4		8,236
コニシ	28.4	30.2		47,776
長谷川香料	29.8	33.4		83,032
星光PMC	9.9	10.9		6,223
小林製薬	48.4	54.2		476,960
荒川化学工業	14.4	14.5		14,166
メック	11.8	13.7		39,976
日本高純度化学	4.7	4.8		11,049
タカラバイオ	45.2	50.6		92,092
JCU	19.4	20.4		75,174
新田ゼラチン	10.8	11.4		7,102
OATアグリオ	3.3	8		13,096
デクセリアルズ	48.3	50.4		209,916
アース製薬	13	15.9		82,362
北興化学工業	16.1	16.8		17,068
大成ラミック	5.3	5.4		14,250
クミアイ化学工業	71.4	72		72,648
日本農薬	30.8	34.5		24,736
アキレス	11.9	12.4		17,000
有沢製作所	24	26.9		29,321
日東電工	104.4	117		1,086,930
レック	20.5	23.7		16,945
三光合成	18.1	22.1		7,646
きもと	26.4	29.6		6,926
藤森工業	15.5	15.8		55,695
前澤化成工業	11	11.7		14,917
未来工業	6.2	6.9		10,908
ウェーブロックホールディングス	6	7.3		5,037

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
JSP	10.1	11.3		15,921
エフビコ	31.8	35.6		97,650
天馬	12.9	15.2		34,032
信越ポリマー	26.6	34.7		38,100
東リ	43	45.5		9,373
ニフコ	63.4	64.6		196,707
バルカー	14	15.7		43,175
ユニ・チャーム	366.3	373		1,678,127
ショーエイコーボレーション	3.8	5.2		3,120
医薬品(5.2%)				
協和キリン	173.8	205.5		574,783
武田薬品工業	1,437.4	1,520.9		5,694,249
アステラス製薬	1,497.9	1,654.3		3,377,253
住友ファーマ	128.1	119.5		130,374
塩野義製薬	217.3	230.9		1,573,814
わかもと製薬	20.6	20.2		5,393
日本新薬	49	45		362,700
ビオフェルミン製薬	2.9	—		—
中外製薬	540.4	605.2		2,126,672
科研製薬	29.6	28.5		103,740
エーザイ	190.9	219.7		1,185,720
ロート製薬	82.3	94.6		324,005
小野薬品工業	396.7	393.8		1,362,941
久光製薬	50.2	44.3		152,613
持田製薬	24	22.5		70,087
参天製薬	300.6	345.1		362,009
扶桑薬品工業	5.6	6.4		14,444
日本ケミファ	2.1	2.1		4,032
ツムラ	57.6	56.9		168,367
日医工	48.9	57.2		20,763
キッセイ薬品工業	30.6	30.1		77,838
生化学工業	30.5	34.1		25,984
栄研化学	30.4	30.5		51,972
日水製薬	6.3	7.1		7,029
鳥居薬品	10.8	10.4		31,408
JCRファーマ	48.7	54.5		131,835
東和薬品	24.9	27.9		69,108
富士製薬工業	10.6	10.9		10,060
ゼリア新薬工業	31.3	30.9		62,912
第一三共	1,357.7	1,442.7		4,997,512
キョーリン製薬ホールディングス	38.1	36.2		61,431
大幸薬品	21.2	29.2		18,279
ダイト	11	12.2		32,195
大塚ホールディングス	359.1	379.8		1,662,384
大正製薬ホールディングス	41.1	39.2		193,452

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ペプチドリーム	89.1	101.5	166,764	
あすか製薬ホールディングス	19.7	19.6	19,560	
サワイグループホールディングス	37.8	38.9	150,932	
石油・石炭製品(0.5%)				
日本コークス工業	146	163.5	20,764	
ニチレキ	20.4	22.2	28,926	
ユシロ化学工業	9.7	9.5	9,367	
ビービー・カストロール	6.2	6.9	8,500	
富士石油	41.9	45.4	14,119	
MORESCO	6.2	6.4	7,808	
出光興産	191.7	202.8	707,772	
ENEOSホールディングス	2,599	2,910.9	1,506,099	
コスモエネルギーホールディングス	54.6	69.6	241,860	
ゴム製品(0.7%)				
横浜ゴム	100	98.5	163,805	
TOYO TIRE	90.9	95.7	165,178	
ブリヂストン	459.4	528.8	2,679,958	
住友ゴム工業	155.2	163.3	191,387	
藤倉コンポジット	15.1	15.5	13,671	
オカモト	10.5	9.9	38,362	
フコク	7.6	8.5	8,440	
ニッタ	17.9	18.8	52,489	
住友理工	33.5	37.5	21,112	
三ツ星ベルト	21	23.5	66,716	
バンドー化学	30.4	31.2	28,735	
ガラス・土石製品(0.7%)				
日東紡績	25.7	25.6	67,302	
AGC	158.6	168.6	832,041	
日本板硝子	87.7	89.3	34,469	
石塚硝子	2.9	3.1	5,359	
日本山村硝子	7.3	7.1	5,474	
日本電気硝子	64.1	73.8	202,581	
オハラ	6.9	7.8	9,539	
住友大阪セメント	31.1	32.9	109,557	
太平洋セメント	102.3	110	214,500	
日本ヒューム	15.9	17.2	11,902	
日本コンクリート工業	37.6	36.3	10,055	
三谷セキサン	8.1	8.3	42,911	
アジアパイルホールディングス	26.8	28.5	13,110	
東海カーボン	169	153.3	164,337	
日本カーボン	9.6	10	42,500	
東洋炭素	10.2	11.8	33,972	
ノリタケカンパニーリミテド	9.6	10.1	42,319	
TOTO	123.4	124.1	541,076	
日本碍子	190.2	197	372,330	
日本特殊陶業	131.5	139.1	340,099	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
MARUWA	6	6.7	105,458	
品川リフラクトリーズ	4.1	4.6	16,767	
黒崎播磨	3	3.3	14,107	
ヨータイ	12.5	12.4	19,753	
イソライト工業	7.8	—	—	
東京窯業	22.4	21.4	5,970	
ニッカトー	8	8.5	4,080	
フジミインコーポレーテッド	13.9	15.5	88,815	
クニミネ工業	5.5	6.2	6,144	
エーアンドエーマテリアル	3.3	3.3	2,894	
ニチアス	43.7	42.2	94,950	
ニチハ	24.1	25.5	60,537	
鉄鋼(0.8%)				
日本製鉄	815.6	818.4	1,815,211	
神戸製鋼所	312.8	341.4	231,469	
中山製鋼所	23.9	28	12,096	
合同製鐵	9.3	9.7	12,367	
ジェイ エフ イー ホールディングス	494.4	467.6	743,016	
東京製鐵	66.6	59.1	91,605	
共英製鋼	19.3	19.8	25,898	
大和工業	36.3	32.6	141,321	
東京製鋼	6.6	8.1	9,825	
大阪製鐵	9.1	10.2	14,371	
淀川製鋼所	22.5	22.4	51,318	
丸一鋼管	55.5	57.2	169,197	
モリ工業	5.1	5	12,010	
大同特殊鋼	28	27.9	102,672	
日本高周波鋼業	6.5	7.3	2,489	
日本冶金工業	13.3	13.4	30,016	
山陽特殊製鋼	20.5	17.5	36,680	
愛知製鋼	9.6	10.8	21,729	
日立金属	161.1	206.2	425,390	
日本金属	4.3	4.8	5,654	
大平洋金属	11.6	11.8	34,314	
新日本電工	110.5	112	40,096	
栗本鐵工所	7.8	8.2	13,185	
虹技	2.4	2.6	2,545	
三菱製鋼	12.7	12.3	11,758	
日亜鋼業	25.3	23.1	5,913	
日本精線	2.5	3	12,495	
エンビプロ・ホールディングス	7.4	12.7	11,887	
シンニッタン	21	23.4	5,194	
新家工業	4.3	4.3	6,282	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	25.9	25.4	34,544	
日本軽金属ホールディングス	46.6	48.5	76,533	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
三井金属鉱業	46.1	51.7	176,555	
東邦亜鉛	9.5	10.1	24,108	
三菱マテリアル	112.9	115.9	230,525	
住友金属鉱山	218.4	221.3	1,196,569	
DOWAホールディングス	43.3	47.2	222,548	
古河機械金属	28.3	30.1	37,173	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17.9	22.2	41,913	
東邦チタニウム	30.7	34.3	72,270	
UACJ	26	27.2	59,051	
CKサンエツ	3.6	3.8	15,656	
古河電気工業	53.1	56.7	123,039	
住友電気工業	596.3	683.7	997,176	
フジクラ	206.3	213.4	162,824	
昭和電線ホールディングス	16.6	16.7	29,475	
東京特殊電線	2.2	2.6	6,032	
タツタ電線	30.4	34	16,218	
カナレ電気	2.9	2.9	4,903	
平河ヒューテック	9.6	10.7	11,834	
リョービ	21.1	21	22,869	
アーレスティ	21.3	20.7	7,659	
アサヒホールディングス	64.2	76.7	160,379	
金属製品 (0.6%)				
稲葉製作所	9.6	10	13,000	
官地エンジニアリンググループ	5.6	5.5	18,590	
トーカロ	44.1	49.4	67,134	
アルファC o	6	6.9	6,713	
SUMCO	217.9	308.5	636,127	
川田テクノロジーズ	3.5	3.7	12,617	
RS Technologies	5.5	6.2	37,634	
ジェイテックコーポレーション	1.9	2.5	5,692	
信和	9.1	11.9	9,436	
東洋製罐グループホールディングス	108.8	105.6	144,144	
ホッカンホールディングス	8.7	9.4	11,486	
コロナ	9.4	9.7	7,954	
横河ブリッジホールディングス	29.3	29.2	56,472	
駒井ハルテック	3.5	3.2	5,465	
高田機工	1.6	1.7	4,318	
三和ホールディングス	161.1	180.4	227,664	
文化シャッター	50.3	57.8	55,488	
三協立山	22	23.4	13,618	
アルインコ	11.3	13.1	11,095	
東洋シャッター	3.8	4.2	2,700	
L I X I L	235.3	301.2	768,060	
日本ファイルコン	11.9	12.4	6,212	
ノーリツ	35.4	32.6	49,943	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
長府製作所	17.4	19.5	35,100	
リンナイ	33.2	34.1	298,034	
ダイニチ工業	8.2	9.2	5,934	
日東精工	21.4	22.4	11,222	
三洋工業	2.1	2.3	4,146	
岡部	34.6	31.6	20,066	
ジーテクト	21.2	22	28,028	
東プレ	31.9	31.4	31,902	
高周波熱練	32.9	30.3	19,604	
東京製網	12.2	11.7	10,904	
サンコール	14.6	16.4	10,496	
モリテック スチール	13.3	14.9	4,619	
パイオラックス	25.3	25.9	43,512	
エイチワン	16.8	17.6	10,331	
日本発條	170.2	166.2	155,729	
中央発條	8.2	9.2	6,504	
アドバネクス	2.5	2.5	4,090	
立川ブラインド工業	7.5	7.8	8,494	
三益半導体工業	13.3	14.9	36,311	
機械 (5.4%)				
日本ドライケミカル	4.3	4.5	6,889	
日本製鋼所	51.9	52.2	169,911	
三浦工業	74	77.9	227,779	
タクマ	58	58.4	84,154	
ツガミ	35.5	40.3	49,286	
オークマ	20	19.7	105,592	
芝浦機械	17.8	21.7	68,355	
アマダ	250.6	302.3	315,903	
アイダエンジニアリング	45	44.8	41,619	
滝澤鉄工所	5	5.6	7,442	
F U J I	68.3	80.4	180,980	
牧野フライス製作所	20.1	20	85,800	
オーエスジー	84.4	85.6	146,033	
ダイジェット工業	2.1	2.4	2,172	
旭ダイヤモンド工業	45.3	48.4	29,136	
DMG森精機	108.2	108.6	214,919	
ソディック	41.1	41.8	31,893	
ディスコ	23.2	28.2	992,640	
日東工器	8.2	9.7	14,433	
日進工具	13.5	15.1	20,490	
パンチ工業	14.4	16.4	7,691	
富士ダイス	8.7	9.8	6,566	
豊和工業	9.7	10.2	8,302	
OKK	6.6	7.1	7,753	
東洋機械金属	12.4	12.6	7,686	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
津田駒工業	3.3	3.4	1,876
エンシュウ	4.4	4.6	3,496
島精機製作所	25.1	28.1	56,762
オプトラン	21.5	24	48,528
N Cホールディングス	5.3	4.9	8,962
イワキポンプ	11	12.3	12,140
フリーユ	16.8	17.1	17,801
ヤマシンフィルタ	34.6	33.2	10,159
日阪製作所	21.2	21.1	17,470
やまびこ	33.2	33.7	40,507
野村マイクロ・サイエンス	—	6.3	26,964
平田機工	8.1	8.6	36,163
ペガサスミシン製造	17.5	19.6	11,191
マルマエ	7.1	7.9	16,724
タツモ	7.3	9	10,800
ナブテスコ	100.7	104.3	329,588
三井海洋開発	18.2	20.4	25,663
レオン自動車	16.8	20.5	27,654
SMC	50.6	56.7	3,766,014
ホソカワミクロン	6	12.8	32,460
ユニオンツール	6.4	7.2	26,460
オイレス工業	24	25.5	39,856
日精エー・エス・ピー機械	5.8	7.1	22,400
サトーホールディングス	22.5	25.2	48,031
技研製作所	15.1	17	61,880
日本エアータック	5.7	8.9	9,763
カワタ	4.8	5.9	6,035
日精樹脂工業	13.3	12.8	11,622
オカダアイヨン	5.5	6.1	9,351
ワイエイシイホールディングス	6.8	7.6	13,976
小松製作所	782.8	877	2,816,924
住友重機械工業	99	105.9	326,172
日立建機	80.8	77.6	234,352
日工	26.1	25.3	15,508
巴工業	6.8	7.2	17,496
井関農機	17.4	16.3	20,179
TOWA	16.2	16.6	30,643
丸山製作所	3.6	3.5	5,439
北川鉄工所	7.9	8.1	11,542
ローツェ	7.6	9.5	104,690
タカキタ	6.2	6.3	3,641
クボタ	907.6	937.5	2,253,281
荏原実業	4.4	9	21,816
三菱化工機	5.6	6	12,510
月島機械	32	32.3	28,811

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
帝国電機製作所	12.1	12.8	20,531
新東工業	41.3	38.7	26,470
澁谷工業	15.2	15.9	36,824
アイチ コーポレーション	29.6	27.9	25,249
小森コーポレーション	44.1	47.1	35,984
鶴見製作所	13.4	14.2	25,616
住友精密工業	2.6	2.9	7,943
日本ギア工業	7.2	7.2	1,951
酒井重工業	3.1	3.3	9,781
荏原製作所	71.7	77.5	427,800
石井鐵工所	2.5	2.5	7,162
西島製作所	17.7	16.5	21,466
北越工業	17.9	17	13,906
ダイキン工業	220.1	223.1	4,604,784
オルガノ	5.6	5.6	55,664
トーヨーカネツ	6.6	7	19,586
栗田工業	93.5	100.1	496,496
椿本チエイン	24.7	25.4	79,121
大同工業	8.4	8.4	7,005
木村化工機	14.6	15.7	10,424
アネスト岩田	29.2	30.2	26,032
ダイフク	95.1	96.4	795,300
サムコ	4.3	5.2	13,972
加藤製作所	9.7	9.5	7,647
油研工業	3	3.2	5,664
タダノ	83.6	96.3	92,448
フジテック	59.5	62.7	164,838
CKD	40.1	51.7	98,281
キトー	14.6	15.6	41,277
平和	48.2	54	104,544
理想科学工業	12.7	15.7	33,990
SANKYO	41.1	41.8	178,277
日本金銭機械	19.3	19.8	13,642
マースグループホールディングス	11	12.3	21,008
フクシマガリレイ	11.9	12.4	42,222
オーイズミ	7.5	7	3,010
ダイコク電機	8	9	10,548
竹内製作所	28.9	29.5	68,646
アマノ	45.3	50.7	125,533
JUKI	24	26.9	18,776
ジャノメ	15.8	16.6	11,586
マックス	23.2	23.9	37,546
グローリー	44.4	47.2	94,872
新晃工業	16.1	18.1	27,475
大和冷機工業	27.8	28.1	29,027

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
セガサミーホールディングス	157.2	192	459,456			
日本ビストンリング	6.4	7.1	9,222			
リケン	8	7.5	17,437			
T P R	23.3	23.2	28,628			
ツバキ・ナカシマ	33.3	42.6	41,322			
ホシザキ	54.4	56.6	438,084			
大豊工業	14.2	15.9	11,257			
日本精工	354.9	342.4	256,800			
NTN	399.8	373.2	97,778			
ジェイテクト	165.8	172	169,076			
不二越	16.1	14.5	53,940			
日本トムソン	47.5	47.3	26,629			
THK	107.7	109.3	302,542			
ユーシン精機	11.6	15.1	10,464			
前澤給装工業	12.1	13.3	10,932			
イーグル工業	21.4	22	21,450			
前澤工業	10.5	12.2	7,259			
日本ビラー工業	17.5	17.6	50,723			
キッツ	53.5	58.1	39,682			
マキタ	225.3	224.3	798,059			
三井E&Sホールディングス	—	70.2	25,342			
日立造船	137.3	157.2	125,288			
三菱重工業	271.5	290.6	1,446,316			
I H I	116.2	120.9	447,330			
スター精密	26.7	27	45,468			
電気機器 (18.3%)						
日清紡ホールディングス	105.7	111.7	115,386			
イビデン	83.3	96.2	459,355			
コニカミノルタ	352.2	405.5	175,987			
ブラザー工業	211.4	226.3	540,178			
ミネベアミツミ	298.2	317	745,584			
日立製作所	830.7	930.7	6,310,146			
東芝	341.9	338.2	1,971,029			
三菱電機	1,727.6	1,849	2,622,806			
富士電機	104.1	110.6	668,024			
東洋電機製造	7	6.6	5,979			
安川電機	186	197.6	883,272			
シンフォニアテクノロジー	22.5	20.9	28,424			
明電舎	29.4	29.2	60,502			
オリジン	4.9	4.6	5,915			
山洋電気	8.5	7.8	42,978			
デンヨー	14.8	14.7	23,475			
P H Cホールディングス	—	30.7	44,607			
東芝テック	18.6	20.8	84,136			
芝浦メカトロニクス	3.2	3.5	37,520			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
マブチモーター	48.1	44.7	159,355			
日本電産	415.9	453.9	3,922,603			
トレックス・セミコンダクター	9.8	9.2	27,176			
東光高岳	9.5	11.4	20,303			
ダイヘン	18.9	19	78,375			
ヤーマン	28.9	32.6	39,315			
J V Cケンウッド	154.1	164	31,160			
ミマキエン지니어リング	17	19.5	11,173			
I - P E X	8.5	9.9	13,761			
日新電機	40.6	45.3	67,995			
大崎電気工業	34.6	33.5	16,616			
オムロン	143.8	161.1	1,196,167			
日東工業	25.4	24.3	53,217			
I D E C	23.2	24	63,408			
正興電機製作所	6.1	6.7	7,316			
不二電機工業	3.7	4.6	5,451			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62.4	60.3	125,544			
サクサホールディングス	4.2	4.5	6,817			
メルコホールディングス	6.2	5.4	19,764			
テクノメディカ	4.5	5.1	8,246			
日本電気	219.5	235	1,236,100			
富士通	155.5	174.1	3,394,950			
沖電気工業	70.3	75.1	56,700			
岩崎通信機	7.6	7.9	6,912			
電気興業	8.4	9.6	24,480			
サンケン電気	20.2	17.1	93,879			
ナカヨ	3.5	3.3	3,709			
アイホン	9.9	9.5	16,150			
ルネサスエレクトロニクス	744.7	1,052.4	1,610,172			
セイコーエプソン	214.4	224.1	482,935			
ワコム	126.6	151.3	146,761			
アルバック	31.8	38.5	213,290			
アクセル	8.3	9.1	7,689			
E I Z O	14.7	14.1	49,279			
日本信号	40.4	43.8	39,901			
京三製作所	37.5	39	16,965			
能美防災	23.4	23.9	40,653			
ホーチキ	13.4	13.7	16,714			
星和電機	10.4	10.8	5,000			
エレコム	40.1	45.1	70,401			
パナソニック ホールディングス	1,842.6	2,063.8	2,473,464			
シャープ	229.8	196.1	209,238			
アンリツ	103.9	124.6	179,922			
富士通ゼネラル	52.8	52.5	132,877			
ソニーグループ	1,082.3	1,212.1	14,539,139			

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
TDK	83.5	280.5	1,238,407
帝国通信工業	8.6	9.4	13,667
タムラ製作所	62.4	71.3	39,286
アルプスアルパイン	142	163.3	227,803
池上通信機	5.5	5.7	3,448
日本電波工業	—	20.4	23,276
鈴木	8.8	11	9,394
メイコー	—	21.2	96,248
日本トリム	4	4.2	10,134
ローランド ディー、ジー、	10.7	11.8	37,347
フォスター電機	17.6	18.5	13,042
SMK	4.5	4.5	9,792
ヨコオ	13.9	13.9	33,554
ホシデン	48.2	45	56,115
ヒロセ電機	26.6	28.3	502,608
日本航空電子工業	39.7	40.7	80,626
TOA	20.6	20.7	16,767
マクセル	35.2	37.3	46,028
古野電気	23.2	24.2	24,514
ユニデンホールディングス	4.5	4.2	14,196
スミダコーポレーション	15.7	19.6	16,444
アイコム	7.2	6.5	15,710
リオン	7.7	7.4	19,173
本多通信工業	15.6	17.5	9,030
横河電機	173	182.9	421,767
新電元工業	6.7	7	22,750
アズビル	116.9	113.4	425,250
東亜ディーケーケー	9.8	10.8	10,497
日本光電工業	71.7	76.8	233,472
チノー	5.6	6.1	10,351
共和電業	18.7	18.5	6,382
日本電子材料	7.2	9.3	17,577
堀場製作所	34.2	34.1	226,083
アドバンテスト	128.5	143.8	1,264,002
小野測器	9.2	10.3	4,532
エスベック	15.8	15.4	27,612
キーエンス	169.6	175.3	9,052,492
日置電機	8.5	9.4	67,586
シスメックス	134.9	147.1	1,237,699
日本マイクロニクス	30.7	31.3	46,167
メガチップス	17.6	17.5	63,175
OBARA GROUP	8.1	8.4	24,628
澤藤電機	2.3	3.2	4,883
原田工業	8.2	10.5	10,174
コーセル	22	23	17,986

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
イリソ電子工業	14.7	16.6	55,444
オブテックグループ	28.9	32.4	64,249
千代田インテグレ	7.8	8.2	16,072
アイ・オー・データ機器	7.3	—	—
レーザーテック	75.9	81.3	1,514,212
スタンレー電気	121.2	128.7	300,643
岩崎電気	7	6.9	17,201
ウシオ電機	89.2	94.8	166,089
岡谷電機産業	15.3	18.2	5,296
ヘリオス テクノ ホールディング	18.9	20.6	6,056
エノモト	5.4	6.1	10,138
日本セラミック	17.9	18.6	39,357
遠藤照明	10.1	10.4	8,392
古河電池	13	14.8	17,819
双信電機	10.5	11.3	6,723
山一電機	11.9	13.7	25,687
図研	11.6	13	37,011
日本電子	31.6	38.4	240,768
カシオ計算機	139	124.7	147,146
ファナック	151.6	169.8	3,619,287
日本シイエムケイ	39.4	38.1	17,792
エンブラス	8.1	5.1	17,161
大真空	6.2	25.8	26,445
ローム	71.9	82.6	883,820
浜松ホトニクス	124.1	132.4	801,020
三井ハイテック	17.2	17.5	191,800
新光電気工業	58.3	57.1	277,220
京セラ	263.5	272.4	2,001,867
太陽誘電	77	88.9	464,947
村田製作所	507.6	541.5	4,465,750
双葉電子工業	30.8	34.9	24,011
北陸電気工業	7.6	8.2	9,987
ニチコン	55.3	55.6	73,670
日本ケミコン	17.4	19	34,637
KOA	24.6	28.3	48,251
市光工業	27.3	26.6	9,496
小糸製作所	103.6	100.1	472,972
ミツバ	31.8	32	12,832
SCREENホールディングス	30	31.5	374,850
キヤノン電子	16.5	18.5	28,656
キヤノン	858.5	961.5	3,141,220
リコー	439.6	486	517,590
象印マホービン	47.4	50.3	69,665
MUTOHホールディングス	2.9	3	6,492
東京エレクトロン	101.2	122.8	7,337,300

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
輸送用機器 (7.9%)			
トヨタ紡織	50.4	71.4	149,368
芦森工業	3.3	3.6	3,880
ユニプレス	28.4	30.8	26,549
豊田自動織機	139.8	143.6	1,191,880
モリタホールディングス	27.7	31	40,858
三櫻工業	24	26.8	17,312
デンソー	380.4	394.5	3,105,109
東海理化電機製作所	45.5	50.9	71,412
三井E&Sホールディングス	66.9	—	—
川崎重工業	134.4	134.5	338,536
名村造船所	51.9	52.6	21,355
日本車輛製造	6.3	6.5	13,273
三菱ロジスネクスト	22.9	25.6	22,220
近畿車輛	3	2.9	3,543
日産自動車	2,037.5	2,282	1,146,248
いすゞ自動車	458.7	576.1	863,573
トヨタ自動車	1,750.2	9,148.4	19,454,072
日野自動車	215.7	241.6	171,536
三菱自動車工業	639.5	716.2	275,020
エフテック	12.2	12.7	7,226
レシップホールディングス	6.8	7.7	4,481
GMB	3.2	3.5	2,495
ファルテック	3.1	3.4	2,097
武蔵精密工業	38.5	43.1	59,995
日産車体	25.3	28.3	16,753
新明和工業	48.8	51.9	50,550
極東開発工業	29.8	32.5	45,175
トビー工業	14.3	14.9	19,295
ティラド	5.4	5	14,185
曙ブレーキ工業	94.8	106.2	15,611
タチエス	26.5	32.5	36,985
NOK	83.6	79.8	93,605
フタバ産業	43.4	44.8	17,113
KYB	19.3	18	53,154
大同メタル工業	35.8	37.1	19,477
プレス工業	85.9	88.9	36,715
ミクニ	22.2	23.2	8,328
太平洋工業	36.3	38.1	39,928
河西工業	23.5	23.7	6,825
アイシン	126.5	141.6	584,100
マツダ	542.2	582	636,708
今仙電機製作所	15.2	12.7	7,442
本田技研工業	1,360.3	1,451	4,619,984
スズキ	342.4	403.3	1,544,639

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
SUBARU	495.1	523.7	1,116,790
安永	8.4	8.3	5,810
ヤマハ発動機	244.1	252.5	659,782
TBK	20.7	20	6,820
エクセディ	23.5	29.2	48,851
豊田合成	55.8	57.3	117,006
愛三工業	27.2	30.3	22,361
盟和産業	2.7	2.7	2,835
日本プラス	14.7	14.4	6,465
ヨロズ	14.9	16.1	13,057
エフ・シー・シー	28.3	31.6	42,028
シマノ	64.7	73.7	1,692,520
テイ・エス テック	80.3	81.7	107,108
ジャムコ	10.1	11.3	10,633
精密機器 (2.8%)			
テルモ	529.6	547.5	2,310,997
クリエートメディック	5.7	5.8	5,846
日機装	55.8	52.1	42,878
日本エム・ディ・エム	10	11.2	17,281
島津製作所	222.3	237.2	1,114,840
JMS	14.6	15.4	8,824
長野計器	12.5	13.3	15,348
プイ・テクノロジー	8.1	8.5	24,777
東京計器	11	12.3	16,568
愛知時計電機	2.3	7.4	11,181
インターアクション	8.7	9.7	20,680
オーバル	15.6	17.4	5,689
東京精密	29.1	31	153,450
マニー	68.8	72.8	106,724
ニコン	263.9	280.4	448,920
トプコン	87	91	168,350
オリンパス	955.9	962.7	2,619,506
理研計器	15.2	13.8	59,823
タムロン	13.9	14	34,384
HOYA	340	373.6	5,239,740
シード	6.8	9.1	4,550
ノーリツ鋼機	15.5	17.4	40,890
A&Dホロンホールディングス	14.6	21.8	22,192
朝日インテック	181.9	212.2	414,638
シチズン時計	219.3	201.5	111,832
リズム	5.5	6.1	10,967
大研医器	13.7	15.4	8,115
メニコン	26.6	61.2	168,116
シンシア	1.9	2.1	963
松風	7.9	7	10,514

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
セイコーホールディングス	24.5	27.4	72,116	
ニプロ	128.8	137.4	142,346	
その他製品(2.4%)				
中本パックス	4.4	5.4	8,758	
スノーピーク	10.2	25.2	67,611	
パラムントベッドホールディングス	33.1	37.1	75,498	
トランザクション	9.5	11.8	12,567	
粧美堂	5	5.1	2,121	
ニホンフラッシュ	14.8	15.6	13,930	
前田工織	19	18.7	49,742	
永大産業	22.6	22.5	6,052	
アートネイチャー	16.6	16.5	12,540	
バンダイナムコホールディングス	142.9	164.5	1,600,091	
アイフィスジャパン	4.4	4.9	3,449	
共立印刷	28.9	28.5	4,360	
SHOE I	16.2	17.3	83,991	
フランスベッドホールディングス	22.2	24.9	22,559	
パイロットコーポレーション	29.2	29.3	147,086	
萩原工業	9.6	11.9	13,566	
トッパン・フォームズ	30.8	—	—	
フジシールインターナショナル	35.5	42.2	66,211	
タカラトミー	77.5	79.9	103,230	
広済堂ホールディングス	12	12	12,168	
エステールホールディングス	4.6	4.3	2,734	
タカノ	5.9	6.6	5,643	
プロネクサス	13.9	15	16,785	
ホクシン	10.7	13.6	1,985	
ウッドワン	5.8	5.9	7,203	
大建工業	11.6	10.3	19,147	
凸版印刷	262.6	266.1	648,485	
大日本印刷	208.7	216	641,952	
共同印刷	5.3	5.2	13,520	
N I S S H A	35.5	35.6	53,649	
光村印刷	1.5	1.6	2,040	
TAKARA & COMPANY	8.5	11.3	20,419	
アシックス	152.8	155.9	356,075	
ツツミ	4.3	4.8	9,408	
ローランド	13.4	13.5	63,112	
小松ウオール工業	5.3	5.9	11,381	
ヤマハ	102.7	112.5	606,375	
河合楽器製作所	4.8	5.1	14,703	
クリナップ	16.1	18	9,990	
ビジョン	110.9	116.9	219,772	
オリバー	3.7	—	—	
兼松サステック	1.1	1.2	1,930	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
キングジム	14.3	15.1	13,816	
リントック	37	38.4	91,660	
イトーキ	34.3	35.7	14,601	
任天堂	98.9	109.2	6,369,636	
三菱鉛筆	28.4	28	37,744	
タカラスタンダード	35.7	34.1	42,284	
コクヨ	82.9	87.7	147,248	
ナカバヤシ	17	16.1	7,937	
グローブライド	8.4	15.4	34,865	
オカムラ	59.4	58.4	65,875	
美津濃	17.1	17	37,961	
電気・ガス業(1.3%)				
東京電力ホールディングス	1,465.4	1,448.1	703,776	
中部電力	528.5	561.6	736,819	
関西電力	654.6	695.6	882,716	
中国電力	249.2	286.9	249,889	
北陸電力	157.9	168.5	88,462	
東北電力	404.6	433	312,193	
四国電力	143.6	165.3	127,611	
九州電力	381.5	379.8	321,690	
北海道電力	161.7	168.1	83,881	
沖縄電力	33.6	41	49,405	
電源開発	137.5	150.3	309,016	
エフオン	10.4	11.7	6,388	
イーレックス	25.4	26.1	54,575	
レノバ	29.3	37.9	73,563	
東京瓦斯	332.2	353.3	907,627	
大阪瓦斯	312.9	333.8	813,136	
東邦瓦斯	85	80.1	227,083	
北海道瓦斯	9.3	9.6	15,993	
広島ガス	35.6	34.8	11,170	
西部ガスホールディングス	19.4	19.5	38,317	
静岡ガス	49	47.3	39,306	
メタウォーター	19.4	20.1	42,109	
陸運業(3.0%)				
SBSホールディングス	12.8	14.3	42,256	
東武鉄道	180.1	180.7	524,572	
相鉄ホールディングス	59.2	59	132,750	
東急	435.7	463	691,259	
京浜急行電鉄	221.9	226.4	306,772	
小田急電鉄	276.7	258.3	443,501	
京王電鉄	96.5	90.1	387,880	
京成電鉄	129.5	120.9	418,918	
富士急行	23.6	20.9	86,108	
新京成電鉄	4.4	4.5	12,915	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
東日本旅客鉄道	304.1	310.3	2,076,527
西日本旅客鉄道	153.9	215	1,033,075
東海旅客鉄道	143.6	144.4	2,358,052
西武ホールディングス	208.2	239.7	325,992
鴻池運輸	27.5	28.5	32,205
西日本鉄道	47.9	48.9	135,697
ハマキョウレックス	13.3	12.9	37,126
サカイ引越センター	7.9	8.9	39,471
近鉄グループホールディングス	163.6	175.6	663,768
阪急阪神ホールディングス	218.2	219	754,455
南海電気鉄道	77.6	78.3	192,226
京阪ホールディングス	72.9	74.8	225,522
神戸電鉄	3.9	4.4	15,004
名古屋鉄道	134.5	185.1	402,037
山陽電気鉄道	11.7	13.4	28,649
アルプス物流	11.4	12.8	15,065
日本通運	56.6	—	—
ヤマトホールディングス	229.3	256.8	574,975
山九	42	45.8	177,933
丸運	9.3	9.3	2,185
丸全昭和運輸	13.3	13.2	40,590
センコーグループホールディングス	90.2	88.1	75,237
トナミホールディングス	3.9	3.8	12,996
ニッコンホールディングス	54.9	58.8	119,540
日本石油輸送	1.8	2	5,158
福山通運	20.9	25.7	84,553
セイノーホールディングス	122.5	108.1	110,586
エスライン	4.5	5.2	4,456
神奈川中央交通	4.1	4.5	15,952
日立物流	36	35.4	300,192
丸和運輸機関	34.5	33.5	52,762
C&Fロジホールディングス	16.5	16.5	17,539
九州旅客鉄道	126.6	129.2	336,824
S Gホールディングス	309.1	320.6	722,311
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	57.4	428,204
海運業(0.7%)			
日本郵船	137.2	153.6	1,678,848
商船三井	97.4	291	1,037,415
川崎汽船	50.4	56.4	598,404
N Sユナイテッド海運	8.4	10	43,150
飯野海運	79.4	82.2	55,074
共栄タンカー	4.7	6.8	7,568
乾汽船	11.2	11.5	21,033
空運業(0.4%)			
日本航空	398.6	402.7	961,647

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
ANAホールディングス	441.6	446.1	1,160,529
パスコ	3.2	3.5	4,655
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	5	5.1	32,895
日新	13	13.8	23,253
三菱倉庫	56.6	51.1	156,877
三井倉庫ホールディングス	17.4	18.4	54,519
住友倉庫	57.8	57.1	125,848
澁澤倉庫	9	9.8	23,030
東陽倉庫	27.4	27.6	8,390
日本トランスシティ	36	35	18,585
ケイヒン	3.2	3.1	4,268
中央倉庫	10	10	9,960
川西倉庫	3	3.3	3,795
安田倉庫	13.4	13.2	12,658
ファイズホールディングス	2.9	3.9	2,956
東洋埠頭	5	5.3	7,117
宇徳	11.7	—	—
上組	90	94.5	244,944
サンリツ	4.2	4.8	3,580
キムラユニティー	4.4	4.8	7,320
キューソー流通システム	4.1	9.1	9,873
近鉄エクスプレス	30.9	34.6	144,455
東海運	9.3	10.4	3,120
エーアイティー	10.3	11.5	18,929
内外トランスライン	5.7	7.1	14,427
日本コンセプト	5.2	5.8	8,717
情報・通信業(9.0%)			
NECネットエスアイ	56.3	62.9	117,685
クロスキャット	4.8	10.1	8,776
システナ	60.7	271.4	119,687
デジタルアーツ	9.9	10.2	73,440
日鉄ソリューションズ	24.7	31.2	118,404
キューブシステム	9.4	9.8	9,339
WOW WORLD	2.8	2.8	3,211
コア	7.4	8.2	12,234
手間いらず	—	2.8	16,072
ラクーンホールディングス	12.1	16.3	23,895
ソリトンシステムズ	8.7	9.7	12,590
ソフトクリエイティブホールディングス	6.8	8.3	35,233
T I S	169.7	171.1	593,717
J N Sホールディングス	8.3	8.8	3,546
電算システム	6.5	—	—
グリー	104.6	86.6	77,766
GMOペパボ	1.5	2.1	4,630

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
コーエーテックホールディングス	45.1	60.6	276,336	
三菱総合研究所	7.4	8.9	36,846	
電算	2	2.2	5,011	
AGS	9.1	8.5	6,324	
ファインデックス	14.6	16.3	10,106	
ブレインパッド	4.5	16.3	18,174	
KL a b	31.1	33.3	16,283	
ポルトゥワインホールディングス	22.9	27.7	28,918	
イーブックイニシアティブジャパン	2.9	—	—	
ネクソン	429.1	431.4	1,393,422	
アイスタイル	52.4	50	10,750	
エムアップホールディングス	4.5	22.1	26,011	
エイチーム	11.9	12.6	9,235	
エニグモ	16.3	20.9	11,662	
テクノスジャパン	13.8	15.1	7,852	
コロブラ	56.2	62.8	40,254	
ブロードリーフ	84.7	94.7	36,648	
クロス・マーケティンググループ	8.2	7.5	6,022	
デジタルハーツホールディングス	8	8.7	16,547	
システム情報	13.1	14.4	14,832	
メディアドゥ	6.7	6.8	12,763	
じげん	42.9	54.3	19,548	
ブイキューブ	9.4	19.5	18,057	
エンカレッジ・テクノロジー	3.6	4.6	2,350	
サイバーリンクス	5.8	6.5	6,903	
フィックスターズ	18.5	19.1	15,509	
CARTA HOLDINGS	7.1	7.8	15,334	
オブティム	12	13.5	11,326	
セレス	5.7	7.3	10,125	
SHIFT	8.5	11.1	227,550	
ティーガイア	18.2	17	28,203	
セック	2.6	2.9	7,174	
日本アジアグループ	16.4	—	—	
テクマトリックス	26.5	32.2	53,967	
プロシップ	5.2	6.4	9,139	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41	49.4	122,314	
GMOペイメントゲートウェイ	32.5	36.8	396,704	
ザッパラス	7.3	7.4	2,871	
システムリサーチ	5.1	5.6	11,698	
インターネットイニシアティブ	45.3	50.6	238,832	
さくらインターネット	18.8	20.7	11,840	
ヴィンクス	5.2	5.5	5,978	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.8	4.3	24,768	
SRAホールディングス	9.1	9.2	26,137	
システムインテグレータ	5.4	6.4	3,129	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
朝日ネット	14.3	17.7	10,974	
eBASE	20.7	23.1	11,203	
アバント	18.4	20.5	27,162	
アドソル日進	6.2	6.9	11,136	
ODKソリューションズ	4	4.3	2,506	
フリービット	10.5	10.1	9,100	
コムチュア	15.7	21.4	61,268	
サイバーコム	3.3	3.1	3,565	
アステリア	12.7	13.9	14,219	
アイル	9.6	9.7	13,977	
マークラインズ	7.2	9.6	23,510	
メディカル・データ・ビジョン	19.5	24.3	23,133	
gumi	23.8	26.7	14,017	
ショーケース	4.2	4.6	2,116	
モバイルファクトリー	4.1	4.5	4,653	
テラスカイ	5.6	7.1	10,110	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7.7	8.5	12,393	
PCIホールディングス	6.7	8	8,480	
パイプドHD	3.7	3.5	9,593	
アイビーシー	3.1	3.3	1,689	
ネオジャパン	3.4	5.5	7,056	
PR TIMES	3.7	4.1	8,810	
ラクス	51.2	87.2	141,961	
ランドコンピュータ	2.9	4.5	4,167	
ダブルスタンダード	2.3	5.8	11,965	
オープンドア	10.2	11.4	22,412	
マイネット	5.5	6.8	3,495	
アカツキ	6.9	8.5	25,041	
ベネフィットジャパン	1.5	1.5	3,049	
Ubicomホールディングス	4.6	5.1	13,790	
カナミックネットワーク	18.7	22.6	11,413	
ノムラシステムコーポレーション	8.7	10.7	2,450	
チェンジ	31.3	38.1	66,675	
シンクロ・フード	11.1	10.4	3,276	
オークネット	9.2	10.2	18,207	
キャピタル・アセット・プランニング	3.7	3.8	2,667	
セグエグループ	4.7	5.3	2,909	
エイトレッド	3.4	2.8	5,740	
AOI TYO Holdings	17.6	—	—	
マクロミル	35.1	38.3	38,874	
ビーグリー	3.6	4.6	6,835	
オロ	5.5	5.9	10,968	
ユーザローカル	2.6	5.9	10,590	
テモナ	4	4.2	1,625	
ニーズウェル	4.1	5.4	3,736	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
マナーフォワード	—	38.7	140,868			
サインポスト	4.1	6.1	5,490			
電算システムホールディングス	—	7.9	19,291			
ソルクシーズ	6.9	16.7	6,412			
フェイス	5.6	5.3	3,604			
プロトコーポレーション	20.6	20.4	20,134			
ハイマックス	5.2	5.2	6,760			
野村総合研究所	294.6	342.5	1,233,000			
サイバネットシステム	12.5	13.8	10,350			
CEホールディングス	9.7	9.9	4,752			
日本システム技術	3.3	3.6	8,542			
インテージホールディングス	21.4	22	31,680			
東邦システムサイエンス	4.9	5.2	4,747			
ソースネクスト	81.7	82.8	19,044			
インフォコム	15.6	20.9	45,541			
シンプレクス・ホールディングス	—	30.1	58,454			
HEROZ	5	5.7	5,244			
ラクスル	18.5	22.1	47,271			
I P S	4.1	5.3	11,925			
F I G	19.7	21.3	6,624			
システムサポート	5.3	7	8,253			
イーソル	9.5	12	7,104			
アルテリア・ネットワークス	19	20.2	25,209			
E d u L a b	1.7	—	—			
東海ソフト	2.9	3.2	3,404			
ウイングアーク1 s t	9	14.6	20,600			
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4	4.4	7,312			
サーバーワークス	1.7	3.3	7,144			
東名	1.9	1.7	1,601			
ヴィッツ	1.8	1.9	2,257			
トビラシステムズ	2.5	4.1	3,325			
S a n s a n	15.1	62.8	66,819			
L i n k - U	3.4	3.7	2,442			
ギフティ	10.3	16.4	18,515			
ベース	2	3.3	20,592			
J M D C	—	23.8	127,568			
フォーカスシステムズ	11.8	12.3	11,414			
クレスコ	11.3	13.9	30,441			
フジ・メディア・ホールディングス	176.2	173.7	191,591			
オービック	53.4	59.8	1,153,542			
ジャストシステム	24.2	27.1	130,757			
T D C ソフト	15.2	15.8	16,621			
Zホールディングス	2,329.7	2,738.5	1,156,468			
トレンドマイクロ	90.6	95.9	729,799			
I Dホールディングス	6.7	12.2	10,638			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
日本オラクル	34.4	30.8	244,552			
アルファシステムズ	4.6	5.1	21,777			
フューチャー	20.6	40.2	68,058			
C A C H o l d i n g s	11.3	10.4	14,705			
S B テクノロジー	6.2	8.3	19,256			
トーセ	5.1	5.1	3,728			
オービックビジネスコンサルタント	17.3	18.2	81,718			
伊藤忠テクノソリューションズ	77.3	86.6	278,419			
アイティフォー	22.6	23.3	18,360			
東計電算	2.6	2.3	13,777			
エックスネット	3	3.2	3,225			
大塚商会	91.8	102.8	426,620			
サイボウズ	20	25.6	27,059			
電通国際情報サービス	21.1	24.9	103,086			
A C C E S S	21.6	21.8	12,927			
デジタルガレージ	28.1	31.5	126,630			
EMシステムズ	28.4	31.6	30,146			
ウェザーニューズ	5.2	6	40,620			
C I J	12	15	12,210			
ビジネスエンジニアリング	1.8	4.4	9,086			
日本エンタープライズ	19	20.6	3,399			
WOWOW	8.3	8.4	12,549			
スカラ	15.6	16.2	12,781			
インテリジェント ウェイブ	10.5	9.8	6,399			
I M A G I C A G R O U P	15.2	14.6	10,468			
ネットワンシステムズ	69.3	70.1	195,929			
システムソフト	37.5	53	5,883			
アルゴグラフィックス	13.3	14.8	46,768			
マーベラス	27.2	30.2	21,713			
エイベックス	29.4	32.9	38,065			
B I P R O G Y	58.9	59.4	171,369			
兼松エレクトロニクス	9.3	10.4	40,872			
都築電気	7.8	9	12,276			
T B S ホールディングス	112.7	99.8	171,955			
日本テレビホールディングス	141.8	158.7	194,248			
朝日放送グループホールディングス	17.4	16.6	11,055			
テレビ朝日ホールディングス	52.6	45.8	67,142			
スカパーJ SATホールディングス	112.5	161.2	75,119			
テレビ東京ホールディングス	12.3	12.3	25,116			
日本BS放送	6.1	6.6	7,002			
ビジョン	21.4	31.4	42,390			
スマートバリュー	4.9	4.7	2,594			
USEN-NEXT HOLDINGS	—	15.7	32,043			
ワイヤレスゲート	7.8	8.5	2,643			
コネクション	9.9	13.6	18,346			

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
クロップス	3.5	3.7	3,866
日本電信電話	1,983	2,080.9	8,300,710
KDDI	1,359.6	1,384.3	6,298,565
ソフトバンク	1,540.9	2,876	4,289,554
光通信	20	21.9	319,521
エムティーアイ	17	16.4	7,429
GMOインターネット	60.1	66.6	172,494
ファイバーゲート	5.8	8.9	9,638
アイドママーケティングコミュニケーション	5.3	4.8	1,372
KADOKAWA	44	102.8	322,278
学研ホールディングス	24.2	27.1	22,926
ゼンリン	31.1	31.2	29,047
昭文社ホールディングス	7.6	8.2	3,476
インプレスホールディングス	14	15.7	3,485
アイネット	9	9.3	11,522
松竹	11.2	11.5	159,505
東宝	100.1	112.1	563,863
東映	5.6	5.6	100,912
エヌ・ティ・ティ・データ	451.6	505.6	1,029,907
ビー・シー・エー	2.6	11.3	14,147
ビジネスブレイン太田昭和	6	6.1	9,308
DTS	35.3	35.4	110,625
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72.4	88.4	562,224
シーイーシー	18.4	20.5	25,358
カブコン	145.4	179.1	651,924
アイ・エス・ビー	8.1	9.1	9,700
ジャステック	11.1	11.2	13,036
SCSK	39.2	131.5	285,486
日本システムウエア	5.8	7.2	17,913
アイネス	17	16	24,448
TKC	28.8	30	104,700
富士ソフト	18.1	18.9	138,537
NSD	54.7	59.6	138,689
コナミホールディングス	61.6	69	613,410
福井コンピュータホールディングス	7.9	8.8	30,052
JBCホールディングス	11.7	12.9	21,052
ミロク情報サービス	17	16.9	20,381
ソフトバンクグループ	1,345.2	1,138.6	6,100,618
卸売業(5.7%)			
ハウスイ	1.4	—	—
高千穂交易	6.6	6.9	12,468
オルパヘルスケアホールディングス	2.8	3.1	5,648
伊藤忠食品	4.1	4.1	19,844
エレマテック	13.6	15.3	19,706
JALUX	4.8	—	—

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
あらた	13.5	14.5	58,580
トーマンデバイス	2.2	2.9	17,777
東京エレクトロン デバイス	5.6	5.7	32,148
フィールズ	14.9	16.7	17,685
双日	939.8	200.5	417,842
アルフレッサ ホールディングス	176.5	202.4	343,270
横浜冷凍	47.7	48.7	41,492
ラサ商事	9	8.9	8,615
アルコニックス	18.1	24.1	31,619
神戸物産	117.4	137	432,235
ハイパー	3.5	4.8	2,265
あい ホールディングス	24.3	27.2	44,961
ディーブイエックス	5.2	6.5	7,111
ダイワボウホールディングス	77.5	84.9	146,282
マクニカ・富士エレクトロニクス	40.6	45.5	129,038
ラクト・ジャパン	7.4	6.6	12,969
グリムス	5.1	8.5	13,013
バイタルケアエスケー・ホールディングス	29.6	31.3	21,628
八洲電機	13.2	13.8	13,758
メディアスホールディングス	9.7	10.9	11,957
レスターホールディングス	17.7	18.1	37,304
ジューテックホールディングス	3.9	4	3,992
大光	6.6	8.1	5,832
OCHIホールディングス	5	4.7	5,640
TOKAIホールディングス	82.5	92.4	80,665
黒谷	4.7	5.2	3,031
C o m i n i x	3	3.4	2,485
三洋貿易	17.2	18.1	17,267
ビューティガレージ	2.7	3.1	7,998
ウイン・パートナーズ	12.3	13.8	14,545
ミタチ産業	4.7	4.8	4,468
ジップヘルスケアホールディングス	60	57	132,297
明治電機工業	5.9	5.9	6,495
デリカフーズホールディングス	6.7	7.5	4,065
スターティアホールディングス	3.3	4.4	3,432
コメダホールディングス	37.1	41.6	92,643
ビーバンドットコム	2.4	2.7	1,474
アセンテック	4.4	6.6	5,035
富士興産	5.2	4.8	5,304
協栄産業	1.9	2	2,750
フルサト・マルカホールディングス	—	17.4	66,642
ヤマエグループホールディングス	—	11.4	13,053
小野建	15.3	17.5	24,395
南陽	3.5	3.7	6,793
佐鳥電機	10.6	11.9	13,649

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
エコートレーディング	3.6	4.1	2,337	
伯東	10.4	11.6	33,118	
コンドーテック	13.2	14.3	15,544	
中山福	9.9	10.1	3,353	
ナガイレーベン	22.6	23.8	45,672	
三菱食品	18.7	18.3	56,730	
松田産業	12.4	13.9	28,578	
第一興商	33.8	36.2	145,886	
メディパルホールディングス	170.5	186.1	335,166	
S P K	7.3	7.6	10,602	
萩原電気ホールディングス	6.3	6.7	13,601	
アズワン	12.2	27.3	178,815	
スズデン	5.9	6.2	12,592	
尾家産業	5	4.7	4,178	
シモジマ	10.4	11.7	11,395	
ドウシシャ	16.1	18	27,918	
小津産業	3.8	4.2	8,316	
高速	9	10.5	16,516	
たけびし	6	6.7	9,815	
リックス	3.9	4	7,520	
丸文	15.1	15.8	12,640	
ハビネット	14.2	15	23,685	
橋本総業ホールディングス	3.4	3.5	6,667	
日本ライフライン	55	56.5	52,658	
タカショー	11.1	14.7	11,142	
マルカ	5.5	—	—	
I D O M	57.4	57.9	39,082	
進和	10.1	11.3	24,939	
エスケイジャパン	4.2	4.7	2,124	
ダイトロン	7.2	7.6	15,800	
シークス	21.7	25.3	27,172	
田中商事	5.3	5.9	3,687	
オーハシテクニカ	8.7	9.7	12,348	
白銅	6.1	6.2	15,493	
ダイコー通産	2	2.3	2,785	
伊藤忠商事	1,190.1	1,206.1	4,487,898	
丸紅	1,678	1,740.8	2,384,025	
高島	2.7	2.7	6,725	
長瀬産業	93.4	92	167,992	
蝶理	10.9	10.7	21,250	
豊田通商	170.9	177.3	888,273	
三共生興	25.8	24.5	13,646	
兼松	68	67.7	89,702	
ツカモトコーポレーション	2.8	3.2	4,147	
三井物産	1,357.4	1,414.2	4,508,469	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
日本紙パルプ商事	8.9	9.3	33,573	
カメイ	22.2	21.1	21,986	
東都水産	2	1	4,460	
O U Gホールディングス	2.7	2.8	7,736	
スターゼン	12.6	13.3	26,028	
山善	66.5	72.6	68,897	
椿本興業	3.1	3.4	12,002	
住友商事	1,073.8	1,152.8	2,164,958	
内田洋行	7.3	7.7	34,881	
三菱商事	1,036	1,309.2	5,890,090	
第一実業	7.7	7.8	24,726	
キャノンマーケティングジャパン	42.2	47.3	143,792	
西華産業	9	8.7	14,233	
佐藤商事	14.1	14	16,086	
菱洋エレクトロ	13	11.3	24,148	
東京産業	15.5	16.1	11,334	
ユアサ商事	17.4	16.2	52,326	
神鋼商事	3.8	4.3	16,641	
トルク	10.3	10.3	2,173	
阪和興業	34.1	34.8	106,662	
正栄食品工業	11	12.3	49,630	
カナデン	13.8	15.5	15,872	
菱電商事	12.3	15.1	25,232	
フルサト工業	8.6	—	—	
岩谷産業	40.8	43.4	234,794	
ナイス	6.7	6.1	10,126	
ニチモウ	2.7	2.4	5,964	
極東貿易	4.9	5.5	14,245	
アステナホールディングス	24.5	25.4	10,490	
三愛オプリー	41.9	44.1	42,115	
稲畑産業	40.9	38.2	85,568	
G S Iクレオス	8.4	9.1	11,711	
明和産業	15.8	17.6	12,584	
クワザワホールディングス	6.1	7.1	3,308	
ヤマエ久野	12.4	—	—	
ワキタ	33.5	36.5	40,953	
東邦ホールディングス	54.6	54.9	110,184	
サンゲツ	45.9	47.4	72,996	
ミツロコグループホールディングス	25.1	23.7	22,135	
シナネンホールディングス	6.3	6.5	21,775	
伊藤忠エネクス	37.7	42.2	43,845	
サンリオ	47.8	55.3	146,379	
サンワテクノス	11.2	10.3	14,358	
リョーサン	18.8	20	49,260	
新光商事	23	26.3	24,038	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
トーヨー	7.7	7.8	9,024	
三信電気	9.1	8.2	12,841	
東陽テクニカ	16.8	18.8	20,304	
モスフードサービス	24.1	25	77,250	
加賀電子	15.4	16.1	49,668	
ソーダニッカ	16.3	16.9	10,224	
立花エレテック	12.6	13.2	20,750	
フォーバル	6	7.3	6,599	
PALTAC	27.3	26.7	118,948	
三谷産業	22.5	29.8	9,387	
西本Wismettacホールディングス	3.9	4.3	15,243	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.5	1.7	3,298	
コア商事ホールディングス	12.8	12	10,164	
国際紙バルブ商事	36.4	36.8	14,131	
ヤマダネ	7.3	8.4	13,918	
丸紅建材リース	1.7	1.7	3,155	
日鉄物産	12.1	12.3	66,297	
泉州電業	4.8	4.9	25,921	
トラスコ中山	39	39.7	73,286	
オートバックスセブン	63.1	60.8	83,782	
モリト	12.5	13.9	10,160	
加藤産業	24.6	22.9	73,394	
北恵	4.3	4.9	4,410	
イノテック	9.6	11.6	15,694	
イエローハット	32.2	31	51,522	
JKホールディングス	15.4	14.1	12,986	
日伝	14.1	13.9	27,160	
北沢産業	11.7	11.2	2,363	
杉本商事	8.6	8.9	20,915	
因幡電機産業	45.4	48.6	127,526	
東テク	5.6	5.9	18,172	
ミスミグループ本社	213.5	239.3	689,662	
アルテック	12.6	12.2	2,903	
タキヒヨー	5.7	5.4	5,513	
蔵王産業	3.3	3.7	7,466	
スズケン	72.1	70.4	248,864	
ジェコス	11.8	13.2	11,008	
グローセル	18.5	21.3	8,775	
小売業(4.1%)				
ローソン	43.1	42.2	193,276	
サンエー	13	13.5	53,797	
カワチ薬品	12	14.9	30,694	
エービーシー・マート	26.6	29.8	163,304	
ハードオフコーポレーション	8	8.8	7,735	
アスクル	27.7	43.4	64,188	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ゲオホールディングス	23.1	24.1	28,703	
アダストリア	23.8	20.7	43,801	
くら寿司	20.1	20	60,000	
キャンドウ	8.3	7.2	17,964	
アイケイ	5.4	6.7	3,604	
バルグループホールディングス	15.1	16.9	26,533	
エディオン	72.5	87.8	106,852	
サーラコーポレーション	35.2	39.2	24,852	
ワッツ	8.7	9.7	7,323	
ハローズ	7	8.8	28,996	
フジオフードグループ本社	14.3	14.8	20,276	
あみやき亭	3.8	4.6	13,703	
大黒天物産	5.5	6.2	28,334	
ハニーズホールディングス	13.9	16	16,592	
ファーマライズホールディングス	4.6	4.8	3,384	
アルペン	13.2	14.3	27,556	
ハブ	6	6.9	3,567	
クオールホールディングス	23.2	23.7	29,056	
ジンズホールディングス	11.6	11.1	46,287	
ビックカメラ	101.3	113.3	129,048	
DCMホールディングス	105.4	113.5	121,899	
MonotaRO	242.1	241.1	461,947	
東京一番フーズ	5	5.1	3,024	
きちりホールディングス	4.5	5.1	2,075	
アークランドサービスホールディングス	14.4	14.1	29,370	
J. フロント リテイリング	203.5	217.1	226,652	
ドトール・日レスホールディングス	27.2	31.3	47,294	
マツキヨココカラ&カンパニー	70.4	113.6	571,408	
ブロンコビリー	9.1	10.4	25,282	
ZOZO	100.4	131.2	366,441	
トレジャー・ファクトリー	5.4	5.9	6,271	
物語コーポレーション	9.1	9.5	50,730	
ココカラファイン	15.2	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	298.2	302.2	327,584	
Hamee	4.6	7.1	8,754	
マーケットエンタープライズ	1.4	2.3	2,438	
ウエルシアホールディングス	90.1	100.9	261,633	
クリエイトSDホールディングス	25.2	28.2	82,597	
丸善CHIホールディングス	19.9	22.2	8,702	
ミサワ	4	4.4	2,772	
ティーライフ	2.6	2.8	4,113	
チムニー	5.2	5.8	7,128	
シュッピン	12	16.1	23,296	
オイシックス・ラ・大地	22.5	27.6	52,798	
ネクステージ	30.2	38.9	80,484	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ジョイフル本田	50.1	57.5	90,735	
鳥貴族ホールディングス	6.5	6.7	12,709	
ホットランド	13	14.5	19,792	
すかいらくホールディングス	190.9	237.1	371,298	
SFPホールディングス	8.3	9.3	14,284	
綿半ホールディングス	13.1	13.8	18,547	
ヨシックスホールディングス	3.5	3.9	8,287	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49.8	55.7	59,209	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.1	10.2	12,291	
BEENOS	8.7	9.8	17,718	
あさひ	12.9	16	20,640	
日本調剤	10.6	11.9	14,434	
コスモス薬品	17.2	19.3	233,916	
トーエル	8.8	9	7,848	
オンリー	3.8	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	665.7	674.6	3,650,260	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	91.5	119.1	106,118	
ツルハホールディングス	37.1	41.6	289,536	
サンマルクホールディングス	13.7	15.3	23,577	
フェリシモ	4.1	4.5	5,400	
トリドールホールディングス	42.3	47.6	110,146	
TOKYO BASE	15.9	18.5	6,142	
ウイルプラスホールディングス	3	4	3,704	
JMホールディングス	11.6	14.1	21,248	
サツドラホールディングス	2.7	9.1	5,996	
アレンザホールディングス	13.3	13.6	13,749	
串カツ田中ホールディングス	4.7	5.3	9,757	
パロックジャパンリミテッド	12.3	13.7	11,151	
クスリのアオキホールディングス	17	17.7	97,350	
力の源ホールディングス	7.7	9.7	6,576	
FOOD & LIFE COMPANIES	99.7	102.4	291,532	
メディカルシステムネットワーク	15.3	18	7,884	
はるやまホールディングス	8.5	9.7	4,791	
ノジマ	30.4	30.9	90,907	
カッパ・クリエイト	23.9	26.7	38,047	
ライトオン	12.7	14.2	10,550	
良品計画	196	219.5	296,983	
バリミキホールディングス	22.5	24.9	6,897	
アドヴァングループ	17.7	17.7	13,558	
アルビス	5.6	5.9	12,985	
コナカ	20	21.2	7,123	
ハウス オブ ローゼ	2.3	2.5	4,175	
G-7ホールディングス	8.4	21.4	30,794	
イオン北海道	22.6	28.1	29,982	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
コジマ	29.7	33.3	21,445	
ヒマラヤ	6.3	6.5	6,142	
コーナン商事	24.3	27.2	100,640	
エコス	6.5	6.7	13,554	
ワタミ	22.4	23.1	22,014	
マルシェ	4.5	6.2	2,982	
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	340.3	381.2	750,964	
西松屋チェーン	37.6	39.3	57,810	
ゼンショーホールディングス	91.5	93.1	281,162	
幸楽苑ホールディングス	10.8	11.4	14,523	
ハークスレイ	4	8.6	4,678	
サイゼリヤ	25.4	28.4	68,756	
VTホールディングス	64.9	72.5	33,712	
魚力	5.5	5.4	12,717	
フジ・コーポレーション	9.3	10.4	12,240	
ユナイテッドアローズ	19.7	20.1	40,702	
ハイデイ日高	24.8	27.7	55,039	
YU-WA Creation Holdings	12.3	12.8	3,059	
コロワイド	56.5	78.3	138,982	
ピーシーデポコーポレーション	20.6	23.2	7,748	
壺番屋	12.1	13.5	66,757	
PLANT	4.9	5.1	3,294	
スギホールディングス	34	38.1	203,835	
薬王堂ホールディングス	7.6	9.7	19,215	
スクロール	24.7	29.8	25,091	
ヨンドシーホールディングス	15.9	16.8	29,064	
木曽路	22.4	25.7	53,764	
SRSホールディングス	22.4	27.5	23,870	
千趣会	—	35.3	14,155	
リテールパートナーズ	21	27.4	30,468	
ケーヨー	31.7	35.4	34,479	
上新電機	19.7	19.8	37,362	
日本瓦斯	84.3	92.8	181,980	
ロイヤルホールディングス	29.7	31.4	71,717	
いなげや	19.1	20.6	25,296	
チヨダ	18.2	17.5	12,512	
ライフコーポレーション	17.1	15.9	42,453	
リンガーハット	21	22.4	51,116	
MrMaxHD	24	24.4	15,250	
AOKIホールディングス	34.6	37.4	24,871	
オークワ	26.9	28.3	24,507	
コメリ	26.4	29.5	81,685	
青山商事	38.3	37.7	32,459	
しまむら	19.8	22.2	247,086	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
はせがわ	10.3	11.4		3,135
高島屋	124.1	131.9		170,282
松屋	37.4	34.4		27,726
エイチ・ツー・オー リテイリング	80.8	85.5		80,626
近鉄百貨店	6.6	6.2		15,543
丸井グループ	144	142.2		350,238
アクシアル リテイリング	14.2	13.5		41,580
イオン	654.8	663.6	1,582,686	
イズミ	34.6	31.6		88,416
平和堂	31.5	29.6		56,713
フジ	20.6	45.3		103,646
ヤオコー	19.3	21.7		142,352
ゼビオホールディングス	21	26.3		22,591
ケーズホールディングス	145.1	167		218,937
O l y m p i c グループ	9.3	9.4		5,959
日産東京販売ホールディングス	26.6	29.5		7,021
シルバーライフ	3.6	4.1		6,264
Genky DrugStores	7.6	8.5		28,687
ナルミヤ・インターナショナル ブックオフグループホールディングス	3.6	4.6		4,121
ブックオフグループホールディングス	9.9	11.1		10,989
ギフトホールディングス	2.3	3.2		6,966
アインホールディングス	24.8	24.2		139,634
元気寿司	4.9	5.5		14,025
ヤマダホールディングス	571	694.4		317,340
アークランドサカモト	26.9	30.1		45,089
ニトリホールディングス	67.5	75.7		971,609
グルメ杵屋	12.5	15.5		16,569
愛眼	13.6	13.9		2,641
ケーユーホールディングス	9.3	10.3		11,803
吉野家ホールディングス	56.1	66.7		161,480
松屋フーズホールディングス	8.3	9.3		35,898
サガミホールディングス	24.4	28.2		33,473
関西フードマーケット	13.2	16.9		21,378
王将フードサービス	11.3	12.6		80,388
プレナス	19.3	21.5		42,118
ミニストップ	12.7	14.3		20,234
アークス	32.6	34.8		68,625
パローホールディングス	34.9	40.2		76,259
ベルク	8.5	8.5		44,625
大庄	9.5	10.5		11,991
ファーストリテイリング	22.8	25.5	1,570,800	
サンドラッグ	64.1	71.8		202,260
サックスパー ホールディングス	15.1	18.5		10,952
ヤマザワ	4.2	4.3		6,462
やまや	3.5	3.9		9,792

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)		
ベルーナ		36.9		41.4	27,613
銀行業(5.2%)					
島根銀行		5.9		6.1	3,251
じもとホールディングス		11.5		12.9	7,443
めぶきフィナンシャルグループ		885.4		828.8	205,542
東京きらぼしフィナンシャルグループ		21.4		22.7	43,720
九州フィナンシャルグループ		348		352.6	133,988
ゆうちょ銀行		482.7		450.5	447,346
富山第一銀行		40.6		43.5	17,226
コンコルディア・フィナンシャルグループ		1,038.1		993.2	436,014
西日本フィナンシャルホールディングス		111.3		106.3	80,256
三十三フィナンシャルグループ		14.7		16.1	22,137
第四北越フィナンシャルグループ		27.7		28.3	71,599
ひろぎんホールディングス		251.3		256.5	156,465
おきなわフィナンシャルグループ		—		16.5	34,963
十六フィナンシャルグループ		—		23.4	53,281
北國フィナンシャルホールディングス		—		16.8	70,476
プロクレアホールディングス		—		19.7	36,819
新生銀行		138.9		124.5	243,148
あおぞら銀行		101.5		106.6	286,114
三菱UFJフィナンシャル・グループ		11,656.2		11,437.2	8,444,084
りそなホールディングス		1,966.4		2,067.5	991,366
三井住友トラスト・ホールディングス		322.1		330.7	1,292,375
三井住友フィナンシャルグループ		1,179.2		1,266	5,039,946
千葉銀行		568.7		571.6	382,972
群馬銀行		350.7		324.1	114,731
武蔵野銀行		25.4		25.7	45,180
千葉興業銀行		43.4		42.4	11,066
筑波銀行		70.8		74.4	13,615
七十七銀行		53.5		53.7	91,128
青森銀行		13.2		—	—
秋田銀行		10.2		11.7	17,924
山形銀行		19.1		18.5	15,244
岩手銀行		11.2		11.9	23,800
東邦銀行		152.4		144.1	28,675
東北銀行		8.2		8.8	8,641
みちのく銀行		10.9		—	—
ふくおかフィナンシャルグループ		153.8		145.5	325,920
静岡銀行		415		417.2	315,820
十六銀行		21.4		—	—
スルガ銀行		149.4		167.3	60,060
八十二銀行		383.8		389	176,217
山梨中央銀行		19.8		19.7	22,123
大垣共立銀行		33.7		34.3	59,819
福井銀行		14.6		15.6	20,576

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
北國銀行	15.8	—	—
清水銀行	7	7.2	10,677
富山銀行	3.3	3.1	5,890
滋賀銀行	34.2	32.7	86,949
南都銀行	24.8	27.1	53,739
百五銀行	153.3	167.9	54,567
京都銀行	61	62.3	350,126
紀陽銀行	60.3	59.3	83,553
ほくほくフィナンシャルグループ	113.4	110.9	88,387
山陰合同銀行	107.4	108.5	71,176
中国銀行	146.6	144.7	135,149
鳥取銀行	5.4	6.1	7,448
伊予銀行	225.8	227	143,237
百十四銀行	18.1	18.5	32,134
四国銀行	24.2	26.4	21,463
阿波銀行	26.1	26.6	54,210
大分銀行	9.8	10.5	18,322
宮崎銀行	10.6	10.9	22,039
佐賀銀行	9.7	10.3	14,595
沖縄銀行	15.6	—	—
琉球銀行	37	41.4	32,333
セブン銀行	569.3	566.8	138,299
みずほフィナンシャルグループ	2,315.4	2,339.1	3,581,162
高知銀行	6.2	6.3	4,693
山口フィナンシャルグループ	212.7	201.2	145,870
長野銀行	5.6	6	7,530
名古屋銀行	13.7	12.4	38,068
北洋銀行	256.9	255.7	56,765
愛知銀行	5.7	6.2	31,310
中京銀行	6.1	6.2	10,087
大光銀行	5.8	6	7,578
愛媛銀行	23.8	25.5	20,935
トマト銀行	6.6	6.1	6,106
京葉銀行	72.7	79.6	36,616
栃木銀行	82.3	87.8	23,267
北日本銀行	5.3	5.7	8,914
東和銀行	29.9	32	16,416
福島銀行	19.5	20.7	4,595
大東銀行	8.2	8.6	5,598
トモニホールディングス	131.7	141	43,569
フィデアホールディングス	165.4	17.4	22,080
池田泉州ホールディングス	195.9	208.2	38,517
証券、商品先物取引業(0.7%)			
F P G	57.6	64.5	62,758
ジャパンインベストメントアドバイザー	11.6	15	19,305

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
マーキュリアインベストメント	6.9	—	—
マーキュリアホールディングス	—	9.8	6,174
S B I ホールディングス	210	235.7	618,712
ジャフコ グループ	26.2	73.1	116,082
大和証券グループ本社	1,276.5	1,361.6	860,803
野村ホールディングス	2,602	2,914.3	1,477,550
岡三証券グループ	145.7	142.5	49,875
丸三証券	50.9	57.2	28,256
東洋証券	57.6	60.7	11,593
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	182.2	199	75,023
光世証券	4.4	4.5	2,052
水戸証券	46.2	49	13,132
いちよし証券	34.5	34.4	21,775
松井証券	83.7	93.7	77,958
マネックスグループ	153.1	159.5	80,069
極東証券	23.1	23.3	15,471
岩井コスモホールディングス	17.6	18.2	22,313
アイザワ証券グループ	30.8	28	19,572
マネーパートナーズグループ	19.1	21.4	5,029
スパークス・グループ	79.5	89.1	23,700
保険業(2.2%)			
かんぽ生命保険	211.2	192.1	413,591
SOMPOホールディングス	300.4	285.5	1,632,203
アニコム ホールディングス	47.9	58.6	40,023
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	413.8	404.2	1,622,054
第一生命ホールディングス	900.2	908.7	2,355,350
東京海上ホールディングス	561.2	558.3	4,112,437
T & Dホールディングス	509.3	448.2	660,198
アドバンスクリエイト	8.1	9.1	8,845
その他金融業(1.2%)			
全国保証	44.4	45.6	197,220
あんしん保証	—	9.2	2,511
イントラスト	5.2	8.9	4,975
日本モーゲージサービス	9	11.1	11,122
C a s a	5	7.3	6,241
アルヒ	25.3	28.7	27,810
プレミアグループ	8	9.8	40,180
ネットプロテクションズホールディングス	—	58.7	35,924
クレディセゾン	99.7	115.4	177,600
芙蓉総合リース	17.9	17.7	133,104
みずほリース	26.4	25.7	79,541
東京センチュリー	39.6	32.1	139,956
日本証券金融	72.4	75.5	66,440
アイフル	286.7	321.6	113,203

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
リコーリース	13.5	17	59,075	
イオンフィナンシャルサービス	104.5	104.2	126,603	
アコム	343	377.9	124,329	
ジャックス	18.9	19.8	67,518	
オリエントコーポレーション	462.7	519.9	66,547	
オリックス	1,034.6	1,134	2,791,908	
三菱HCキャピタル	589.8	647	405,669	
九州リースサービス	8.8	9.4	5,358	
日本取引所グループ	460.4	455.4	941,539	
イー・ギャランティ	19.7	28.4	62,366	
アサックス	9.2	10.7	6,708	
NECキャピタルソリューション	7.1	8	15,808	
不動産業(2.0%)				
いちご	194.1	218.4	68,577	
日本駐車場開発	196.8	206.5	33,453	
スター・マイカ・ホールディングス	10.2	11.6	17,690	
SREホールディングス	2.8	5.9	11,180	
ADワークスグループ	34.2	35.9	5,385	
ヒューリック	362.7	430.5	465,801	
三栄建築設計	7.6	8.8	14,660	
野村不動産ホールディングス	104.1	99.3	325,704	
三重交通グループホールディングス	37.6	42.4	20,691	
サムティ	25	29.8	60,017	
ディア・ライフ	25.2	27.2	14,552	
地主	11.6	12.9	27,373	
プレサンスコーポレーション	28.9	23.4	36,387	
ハウスコム	4.2	4.8	5,212	
日本管理センター	10.4	10.9	11,216	
サンセイランディック	6.8	7.7	6,853	
フージャースホールディングス	27.8	24.4	19,593	
オープンハウスグループ	54.4	61	335,500	
東急不動産ホールディングス	465.6	536	365,552	
飯田グループホールディングス	142.6	160.1	326,604	
イーランド	4.3	4.1	5,965	
ムゲンエステート	13.5	15.4	7,777	
And Doホールディングス	8.4	9.4	8,497	
シーアールイー	5.5	7.7	12,381	
ケイアイスター不動産	—	8.9	44,678	
グッドコムアセット	9.2	9.8	11,730	
ジェイ・エス・ビー	3.6	4.4	15,576	
ロードスターキャピタル	—	6.1	8,802	
テンポイノベーション	6.6	7.4	6,586	
フェイスネットワーク	2.5	3.8	5,065	
パーク24	92.1	113.9	236,342	
パラカ	5.3	6.4	11,808	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
三井不動産	777.2	788.5	2,254,715	
三菱地所	1,120.2	1,143.5	2,253,838	
平和不動産	29.5	31.6	121,344	
東京建物	169.2	172.8	309,312	
ダイビル	44.4	—	—	
京阪神ビルディング	30.5	27.9	35,126	
住友不動産	383.4	362.8	1,309,345	
テーオーシー	35.5	33.5	20,904	
東京楽天地	3.2	3.3	13,084	
スターツコーポレーション	20.8	26.7	64,533	
フジ住宅	22.2	24.9	16,434	
空港施設	19.5	22.5	12,262	
明和地所	10.5	12	7,320	
ゴールドクレスト	16.2	16.1	27,337	
エスリード	7.6	8.5	14,892	
日神グループホールディングス	28.4	35	16,100	
日本エスコン	30.9	35.5	27,477	
タカラレーベン	71.4	80	26,800	
AVANTIA	10.5	11.4	9,667	
イオンモール	86.3	96.8	154,686	
毎日コムネット	8	9.1	6,388	
ファースト住建	8.5	8.7	9,778	
カチタス	42.7	47.9	144,179	
トーセイ	24.9	27.9	32,224	
穴吹興産	4.4	5	11,750	
サンフロンティア不動産	22.6	28.1	30,376	
FJネクストホールディングス	18.2	20.4	21,930	
インテリックス	3.8	4.3	2,653	
ランドビジネス	7.2	7	1,659	
サンネクスタグループ	6.9	7.6	8,892	
グランディハウス	15.1	16.4	8,741	
日本空港ビルディング	59.5	65.6	351,616	
サービス業(5.4%)				
明豊ファシリティワークス	7.9	9	5,841	
日本工営	10.4	11.9	37,068	
LIFULL	51.2	58.5	10,354	
ミクシィ	42.1	42.5	91,120	
ジェイエイシーリクルートメント	11.5	15.1	27,844	
日本M&Aセンターホールディングス	270.9	303.5	461,927	
メンバーズ	5	5.2	15,990	
中広	3	3.9	1,540	
UTグループ	23.9	26.8	65,606	
アイティメディア	5.7	9	16,407	
タケエイ	18.6	—	—	
E・Jホールディングス	8.9	10.9	12,589	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
夢真ビーネックスグループ	44.1	60.5	89,177	
コシダカホールディングス	44.6	49.9	38,672	
アルトナー	4.3	4.9	4,160	
パソナグループ	18	20.2	42,420	
CDS	4.3	4.8	10,464	
リンクアンドモチベーション	30.3	40.8	18,645	
GCA	21.9	—	—	
エス・エム・エス	56.2	63	186,102	
サニーサイドアップグループ	6.1	7	4,403	
パーソルホールディングス	165.2	185	467,495	
リニカル	9.7	10.8	9,450	
クックパッド	52.9	59.7	13,432	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8.4	9.6	5,827	
学情	6	7.9	7,552	
スタジオアリス	8.4	8.4	19,093	
シミックホールディングス	9.3	9.7	14,132	
エプコ	4.3	4.4	3,207	
NJS	4.2	4.3	9,030	
総合警備保障	65.7	69.6	248,820	
カカクコム	122	135.8	346,018	
アイロムグループ	5.9	6.7	13,078	
セントケア・ホールディング	12.3	12.5	10,287	
サイネックス	3.2	3.7	2,186	
ルネサンス	10.6	13.2	12,434	
ディップ	25.9	32.6	123,717	
デジタルホールディングス	11.6	13.2	17,595	
新日本科学	20.5	22.7	38,272	
キャリアデザインセンター	4.4	4.4	4,879	
ベネフィット・ワン	60.2	67.5	136,755	
エムスリー	291.3	326.4	1,219,756	
ツカダ・グローバルホールディング	13.1	11.8	4,023	
アウトソーシング	94.7	106.3	123,095	
ウェルネット	17.2	17.8	8,882	
ワールドホールディングス	5.8	7.6	17,882	
ディー・エヌ・エー	70	70.6	131,527	
博報堂DYホールディングス	229.9	242.1	316,666	
ぐるなび	29.2	28.9	12,455	
タカミヤ	20.5	23.4	8,845	
ジャパンベストレスキューシステム	11.2	11.1	9,024	
ファンコミュニケーションズ	46.1	44	18,040	
ライク	4.5	6.3	13,488	
ビジネス・ブレイクスルー	7.5	7.7	3,334	
エスブール	42.7	52.5	64,627	
WDBホールディングス	7.6	8.6	20,201	
手間いらず	2.1	—	—	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ティア	10.2	11.6	5,370	
CDG	1.7	2.3	2,957	
アドウェイズ	27.1	28.2	20,134	
パリュエコマース	11.2	14.6	46,939	
インフォマート	167.3	203.4	103,327	
J Pホールディングス	48.1	49.2	11,168	
エコナックホールディングス	32.9	36.3	3,303	
E P Sホールディングス	25	—	—	
CLホールディングス	4.2	4.3	4,360	
プレステージ・インターナショナル	62.3	69.9	44,945	
アミューズ	9.1	10.2	22,236	
ドリームインキュベータ	5.3	5.6	13,423	
クイック	10.5	12.1	17,230	
TAC	10.1	11.6	2,726	
電通グループ	185.7	179.1	774,607	
イオンファンタジー	6.5	7.3	18,140	
シーティーエス	18.9	21.3	18,467	
ネクシィーズグループ	6.1	6.6	3,451	
H. U. グループホールディングス	46.3	48.5	127,943	
アルプス技研	14.7	15.4	28,844	
ダイオーズ	3.5	4	4,312	
日本空調サービス	17.7	19.8	15,998	
オリエンタルランド	175.6	204	4,019,820	
ダスキン	38.4	41	111,684	
明光ネットワークジャパン	19.9	22.3	13,469	
ファルコホールディングス	8	8.5	18,691	
ラウンドワン	56.5	51.8	80,134	
リゾートトラスト	75.8	80.6	172,242	
ビー・エム・エル	21.3	23.6	82,010	
りらいあコミュニケーションズ	25.3	27.6	31,105	
リソー教育	84.7	85.5	29,412	
早稲田アカデミー	7.3	10.6	12,667	
ユー・エス・エス	185	207.2	504,532	
東京個別指導学院	15	16.9	10,376	
サイバーエージェント	407	415.5	582,531	
楽天グループ	770.7	889.2	662,454	
クリーク・アンド・リバー社	8.8	9.9	21,027	
モーニングスター	24.7	33	17,919	
テー・オー・ダブリュー	29.7	36.4	12,558	
山田コンサルティンググループ	9.8	9.9	11,612	
セントラルスポーツ	6.3	7	17,500	
フルキャストホールディングス	14.2	15.9	36,554	
エン・ジャパン	29.4	32.1	63,172	
リソルホールディングス	1.9	2.1	9,702	
テクノプロ・ホールディングス	33	110.9	335,472	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アトラグループ	3.8	4.1	832
インターワークス	5.4	6.3	2,444
アイ・アールジャパンホールディングス	6.7	8.7	39,367
KeepEr 技研	10.7	12	38,760
ファーストロジック	3.6	3.6	2,718
三機サービス	3.4	3.5	3,885
Gunosy	10.6	10.6	9,253
デザインワン・ジャパン	5.3	7.2	1,332
イー・ガーディアン	6.8	6.8	20,230
リブセンス	10.3	12.4	2,021
ジャパンマテリアル	51	57.1	103,864
ベクトル	20.9	26.2	29,868
ウチヤマホールディングス	8.9	10.3	3,213
チャーム・ケア・コーポレーション	12.5	14.1	15,947
キャリアリンク	5.5	7	14,742
I B J	13.8	15.7	11,853
アサンテ	6.1	8.4	12,768
バリューHR	6.7	15.9	20,320
M&Aキャピタルパートナーズ	13.6	15.4	53,438
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.6	7.5	9,097
ERIホールディングス	5.1	5.4	7,263
アビスト	2.7	3	8,781
シグマクス・ホールディングス	9.2	22.6	27,097
ウィルグループ	12.4	14	16,758
エスクロー・エージェント・ジャパン	25.6	23.2	3,781
メドピア	12.8	13.6	29,158
レアジョブ	3.2	4.2	2,343
リクルートホールディングス	1,182.6	1,358.6	6,377,268
エラン	23	25.8	28,018
土木管理総合試験所	8.8	9.7	3,220
ネットマーケティング	8.7	9.5	6,612
日本郵政	1,249.3	2,213.8	2,115,507
ベルシステム24ホールディングス	27.8	26.8	39,235
鎌倉新書	16.9	21.7	12,260
SMN	3.9	4.6	2,819
グローバルキッズCOMPANY	3.3	3.6	2,419
エアトリ	10.3	11.2	32,995
アトラエ	11.6	13.1	23,973
ストライク	6.3	7.9	30,059
ソラスト	40.7	46	33,028
セラク	5.3	6.2	7,154
インソース	16.1	19.8	45,124
ペイカレント・コンサルティング	10.8	13.1	550,855
Orchestra Holdings	3.8	3.7	9,982
アイモバイル	4.9	8.1	11,826

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
キャリアインデックス	7.2	7	3,689
MS-Japan	7	8	6,880
船場	3.6	4.2	2,889
グレイステクノロジー	16.9	—	—
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	47.7	58.9	92,296
フルテック	2.5	2.9	3,926
グリーンズ	6.2	—	—
GameWith	5.4	6.3	2,942
ソウルドアウト	4.1	—	—
MS&Consulting	3.1	3.2	2,393
ウエルビー	6.3	12.5	10,862
エル・ティー・エス	1.7	2.5	9,575
ミダックホールディングス	3.6	8.5	24,412
日総工産	13.3	15	9,300
キュービーネットホールディングス	7.7	8.8	11,906
RPAホールディングス	19.6	27.1	10,704
スプリックス	4.9	6.3	6,520
マネジメントソリューションズ	8.2	9.2	45,862
プロレド・パートナーズ	3.1	4.7	2,641
テノ・ホールディングス	2	2.8	1,974
フロンティア・マネジメント	3.9	5.1	7,175
ピアラ	1.4	3.4	2,944
コプロ・ホールディングス	2.4	4	3,672
ギークス	3	3.6	3,128
カープスホールディングス	45.6	51.3	36,525
フォーラムエンジニアリング	11.7	12.2	11,797
Fast Fitness Japan	—	3.6	6,624
ダイレクトマーケティングミックス	8.9	19.9	36,038
ポピンズ	4.4	4.5	9,540
LITALICO	6.7	15.1	38,278
アドバンテッジリスクマネジメント	8.7	10.1	5,181
リロググループ	90.4	101.3	215,667
東祥	10.4	14.1	18,950
ビーウィズ	—	5.2	7,337
TREホールディングス	—	31.8	72,631
人・夢・技術グループ	—	7.5	18,525
エイチ・アイ・エス	25.8	39.4	93,062
ラックランド	4.8	5.7	17,356
共立メンテナンス	27.4	33.1	166,493
イチネンホールディングス	17.4	19.2	24,019
建設技術研究所	10.7	10.1	24,421
スペース	11	12.8	11,878
長大	6.7	—	—
燦ホールディングス	7.4	8.2	15,899

銘柄	当 期 首 (前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
スバル興業	1	1.1	9,493	
東京テアトル	6.4	6.9	8,576	
タナベ経営	3.4	7.6	5,327	
ナガワ	5.3	5.4	48,654	
東京都競馬	10.9	13.9	52,264	
カナモト	29.2	31.2	59,779	
西尾レントオール	15.3	16.1	44,516	
トランス・コスモス	15.8	23.6	82,128	
乃村工藝社	71.1	79.6	74,187	
藤田観光	6.5	8.1	20,565	
KN T-C Tホールディングス	8.8	11.5	20,665	
日本管財	17.8	19.9	52,635	
トーカイ	16.1	15.4	25,979	
セコム	162.7	182.2	1,538,861	
セントラル警備保障	8	9.1	20,839	
丹青社	31.5	36.3	30,274	
メイテック	20	22	154,660	
応用地質	18.8	18.9	33,358	
船井総研ホールディングス	33.9	35.9	76,143	
進学会ホールディングス	7.1	7	2,597	
オオバ	11.9	12.4	9,262	
いであ	4.2	4.9	8,820	
学究社	5	6.2	10,168	
ベネッセホールディングス	60.6	61.8	129,223	
イオンディライト	20.4	21.4	60,797	
ナック	8.1	9.1	8,836	
ダイセキ	27.7	33.8	154,635	
ステップ	6.2	7	12,754	
合 計	株 数 ・ 金 額	181,054	201,473	488,516,185
	銘柄数<比率>	2,114	2,102	<98.3%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >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 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	9,617	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	488,516,185	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,712,064	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	502,228,249	100.0

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 2022年5月30日現在
(A)資 産	502,188,455,124円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,696,630,134
株 式(評価額)	488,516,185,770
未 収 入 金	4,153,568,703
未 収 配 当 金	5,495,605,067
差 入 委 託 証 拠 金	326,465,450
(B)負 債	4,974,551,491
未 払 金	4,956,801,164
未 払 解 約 金	17,747,094
未 払 利 息	3,233
(C)純 資 産 総 額(A-B)	497,213,903,633
元 本	261,899,870,077
次 期 繰 越 損 益 金	235,314,033,556
(D)受 益 権 総 口 数	261,899,870,077口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,985円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	11,577,303,389円
受 取 配 当 金	11,575,474,978
受 取 利 息	21,631
そ の 他 収 益 金	3,243,816
支 払 利 息	△1,437,036
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△135,113,539
売 買 益	41,187,525,426
売 買 損	△41,322,638,965
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△118,602,600
取 引 益	811,597,550
取 引 損	△930,200,150
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	11,323,587,250
(E)前 期 繰 越 損 益 金	213,332,602,374
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	31,763,096,628
(G)解 約 差 損 益 金	△21,105,252,696
(H)計 (D+E+F+G)	235,314,033,556
次 期 繰 越 損 益 金(H)	235,314,033,556

(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) (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3) (G) 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249,503,103,457円、期中追加設定元本額は35,776,873,459円、期中一部解約元本額は23,380,106,839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。

SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,649,424,599円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,408,751,306円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,949,549,876円
DCマイセレクション50	18,942,593,551円
DCマイセレクション75	18,879,688,062円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,780,801,499円
DCマイセレクションS50	9,073,586,435円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,361,740,808円
DCマイセレクションS75	6,906,288,752円
DCマイセレクション25	6,244,084,567円
DC日本株式インデックス・オープン	6,208,866,136円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,319,372,568円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,987,438,501円
世界経済インデックスファンド	3,846,566,064円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
DC世界経済インデックスファンド	3,590,618,326円
日本株式インデックス・オープン	3,329,539,157円
DCマイセレクションS25	3,101,188,895円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,827,592,622円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,062,924,464円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,560,290円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,794,542,708円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,762,760,621円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,141,170,962円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	939,963,074円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	914,590,374円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	703,995,649円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	586,687,036円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	558,843,487円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	515,581,834円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	485,200,127円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	477,819,397円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	436,434,928円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	419,000,801円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	402,198,610円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	351,054,666円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,996,082円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	278,407,466円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	263,400,284円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,603,259円
グローバル経済コア	218,176,100円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	197,036,199円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	192,767,573円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	186,418,998円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	175,219,707円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	113,885,822円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	104,463,510円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	74,211,525円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	58,692,527円
SMT インデックスバランス・オープン	57,855,547円

世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	55,807,407円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	51,288,288円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,605,223円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	35,139,857円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	31,659,093円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	31,325,672円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	27,485,982円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	26,007,286円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	25,967,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,626,792円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	21,158,127円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	19,058,334円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,307,969円
私募世界経済バッシブファンド(適格機関投資家専用)	13,443,001円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,178,371円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,191,188円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	10,489,027円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,690,813円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	5,155,303円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,206,394円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	3,350,367円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	2,356,825円

お知らせ

株式会社東京証券取引所の市場区分再編に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年4月4日)

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2022年4月5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2021年4月23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	わが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1万口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	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	円	期中騰落率	円	期中騰落率				
設定日(2021年4月23日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 399
第1期(2022年4月5日)	10,554	5.5	10,602	6.0	94.6	3.7	1.5	479

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)です。

MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数とは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)が開発した株価指数で、親指数(MSCI ジャパンIMI トップ700指数:時価総額上位700銘柄)構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc.、その関連会社、情報提供会社またはMSCI指数の編集または計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売または販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的または当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成または計算するにあたり、当ファンドの発行者または受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定または償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティングまたは募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務または責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数またはそのデータの獨創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数またはそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、またはその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売または販売促進するためにMSCIの商号、商標またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

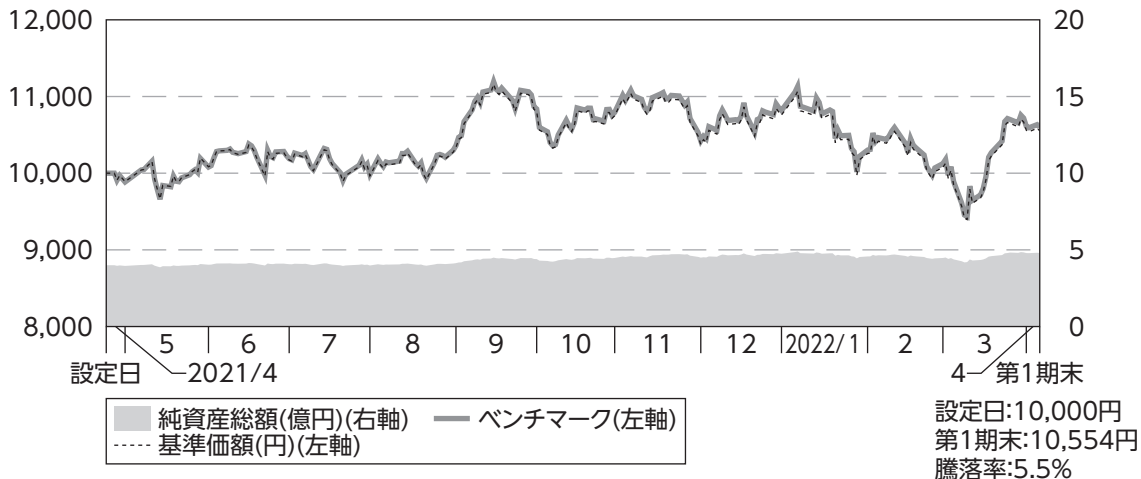
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託 証券組入比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
(設 定 日) 2021年 4月23日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% —	
4月末	9,890	△1.1	9,885	△1.2	98.1	—	—	1.3	
5月末	10,084	0.8	10,079	0.8	97.8	—	—	1.6	
6月末	10,172	1.7	10,189	1.9	97.7	—	—	1.7	
7月末	9,965	△0.4	9,984	△0.2	97.7	—	—	1.7	
8月末	10,335	3.4	10,360	3.6	97.6	—	—	1.8	
9月末	10,806	8.1	10,838	8.4	95.4	2.8	—	1.7	
10月末	10,749	7.5	10,792	7.9	96.5	1.8	—	1.7	
11月末	10,374	3.7	10,422	4.2	97.0	0.8	—	1.6	
12月末	10,759	7.6	10,817	8.2	96.7	1.7	—	1.6	
2022年 1月末	10,256	2.6	10,301	3.0	97.5	0.8	—	1.6	
2月末	10,077	0.8	10,125	1.2	98.0	0.4	—	1.5	
3月末	10,560	5.6	10,612	6.1	94.7	3.7	—	1.5	
(当 期 末) 2022年 4月 5日	10,554	5.5	10,602	6.0	94.6	3.7	—	1.5	

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

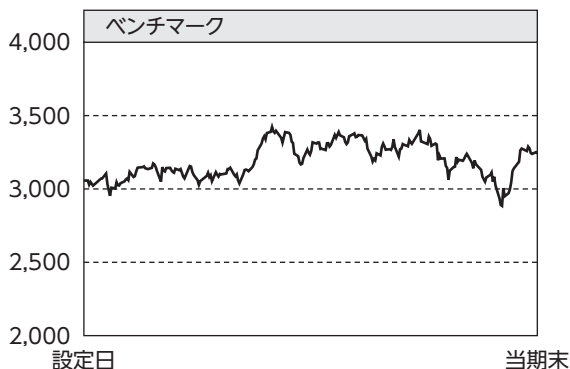


(注)ベンチマークは、2021年4月23日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、設定来では上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初は、堅調な米国株式市場が下支えとなった一方で、国内での新型コロナウイルス感染拡大に歯止めがかからず、緊急事態宣言が発出されたことなどから軟調に推移しました。9月に入ると、新政権による国内経済対策への期待感から大幅に上昇した後、中国大手不動産開発会社の債務問題やインフレ懸念の高まりなどから急落しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米国の金融引き締めへの警戒感、ウクライナを巡る地政学リスクの高まりなどから下落したものの、円安・米ドル高の進行などが好感され反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式および投資信託証券については、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

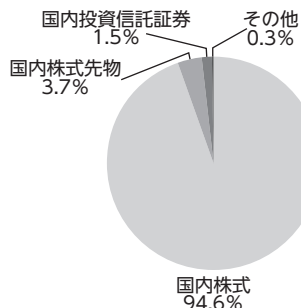
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	7.9%
2	ソニーグループ	日本	5.3%
3	キーエンス	日本	3.7%
4	ミニTOPIX先物 2206	日本	3.7%
5	任天堂	日本	2.6%
6	リクルートホールディングス	日本	2.6%

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	2.5%
8	信越化学工業	日本	2.3%
9	KDDI	日本	2.2%
10	日立製作所	日本	2.0%
組入銘柄数		216	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

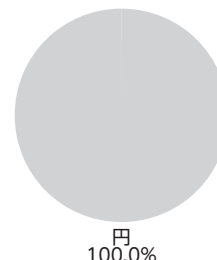
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

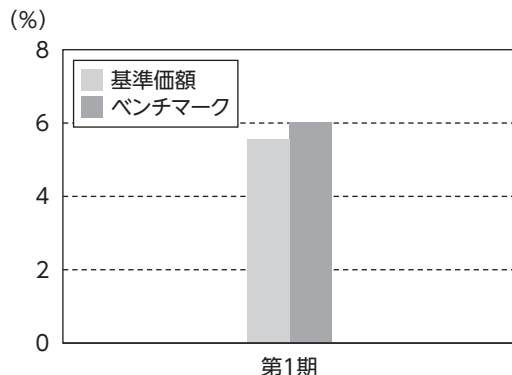


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.7%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。

差異の主な要因はファンドとベンチマークの個別銘柄保有比率の較差(マイナス)によるものです。

今後の運用方針

主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年4月23日~2022年4月5日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.003% (0.001) (-) (-) (-) (-) (-) (0.002)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.003	

(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(10,335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
国内	上 場	千株 146 (13)	千円 467,714 (-)	千株 11	千円 27,010

(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
国内	産業ファンド投資法人	3	596	—	—
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	350	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	3	1,056	—	—
	ヒューリックリート投資法人	2	343	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	7	1,188	—	—
	日本ビルファンド投資法人	2	1,393	—	—
	日本都市ファンド投資法人	11	1,136	—	—
	オリックス不動産投資法人	4	760	—	—
内	日本プライムリアルティ投資法人	1	411	—	—
	ジャパンエクセレント投資法人	2	289	—	—

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

<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
国内	株式先物取引	百万円 94	百万円 75	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	494,724千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	421,240千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.17

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 2,060	百万円 19	% 0.9	百万円 2,047	百万円 18	% 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	1百万円	1百万円	1百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当 期 末		
	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
マルハニチロ	0.1		241
鉱業(0.5%)			
I N P E X	1.6		2,380
建設業(2.4%)			
コムシスホールディングス	0.2		528
大成建設	0.3		1,053
大林組	1		905
清水建設	0.9		661
鹿島建設	0.7		1,041
戸田建設	0.4		300
住友林業	0.2		426
大和ハウス工業	0.9		2,856
積水ハウス	1		2,372
エクシオグループ	0.2		458
高砂熱学工業	0.1		174
食料品(3.0%)			
サッポロホールディングス	0.1		232
アサヒグループホールディングス	0.7		3,131
キリンホールディングス	1.3		2,369
サントリー食品インターナショナル	0.2		947
不二製油グループ本社	0.1		200
キッコーマン	0.2		1,632
味の素	0.8		2,760
キュービー	0.2		471
ハウス食品グループ本社	0.1		294
ニチレイ	0.2		479
日清食品ホールディングス	0.1		874
繊維製品(0.4%)			
東洋紡	0.1		108
帝人	0.3		408
東レ	2.2		1,390
パルプ・紙(0.1%)			
日本製紙	0.2		207
レンゴー	0.3		231
化学(8.6%)			
クラレ	0.5		518
旭化成	2		2,112
住友化学	2.4		1,312
信越化学工業	0.6		11,109
カネカ	0.1		356
三井化学	0.3		921

銘柄	当 期 末		
	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東京応化工業	0.1		722
三菱ケミカルホールディングス	2.1		1,684
ダイセル	0.4		322
積水化学工業	0.6		1,042
UBE	0.2		394
日本化薬	0.2		231
花王	0.8		4,045
関西ペイント	0.3		617
D I C	0.1		254
東洋インキS Cホールディングス	0.1		195
富士フイルムホールディングス	0.6		4,492
資生堂	0.6		3,868
日東電工	0.2		1,756
ニフコ	0.1		277
ユニ・チャーム	0.6		2,692
医薬品(6.0%)			
協和キリン	0.4		1,129
アステラス製薬	3		5,626
住友ファーマ	0.3		372
塩野義製薬	0.4		2,982
中外製薬	1.1		4,511
エーザイ	0.4		2,352
小野薬品工業	0.6		1,867
参天製薬	0.6		735
第一三共	2.8		7,691
石油・石炭製品(0.5%)			
E N E O Sホールディングス	4.9		2,236
ガラス・土石製品(0.5%)			
T O T O	0.2		949
日本碍子	0.4		688
日本特殊陶業	0.2		391
ニチアス	0.1		254
鉄鋼(0.1%)			
日立金属	0.3		612
非鉄金属(0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	0.1		171
三菱マテリアル	0.2		428
住友金属鉱山	0.4		2,510
D O W Aホールディングス	0.1		567
機械(5.8%)			
三浦工業	0.1		301
タクマ	0.1		146

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ナブテスコ	0.2	671
小松製作所	1.4	4,083
日立建機	0.2	629
クボタ	1.7	3,864
荏原製作所	0.2	1,314
ダイキン工業	0.4	8,816
栗田工業	0.2	913
ダイフク	0.2	1,742
グローリー	0.1	210
セガサミーホールディングス	0.3	660
ホシザキ	0.1	856
NTN	0.6	127
日立造船	0.3	221
三菱重工業	0.5	1,962
電気機器 (23.3%)		
日清紡ホールディングス	0.2	207
イビデン	0.2	1,202
コニカミノルタ	0.7	354
日立製作所	1.6	9,830
三菱電機	2.9	4,036
安川電機	0.4	1,882
オムロン	0.3	2,381
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.1	235
日本電気	0.4	2,100
富士通	0.3	5,641
アルバック	0.1	619
パナソニック ホールディングス	3.6	4,305
アンリツ	0.2	323
ソニーグループ	2	25,430
TDK	0.6	2,637
ヒロセ電機	0.1	1,766
日本航空電子工業	0.1	197
横河電機	0.4	827
アズビル	0.2	834
日本光電工業	0.1	304
キーエンス	0.3	17,631
シスメックス	0.3	2,805
スタンレー電気	0.2	451
ウシオ電機	0.2	358
村田製作所	0.9	7,191
東京エレクトロン	0.2	12,114
輸送用機器 (10.0%)		
デンソー	0.7	5,388
川崎重工業	0.2	436
トヨタ自動車	17.1	37,919
日野自動車	0.5	355

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ヤマハ発動機	0.5	1,361
精密機器 (1.4%)		
テルモ	1	3,814
島津製作所	0.4	1,722
ニコン	0.5	653
シチズン時計	0.4	195
その他製品 (3.5%)		
大日本印刷	0.4	1,140
アシックス	0.2	461
ヤマハ	0.2	1,068
リンテック	0.1	242
任天堂	0.2	12,650
コクヨ	0.1	164
電気・ガス業 (1.1%)		
中部電力	1	1,240
中国電力	0.5	433
九州電力	0.6	495
レノバ	0.1	177
東京瓦斯	0.6	1,324
大阪瓦斯	0.6	1,232
東邦瓦斯	0.1	278
陸運業 (3.8%)		
東武鉄道	0.3	890
相鉄ホールディングス	0.1	226
東急	0.8	1,284
小田急電鉄	0.5	1,027
京王電鉄	0.2	977
東日本旅客鉄道	0.5	3,485
西日本旅客鉄道	0.3	1,511
西武ホールディングス	0.4	504
西日本鉄道	0.1	264
近鉄グループホールディングス	0.3	1,048
阪急阪神ホールディングス	0.4	1,404
南海電気鉄道	0.2	471
名古屋鉄道	0.3	625
山九	0.1	396
センコーグループホールディングス	0.2	180
日立物流	0.1	660
九州旅客鉄道	0.2	503
S Gホールディングス	0.5	1,169
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	804
海運業 (0.7%)		
日本郵船	0.3	3,000
情報・通信業 (6.9%)		
野村総合研究所	0.5	2,110
メルカリ	0.2	699

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
Zホールディングス	4.3	2,226
ネットワンシステムズ	0.1	302
B I P R O G Y	0.1	326
日本電信電話	2.1	7,595
KDD I	2.6	10,579
ソフトバンク	4.6	6,688
S C S K	0.3	659
卸売業(2.1%)		
アルフレッサ ホールディングス	0.3	521
TOKA Iホールディングス	0.2	174
シップヘルスケアホールディングス	0.1	206
日本ライフライン	0.1	109
伊藤忠商事	1.9	7,799
キャノンマーケティングジャパン	0.1	254
サンゲツ	0.1	153
スズケン	0.1	374
小売業(2.5%)		
ローソン	0.1	459
DCMホールディングス	0.2	214
丸井グループ	0.3	678
イオン	1.1	2,912
ケーズホールディングス	0.3	387
ヤマダホールディングス	1.1	422
ファーストリテイリング	0.1	6,251
銀行業(2.9%)		
りそなホールディングス	3.3	1,739
三井住友トラスト・ホールディングス	0.5	1,959
三井住友フィナンシャルグループ	2.1	8,162
千葉銀行	0.9	646
静岡銀行	0.7	582
山口フィナンシャルグループ	0.3	205
証券、商品先物取引業(0.6%)		
野村ホールディングス	4.9	2,541
保険業(3.8%)		
SOMPOホールディングス	0.5	2,595
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.7	2,684
第一生命ホールディングス	1.6	3,835
東京海上ホールディングス	1	6,847
T&Dホールディングス	0.9	1,441
その他金融業(1.2%)		
東京センチュリー	0.1	441
オリックス	2	4,773
不動産業(2.1%)		
ヒューリック	0.6	666
野村不動産ホールディングス	0.2	600
東急不動産ホールディングス	1	666

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
三井不動産	1.5	3,966
三菱地所	1.9	3,502
サービス業(5.3%)		
総合警備保障	0.1	391
H. U. グループホールディングス	0.1	305
オリエンタルランド	0.3	6,919
ダスキン	0.1	276
テクノプロ・ホールディングス	0.2	690
リクルートホールディングス	2.2	12,421
乃村工藝社	0.1	97
セコム	0.3	2,662
ベネッセホールディングス	0.1	230
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	148 453,469 205 <94.6%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘 柄	当 期		末	
	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
産業ファンド投資法人	3	567	0.1	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	333	0.1	
日本プロロジスリート投資法人	3	1,080	0.2	
ヒューリックリート投資法人	2	338	0.1	
野村不動産マスターファンド投資法人	7	1,150	0.2	
日本ビルファンド投資法人	2	1,370	0.3	
日本都市ファンド投資法人	11	1,150	0.2	
オリックス不動産投資法人	4	674	0.1	
日本プライムリアルティ投資法人	1	405	0.1	
ジャパンエクセレント投資法人	2	271	0.1	
合 計	口 数 36	金 額 7,342		
	銘 柄 数 10	<比 率> <1.5%>		

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※当期末現在の保有銘柄のうち、当社または当社の利害関係人が資産運用会社または一般事務受託会社である投資法人

①資産運用会社

該当事項はありません。

②一般事務受託会社

以下の投資法人については、当社の利害関係人である三井住友信託銀行株式会社が一般事務受託会社となっております。

投資法人名	
産業ファンド投資法人	日本ビルファンド投資法人
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	オリックス不動産投資法人
日本プロロジスリート投資法人	

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘 柄 別	当 期		末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)		
国内	ミ ニ T O P I X 17			—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	453,469	94.5
投 資 証 券	7,342	1.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,854	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	479,665	100.0

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 2022年4月5日現在
(A)資 産	479,601,508円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,034,912
株 式(評価額)	453,469,390
投 資 証 券(評価額)	7,342,300
未 収 入 金	540,958
未 収 配 当 金	5,112,198
差 入 委 託 証 拠 金	101,750
(B)負 債	4,652
未 払 解 約 金	4,650
未 払 利 息	2
(C)純 資 産 総 額(A-B)	479,596,856
元 本	454,441,229
次 期 繰 越 損 益 金	25,155,627
(D)受 益 権 総 口 数	454,441,229口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,554円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年4月23日 至 2022年4月 5日
(A)配 当 等 収 益	9,767,987円
受 取 配 当 金	9,770,644
受 取 利 息	20
そ の 他 収 益 金	10
支 払 利 息	△2,687
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	12,581,527
売 買 益	40,178,707
売 買 損	△27,597,180
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△985,196
取 引 益	828,944
取 引 損	△1,814,140
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	21,364,318
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	3,856,882
(F)解 約 差 損 益 金	△65,573
(G) 計 (D+E+F)	25,155,627
次 期 繰 越 損 益 金(G)	25,155,627

(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) (E)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) (F)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399,800,000円、期中追加設定元本額は60,340,324円、期中一部解約元本額は5,699,095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。

DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	419,494,278円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド(適格機関投資家専用)	34,946,951円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30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2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の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割合には制限を設けません。

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1万口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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率						
第18期(2018年5月29日)	24,481	10.2	644.41	8.0	92.8	4.9	2.2	336,874		
第19期(2019年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	345,116		
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	399,725		
第21期(2021年5月31日)	37,583	45.3	934.05	43.2	95.3	2.5	2.2	517,603		
第22期(2022年5月30日)	41,948	11.6	1,023.64	9.6	94.1	3.7	2.3	523,424		

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(当期首) 2021年 5月31日	37,583	—	934.05	—	95.3	2.5	2.2		
6月末	38,524	2.5	954.04	2.1	95.3	2.4	2.2		
7月末	39,067	3.9	968.73	3.7	94.9	2.9	2.3		
8月末	40,031	6.5	989.82	6.0	95.4	2.3	2.3		
9月末	39,103	4.0	965.47	3.4	95.0	2.8	2.2		
10月末	41,963	11.7	1,032.76	10.6	96.3	1.4	2.3		
11月末	41,795	11.2	1,028.15	10.1	95.9	1.7	2.3		
12月末	43,503	15.8	1,070.07	14.6	95.1	2.6	2.3		
2022年 1月末	40,462	7.7	992.90	6.3	95.8	1.9	2.3		
2月末	40,194	6.9	987.99	5.8	95.3	2.5	2.2		
3月末	44,470	18.3	1,086.68	16.3	94.7	2.9	2.3		
4月末	42,568	13.3	1,036.73	11.0	95.5	2.1	2.5		
(当期末) 2022年 5月30日	41,948	11.6	1,023.64	9.6	94.1	3.7	2.3		

(注1) 騰落率は期首比です。

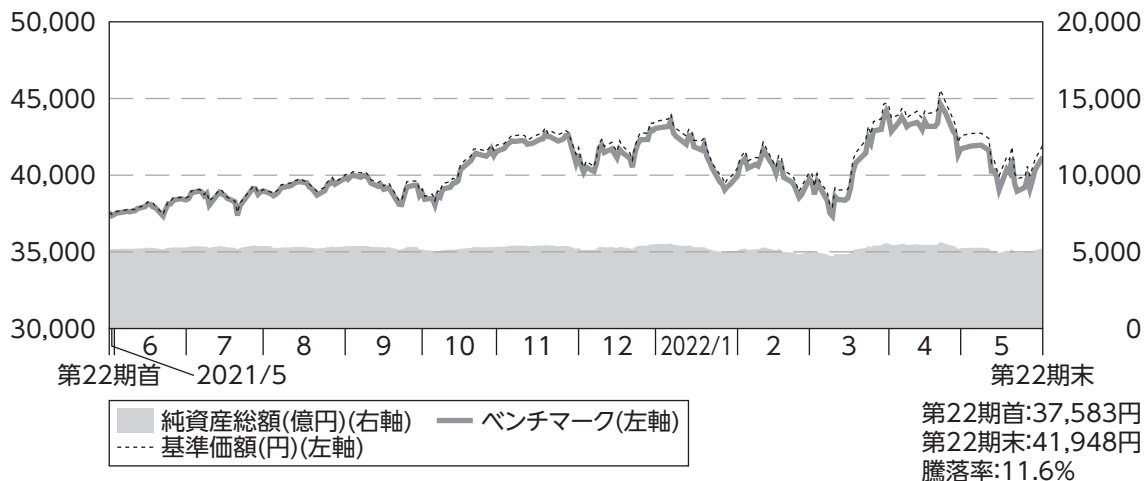
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

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、2021年5月31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MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展を背景に経済正常化への期待が高まったことや、概ね良好な企業決算、米国で年末商戦期の小売売上高が好調であったと報じられたことなどが好感され、2021年末にかけて上昇しました。その後は、FRB（米連邦準備理事会）やECB（欧州中央銀行）などの先行きの金融政策に対するタカ派的な姿勢が警戒されたことや、ロシアのウクライナ侵攻開始を受けた欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速が懸念されたことなどから下落しました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨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MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）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。

(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

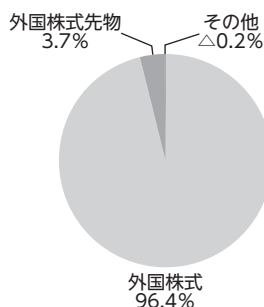
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	4.7%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.7%
3	S&P 500 EMIN 2206	アメリカ	2.7%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.0%
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
6	TESLA INC	アメリカ	1.2%

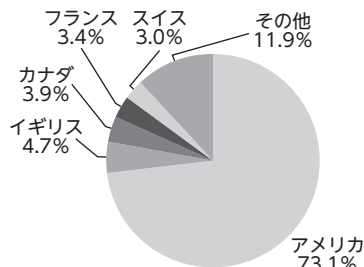
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
10	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
組入銘柄数			1,286

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

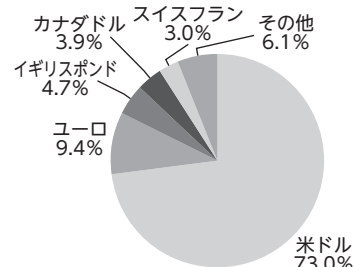
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

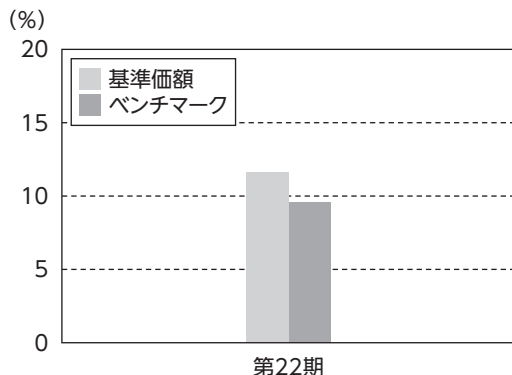


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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3.7%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、配当要因^{※1}および為替評価差要因^{※2}(いずれもプラス要因)です。

※1 ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

※2 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

今後の運用方針

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.002%	(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)	(0)	(0.001)	
(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)	(0)	(0.001)	
(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)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	12	0.029	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(11)	(0.028)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	13	0.031	

(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(40,771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	ア メ リ カ	百株 7,360 (757)	千米ドル 65,474 (5,594)	百株 30,095 (1,286)	千米ドル 358,515 (11,065)
	カ ナ ダ	571 (515)	千カナダドル 3,621 (1,892)	4,907 (-)	千カナダドル 21,189 (27)
	ド イ ツ	610 (1,125)	千ユーロ 1,282 (△77)	3,173	千ユーロ 12,402
	イ タ リ ア	- (-)	- (△3)	8,827	2,818
	フ ラ ン ス	76 (1,343)	216 (-)	4,251	14,251
	オ ラ ン ダ	543 (774)	4,552 (△10)	1,893	7,631
	ス ペ イ ン	- (19,703)	- (413)	4,139 (19,239)	3,400 (415)
	ベ ル ギ ー	86	474	172	1,190
	ル ク セ ン ブ ル ク	-	-	386	559
	フ ィ ン ラ ン ド	-	-	691	1,632
	ア イ ル ラ ン ド	-	-	122	832
	ポ ル ト ガ ル	-	-	212	212
	国	イ ギ リ ス	4,154 (3,740)	千イギリスポンド 820 (4,901)	36,870 (2,953)
ス イ ス		23 (125)	千スイスフラン 1,112 (203)	1,554 (33)	千スイスフラン 13,735 (441)
ス ウ ェ ー デ ン		1,011 (4,701)	千スウェーデンクローナ 27,797 (-)	4,964 (187)	千スウェーデンクローナ 48,121 (2,950)
ノ ル ウ ェ ー		61	千ノルウェークローネ 1,751	711	千ノルウェークローネ 10,486
デ ン マ ー ク		6	千デンマーククローネ 1,789	448	千デンマーククローネ 26,191
ロ シ ア		- (182)	千ロシアルーブル - (10,558)	- (182)	千ロシアルーブル - (10,558)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	2,065 (5,003)	千オーストラリアドル 10,031 (606)	10,531 (1,944)	千オーストラリアドル 14,752 (2,367)
	ニュージーランド	—	千ニュージーランドドル —	813	千ニュージーランドドル 875
	香 港	1,200 (430)	千香港ドル 4,073 (△79)	11,523	千香港ドル 31,025
	シンガポール	— (4,499)	千シンガポールドル — (548)	2,487 (4,499)	千シンガポールドル 1,553 (826)
	イスラエル	—	千イスラエルシェケル —	266	千イスラエルシェケル 1,602

(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
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES	—	—	1	198
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	20	586
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	—	—	30	253
PROLOGIS INC	—	—	5	763
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	0.693	153
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	1	152
DUKE REALTY CORP	—	—	4	215
CROWN CASTLE INTL CORP	—	—	3	630
ESSEX PROPERTY TRUST	—	—	0.74	257
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	—	4	420
WELLTOWER INC	—	—	2	246
KIMCO REALTY CORP	47	1,127	—	—
IRON MOUNTAIN INC	—	—	4	184
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	—	2	207
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	—	10	174
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	1	250
REALTY INCOME CORP	2 (12)	171 (851)	2	176
UDR INC	—	—	3	208
SIMON PROPERTY GROUP	—	—	2	398
PUBLIC STORAGE	—	—	1	449
VORNADO REALTY TRUST	—	—	4	176
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	1	254
VEREIT INC	— (△17)	— (△851)	3	149
AMERICAN TOWER CORPORATION	1	350	4	1,180
WP CAREY INC	—	—	2	180
INVITATION HOMES INC	—	—	4	187
ORION OFFICE REIT INC	— (4)	— (—)	4	73
EQUINIX INC	—	—	0.584	465
VICI PROPERTIES INC	31	921	5	172
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	—	1	338
小 計	83 (△1)	2,570 (—)	137	9,108

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	—	4	233
小 計	—	—	4	233
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	(—)	(△46)	—	—
GECINA SA	—	—	1	156
小 計	(—)	(△46)	1	156
ユ ー ロ 計	(—)	(△46)	1	156
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
SEGRO PLC	—	—	13	166
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	20	159
小 計	—	—	33	325
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
MIRVAC GROUP	—	—	126	361
APA GROUP	—	—	31	277
SYDNEY AIRPORT	—	—	124	1,083
GOODMAN GROUP	8	199	15	367
SCENTRE GROUP	—	—	104	313
小 計	8	199	401	2,403
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
HKT TRUST AND HKT LTD	—	—	170	1,789
小 計	—	—	170	1,789
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	(34)	(57)	120	248
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	(—)	(△7)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(10)	(12)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	(6)	(8)	6	8
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(—)	(△1)	—	—
小 計	(51)	(69)	127	256

(注1)金額は受渡金です。

(注2) ()内は合併・分割・減資・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。

<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 109,011	百万円 104,690	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	66,758,835千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	504,242,652千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.13

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 36,693	百万円 -	% -	百万円 88,134	百万円 61	% 0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン	207,987	5,004	2.4	207,929	4,859	2.3

(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
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
AMAZON.COM	369	357	82,290	10,452,551	小売
ABBOTT LABORATORIES	1,527	1,380	16,112	2,046,601	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	617	543	1,219	154,917	公益事業
ABIOMED INC	37	37	1,007	127,913	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	774	696	9,694	1,231,441	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,044	1,278	13,075	1,660,872	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	412	371	15,889	2,018,342	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	386	336	7,100	901,926	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	191	175	4,396	558,462	素材
ALLEGHANY CORP	12	9	755	95,976	保険
ALLSTATE CORP	264	230	3,161	401,570	保険
HONEYWELL INTL INC	599	536	10,533	1,337,951	資本財
AMGEN	497	440	11,242	1,428,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	248	227	2,808	356,728	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	594	514	8,731	1,109,077	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	441	381	3,946	501,275	公益事業
AFLAC	580	505	3,056	388,198	保険
AMERICAN INT'L GROUP	752	658	3,887	493,851	保険
AMERCO	10	7	368	46,799	運輸
ANALOG DEVICES	319	416	6,974	885,871	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	189	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VALERO ENERGY CORP	346	307	4,054	515,049	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	3,943	3,567	15,752	2,000,920	メディア・娯楽
ANSYS INC	74	67	1,797	228,360	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	14,508	12,844	192,207	24,414,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	794	713	8,527	1,083,105	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	101	94	2,557	324,851	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	483	429	3,821	485,350	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	107	—	—	—	公益事業
AMEREN CORPORATION	208	208	2,017	256,288	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	61	61	740	94,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	67	—	—	—	自動車・自動車部品
AUTODESK INC	189	174	3,692	468,979	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	367	327	7,364	935,477	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	19	16	3,368	427,902	小売
AVERY DENNISON CORP	74	66	1,152	146,380	素材
BALL CORP	279	256	1,887	239,795	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,183	1,019	32,544	4,133,793	各種金融
BANK NEW YORK CO	712	612	2,847	361,636	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	440	384	2,924	371,504	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	251	222	5,701	724,219	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMETEK INC	196	180	2,205	280,080	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	3,569	3,224	16,574	2,105,233	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	117	175	1,244	158,025	保険
BEST BUY COMPANY INC	198	181	1,526	193,898	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	18	18	1,014	128,805	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	258	226	2,711	344,380	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	457	411	1,787	227,036	公益事業
BOEING CO	476	432	5,718	726,353	資本財
ROBERT HALF INTL INC	95	95	854	108,591	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	197	197	785	99,824	自動車・自動車部品
BOSTON BEER COMPANY INC-A	7	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,236	1,128	4,647	590,318	ヘルスケア機器・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	112	112	1,213	154,116	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	97	89	1,128	143,357	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	20	18	2,398	304,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,930	1,727	13,156	1,671,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	377	332	2,231	283,426	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	63	63	873	110,948	保険
UNITED RENTALS INC	61	53	1,604	203,765	資本財
SEMPRA ENERGY	270	245	4,088	519,354	公益事業
FEDEX CORP	215	195	4,288	544,768	運輸
VERISIGN INC	87	77	1,373	174,466	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	514	459	3,280	416,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	262	240	1,597	202,957	食品・飲料・タバコ
SIRIUS XM HOLDINGS INC	995	604	385	49,002	メディア・娯楽
CSX CORP	658	1,731	5,549	704,875	運輸
COTERRA ENERGY INC	—	640	2,273	288,752	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	765	97,175	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	149	129	3,187	404,844	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	246	219	1,263	160,520	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	472	424	9,228	1,172,170	資本財
CHECK POINT SOFTWARE TECH	104	81	1,025	130,206	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	104	104	1,054	133,919	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	861	737	922	117,126	電気通信サービス
CERNER CORP	273	228	2,167	275,329	ヘルスケア機器・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,635	2,312	30,353	3,855,442	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	210	179	1,625	206,469	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	302	263	7,171	910,920	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	127	127	1,642	208,645	保険
CINTAS CORP	80	74	2,946	374,234	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,640	3,282	14,974	1,902,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	108	95	1,423	180,769	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,556	3,197	20,681	2,626,979	食品・飲料・タバコ
COPART INC	180	166	1,939	246,296	商業・専門サービス
COGNEX CORP	162	143	707	89,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	704	637	5,030	638,951	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	243	211	3,647	463,336	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MOLINA HEALTHCARE INC	49	45	1,386	176,124	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	230	190	885	112,502	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	411	359	1,191	151,337	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	287	275	2,766	351,420	公益事業
CMS ENERGY CORP	267	236	1,693	215,124	公益事業
THE COOPER COS INC	41	41	1,455	184,924	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	649	649	2,316	294,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	146	116	745	94,704	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	64	764	97,069	資本財
CUMMINS INC	129	112	2,332	296,232	資本財
DR HORTON INC	296	277	2,076	263,717	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	556	505	13,458	1,709,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	147	133	4,109	522,001	各種金融
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	460	404	3,020	383,684	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	434	371	6,210	788,826	小売
DEERE&CO	258	232	8,387	1,065,404	資本財
MORGAN STANLEY	1,222	1,063	9,197	1,168,233	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	200	169	2,318	294,540	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	34	321	1,975	250,881	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,566	1,416	15,481	1,966,427	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	201	179	2,958	375,803	小売
DOVER CORP	122	106	1,435	182,390	資本財
OMNICOM GROUP	180	165	1,240	157,549	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	162	146	1,967	249,928	公益事業
DUKE ENERGY CORP	660	598	6,846	869,612	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	120	107	1,350	171,494	消費者サービス
EBAY	593	510	2,490	316,387	小売
BANK OF AMERICA CORP	6,705	5,762	21,333	2,709,740	銀行
CITIGROUP	1,811	1,551	8,319	1,056,779	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	126	110	1,214	154,221	素材
EATON CORP	344	316	4,421	561,640	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	247	219	3,425	435,055	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	201	201	448	57,024	メディア・娯楽
ECOLAB INC	221	198	3,303	419,568	素材
PERKINELMER INC	93	93	1,463	185,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	249	218	3,021	383,840	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	792	762	12,585	1,598,577	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	362	46,000	保険
EMERSON ELECTRIC CO	513	463	4,093	519,938	資本財
ATMOS ENERGY CORP	114	96	1,139	144,764	公益事業
ENERGY CORP	169	151	1,836	233,246	公益事業
EOG RESOURCES INC	513	461	6,311	801,672	エネルギー
EQUIFAX INC	104	95	1,961	249,163	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A	201	184	4,643	589,854	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	142	142	1,579	200,589	運輸
EXXON MOBIL	3,651	3,301	32,215	4,092,029	エネルギー
FMC CORP	121	105	1,323	168,172	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NEXTERA ENERGY INC	1,704	1,525	11,811	1,500,235	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	31	31	1,221	155,149	各種金融
FAIR ISAAC CORP	26	21	873	110,914	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	47	47	857	108,899	保険
FASTENAL CO	487	448	2,427	308,285	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	613	528	2,065	262,312	銀行
M & T BANK CORP	117	140	2,537	322,362	銀行
FISERV INC	516	464	4,705	597,717	ソフトウェア・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	718	91,229	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	1,253	1,131	4,488	570,083	素材
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	9	659	83,723	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	163	163	2,709	344,186	保険
DENTSPLY SIRONA INC	201	177	705	89,673	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	212	189	4,296	545,791	資本財
GENERAL MILLS INC	532	465	3,252	413,164	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	121	101	1,408	178,890	小売
GILEAD SCIENCES INC	1,079	970	6,289	798,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	75	63	1,690	214,686	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	138	120	4,049	514,346	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	534	1,961	36,891	4,686,014	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,612	851	6,709	852,218	資本財
GRAINGER (WW) INC	38	32	1,586	201,568	資本財
HALLIBURTON CO	775	682	2,823	358,654	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	297	266	8,752	1,111,686	各種金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	180	156	3,778	479,956	資本財
HASBRO INC	124	105	920	116,935	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	117	117	1,009	128,261	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	36	36	525	66,689	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	125	113	2,413	306,568	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,063	923	3,578	454,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	53	41	694	88,184	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	112	99	1,062	135,007	素材
JUNIPER NETWORKS INC	313	253	790	100,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	216	190	1,473	187,117	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	929	815	25,154	3,195,137	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	171	147	1,196	152,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	271	233	1,134	144,158	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	481	481	1,561	198,330	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	30	25	534	67,863	資本財
HUMANA INC	110	99	4,590	583,075	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	70	70	1,233	156,629	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	854	1,141	1,589	201,908	銀行
BIOGEN INC	134	118	2,445	310,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	69	59	1,136	144,383	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	274	242	5,008	636,203	資本財
INTUIT INC	235	212	8,976	1,140,186	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	74	67	2,691	341,812	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
INTEL CORP	3,504	3,188	14,203	1,804,131	半導体・半導体製造装置	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	211	194	2,591	329,225	素材	
INT'L PAPER CO	338	308	1,518	192,911	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	338	338	1,092	138,726	メディア・娯楽	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	106	1,493	189,663	商業・専門サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	62	62	1,183	150,299	ソフトウェア・サービス	
INCYTE CORP	175	152	1,174	149,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JOHNSON & JOHNSON	2,269	2,053	37,190	4,723,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	303	277	2,015	255,985	保険	
KLA CORP	136	121	4,499	571,516	半導体・半導体製造装置	
DEVON ENERGY CORPORATION	570	516	3,917	497,552	エネルギー	
KELLOGG CO	216	216	1,509	191,798	食品・飲料・タバコ	
KEY CORP	832	714	1,416	179,933	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	289	258	3,453	438,723	家庭用品・パーソナル用品	
BLACKROCK INC	132	118	7,878	1,000,712	各種金融	
KROGER CO	613	561	2,972	377,558	食品・生活必需品小売り	
LAM RESEARCH CORP	124	109	5,836	741,412	半導体・半導体製造装置	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	38	38	1,552	197,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PACKAGING CORP OF AMERICA	88	76	1,229	156,126	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	136	136	1,404	178,415	ソフトウェア・サービス	
PLUG POWER INC	418	418	798	101,401	資本財	
LENNAR CORP-CL A	249	208	1,691	214,906	耐久消費財・アパレル	
LILLY (ELI) & CO	701	632	20,474	2,600,733	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BATH & BODY WORKS INC	198	198	840	106,793	小売	
LINCOLN NATIONAL CORP	163	134	786	99,886	保険	
UNITED PARCEL SERVICE B	621	566	10,339	1,313,288	運輸	
AGILENT TECHNOLOGIES	260	237	3,105	394,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LOCKHEED MARTIN CORP	216	193	8,710	1,106,372	資本財	
LOEWS CORP	188	167	1,103	140,196	保険	
CARNIVAL CORPORATION	705	621	867	110,198	消費者サービス	
LOWES COMPANIES	637	521	10,418	1,323,407	小売	
DOMINION ENERGY INC	690	623	5,311	674,711	公益事業	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	330	288	1,007	127,961	消費者サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	210	189	1,757	223,225	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	648	581	14,642	1,859,853	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	206	277	10,002	1,270,544	各種金融	
EVEREST RE GROUP LTD	32	32	936	118,940	保険	
MARKEL CORP	11	11	1,622	206,143	保険	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	535	483	4,887	620,840	ヘルスケア機器・サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	446	392	6,321	802,922	保険	
MASCO CORP	234	194	1,125	142,984	資本財	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	53	46	1,618	205,556	素材	
METLIFE INC	642	571	3,868	491,394	保険	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	226	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,171	1,045	10,362	1,316,229	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	669	616	4,820	612,297	メディア・娯楽	
CVS HEALTH CORP	1,136	1,025	10,056	1,277,426	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
MERCK & CO	2,181	1,970	18,342	2,329,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ON SEMICONDUCTOR CORP	359	317	1,942	246,694	半導体・半導体製造装置	
LABORATORY CRP OF AMER	82	75	1,958	248,771	ヘルスケア機器・サービス	
MICROSOFT CORP	6,191	5,587	152,680	19,393,442	ソフトウェア・サービス	
MICRON TECHNOLOGY	966	873	6,403	813,369	半導体・半導体製造装置	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	224	420	3,059	388,609	半導体・半導体製造装置	
3 M COMPANY	501	448	6,707	851,925	資本財	
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	50	717	91,154	耐久消費財・アパレル	
ENTEGRIS INC	—	104	1,184	150,393	半導体・半導体製造装置	
CHARLES RIVER LABORATORIES	42	42	1,027	130,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	149	129	2,890	367,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	79	—	—	—	運輸	
ILLUMINA INC	125	112	2,905	369,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
XCEL ENERGY INC	464	437	3,339	424,143	公益事業	
FORD MOTOR COMPANY	3,344	3,052	4,159	528,403	自動車・自動車部品	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	84	84	788	100,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NETAPP INC	205	183	1,337	169,830	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NEWELL BRANDS INC	314	314	688	87,436	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT CORPORATION	685	615	4,229	537,223	素材	
NVR INC	2	2	1,103	140,171	耐久消費財・アパレル	
NIKE B	1,092	994	11,537	1,465,452	耐久消費財・アパレル	
NORDSON CORP	48	41	905	115,069	資本財	
NORFOLK SOUTHERN CORP	219	190	4,600	584,360	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	293	267	2,496	317,048	公益事業	
NISOURCE INC	357	286	911	115,727	公益事業	
NORTHERN TRUST CORP	176	159	1,790	227,437	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	135	117	5,525	701,824	資本財	
WELLS FARGO & CO	3,563	3,118	14,312	1,818,019	銀行	
NUCOR CORP	255	222	3,071	390,137	素材	
CHENIERE ENERGY INC	190	190	2,632	334,440	エネルギー	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	403	332	4,205	534,189	各種金融	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	791	699	4,957	629,738	エネルギー	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	80	80	2,113	268,509	運輸	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60	54	3,500	444,591	小売	
ORACLE CORP	1,648	1,282	9,334	1,185,655	ソフトウェア・サービス	
PACCAR INC	301	281	2,407	305,843	資本財	
EXELON CORP	867	771	3,848	488,800	公益事業	
PARKER HANNIFIN CORP	112	99	2,699	342,944	資本財	
PAYCHEX INC	277	254	3,155	400,840	ソフトウェア・サービス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	66	59	1,691	214,816	ヘルスケア機器・サービス	
PPL CORPORATION	699	584	1,774	225,437	公益事業	
PEPSICO INC	1,189	1,076	18,493	2,349,059	食品・飲料・タバコ	
PENTAIR PLC	145	145	731	92,963	資本財	
PFIZER	4,841	4,370	23,558	2,992,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	208	170	789	100,226	公益事業	
CONOCOPHILLIPS	1,173	1,040	11,921	1,514,326	エネルギー	
PG&E CORP	1,353	1,181	1,458	185,313	公益事業	

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価	額	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PIONEER NATURAL RESOURCES	179	182	5,102	648,147	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,612	1,429	7,781	988,465	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	367	329	5,765	732,327	銀行
BROWN & BROWN INC	198	198	1,191	151,329	保険
GARMIN LTD	128	128	1,356	172,316	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	205	192	2,506	318,403	素材
IPG PHOTONICS CORP	32	32	328	41,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	384	344	16,209	2,058,953	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	200	179	2,325	295,440	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS	113	100	1,454	184,766	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,125	1,893	28,166	3,577,674	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	505	451	5,428	689,532	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	432	394	2,724	346,113	公益事業
PULTE GROUP INC	248	216	987	125,408	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	252	225	2,984	379,089	ソフトウェア・サービス
QUALCOMM	984	878	12,270	1,558,653	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	103	154	1,536	195,109	各種金融
EXACT SCIENCES CORP	147	147	794	100,893	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	48	—	—	—	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	91	81	5,622	714,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	66	—	—	—	保険
RESMED INC	123	114	2,382	302,682	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,226	1,090	5,727	727,485	銀行
SEAGEN INC	114	100	1,423	180,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	340	297	1,410	179,199	保険
ROSS STORES INC	316	280	2,451	311,366	小売
ROLLINS INC	218	174	639	81,229	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	93	83	3,690	468,756	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	99	90	1,919	243,860	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	192	167	975	123,929	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	124	104	950	120,712	素材
ACCENTURE PLC-CL A	551	493	15,019	1,907,742	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,213	1,083	6,910	877,715	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	110	100	2,161	274,554	保険
TRAVELERS COS INC/THE	224	197	3,516	446,609	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	538	481	5,066	643,493	ソフトウェア・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	35	31	7,221	917,297	消費者サービス
SCHLUMBERGER	1,226	1,071	5,164	656,000	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,240	1,124	7,936	1,008,103	各種金融
POOL CORP	37	33	1,341	170,387	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	182	162	1,950	247,809	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	116	116	1,331	169,090	食品・飲料・タバコ
SEI INVESTMENTS COMPANY	122	95	558	70,902	各種金融
ANTHEM INC	210	189	9,851	1,251,392	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	128	128	2,022	256,944	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	230	207	1,511	191,958	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	219	197	5,449	692,175	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CENTENE CORP	513	445	3,760	477,654	ヘルスケア機器・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	43	45	2,236	284,046	銀行	
SMITH (A.O.) CORP	121	90	551	70,109	資本財	
SNAP-ON INC	49	40	891	113,251	資本財	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	348	295	3,136	398,351	保険	
ADVANCE AUTO PARTS	61	53	1,027	130,550	小売	
EDISON INTL	321	280	1,963	249,412	公益事業	
SOUTHERN CO	913	841	6,398	812,734	公益事業	
TRUIST FINANCIAL CORP	1,157	1,034	5,080	645,348	銀行	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	206	186	2,618	332,619	資本財	
SOUTHWEST AIRLINES CO	135	135	619	78,728	運輸	
AT&T INC	6,149	5,555	11,828	1,502,427	電気通信サービス	
CHEVRON CORP	1,660	1,507	26,868	3,412,869	エネルギー	
STANLEY BLACK&DECKER	137	125	1,507	191,511	資本財	
STATE STREET CORP	298	279	2,044	259,752	各種金融	
STARBUCKS CORP	1,020	915	7,021	891,850	消費者サービス	
STEEL DYNAMICS INC	182	155	1,365	173,421	素材	
STRYKER CORP	290	262	6,218	789,907	ヘルスケア機器・サービス	
NETFLIX INC	385	344	6,722	853,896	メディア・娯楽	
NORTONLIFELOCK INC	503	435	1,092	138,732	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSYS INC	134	120	3,887	493,827	ソフトウェア・サービス	
SYSCO CORP	435	402	3,403	432,316	食品・生活必需品小売り	
INTUITIVE SURGICAL INC	101	276	6,346	806,114	ヘルスケア機器・サービス	
TELEFLEX INC	39	39	1,141	144,957	ヘルスケア機器・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	804	804	726	92,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TERADYNE INC	143	123	1,347	171,170	半導体・半導体製造装置	
TEXAS INSTRUMENTS	799	717	12,777	1,623,002	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON	188	169	1,118	142,049	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	339	306	17,538	2,227,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBE LIFE INC	81	81	795	101,006	保険	
DAVITA INC	57	57	565	71,837	ヘルスケア機器・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	99	89	1,716	218,075	小売	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	211	211	1,466	186,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TYLER TECHNOLOGIES INC	37	33	1,210	153,734	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC	250	218	1,985	252,139	食品・飲料・タバコ	
UGI CORP	180	180	770	97,867	公益事業	
UNION PACIFIC CORP	577	507	11,285	1,433,474	運輸	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,319	1,172	11,337	1,440,102	資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	819	735	37,304	4,738,421	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	61	762	96,853	ヘルスケア機器・サービス	
VF CORP	286	257	1,290	163,923	耐久消費財・アパレル	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	485	485	1,647	209,271	メディア・娯楽	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	224	200	5,482	696,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VULCAN MATERIALS CO	113	102	1,739	220,890	素材	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	633	597	2,612	331,829	食品・生活必需品小売り	
WALMART INC	1,341	1,200	15,419	1,958,539	食品・生活必需品小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	362	327	5,275	670,153	商業・専門サービス	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WATERS CORP	52	47	1,591	202,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	142	695	88,399	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	63	57	1,852	235,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	91	91	1,148	145,838	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	35	30	762	96,835	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	257	257	1,605	203,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	150	150	1,426	181,159	資本財
WEYERHAEUSER CO	636	582	2,351	298,702	不動産
WHIRLPOOL CORP	52	52	954	121,211	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	143	133	1,453	184,645	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	93	93	607	77,107	消費者サービス
NASDAQ INC	96	96	1,503	190,913	各種金融
CME GROUP INC	310	278	5,563	706,695	各種金融
WILLIAMS COS	1,049	985	3,691	468,931	エネルギー
LKQ CORP	267	227	1,192	151,439	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	207	207	1,325	168,329	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	268	245	2,616	332,345	公益事業
CARMAX INC	138	120	1,208	153,515	小売
XILINX INC	209	—	—	—	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,031	931	6,016	764,157	小売
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	46	41	1,429	181,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	458	58,296	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	201	177	1,022	129,859	資本財
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	106	96	1,232	156,499	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	—	46	991	125,882	銀行
CBRE GROUP INC-A	301	253	2,133	270,979	不動産
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	155	388	49,310	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	818	708	1,549	196,806	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32	28	1,042	132,369	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	39	35	1,609	204,452	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	293	243	843	107,165	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	319	277	1,659	210,822	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32	32	923	117,272	各種金融
CELANESE CORP-SERIES A	98	85	1,366	173,552	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	182	146	808	102,758	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	84	76	2,210	280,789	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A	128	—	—	—	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC	116	116	1,524	193,607	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	190	149	1,431	181,779	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	101	87	2,423	307,822	各種金融
LIBERTY GLOBAL PLC-C	336	274	716	91,055	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	485	447	4,590	583,148	各種金融
LIVE NATION ENTERTAINMENT	139	123	1,178	149,709	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23	21	3,034	385,484	消費者サービス
TRANSIDGM GROUP INC	44	40	2,495	316,914	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	765	686	24,574	3,121,450	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	387	292	527	66,946	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
OWENS CORNING	86	86	841	106,905	資本財
LEIDOS HOLDINGS	112	112	1,182	150,155	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	110	539	68,494	資本財
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	176	176	93	11,890	消費者サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	97	97	1,430	181,654	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	146	146	616	78,363	運輸
INSULET CORP	59	53	1,249	158,673	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	261	234	2,625	333,531	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	293	260	3,375	428,761	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MASIMO CORP	48	41	595	75,588	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	107	93	2,732	347,071	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	78	167	2,160	274,469	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	38	35	2,894	367,647	小売
ULTA BEAUTY INC	45	39	1,696	215,434	小売
INVESCO LTD	357	264	516	65,573	各種金融
MSCI INC	72	65	2,921	371,047	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,354	1,212	12,971	1,647,626	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,464	1,306	27,810	3,532,426	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	154	141	2,151	273,225	公益事業
DISCOVERY INC-C	281	—	—	—	メディア・娯楽
MARATHON PETROLEUM CORP	571	480	4,907	623,394	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	103	726	92,259	資本財
KINDER MORGAN INC	1,794	1,593	3,176	403,496	エネルギー
XYLEM INC	152	132	1,139	144,795	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	226	198	2,318	294,500	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	755	95,914	資本財
SPLUNK INC	147	133	1,449	184,054	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	47	44	1,498	190,347	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	232	194	4,190	532,250	ヘルスケア機器・サービス
VERISK ANALYTICS INC	133	125	2,233	283,719	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	750	95,287	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	71	60	1,497	190,197	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	148	137	2,170	275,660	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	241	208	4,084	518,844	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	113	113	987	125,378	商業・専門サービス
LEAR CORP	52	52	721	91,707	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	88	88	992	126,088	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	193	193	1,252	159,046	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	209	186	4,267	542,058	小売
FORTINET INC	122	106	3,170	402,758	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	661	667	50,739	6,444,929	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	58	52	1,334	169,559	資本財
ENPHASE ENERGY INC	110	101	1,910	242,716	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,140	1,037	4,003	508,513	自動車・自動車部品
XPO LOGISTICS INC	80	—	—	—	運輸
ALLY FINANCIAL INC	314	277	1,198	152,190	各種金融
APTIV PLC	235	207	2,161	274,554	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PHILLIPS 66	381	355	3,611	458,760	エネルギー	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	79	63	521	66,271	ソフトウェア・サービス	
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,077	1,851	36,127	4,588,920	メディア・娯楽	
IQVIA HOLDINGS INC	167	151	3,335	423,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	132	2,025	257,258	エネルギー	
SERVICENOW INC	169	153	7,326	930,646	ソフトウェア・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	83	76	3,876	492,330	ソフトウェア・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	155	146	2,331	296,108	ソフトウェア・サービス	
ABBVIE INC	1,522	1,376	20,653	2,623,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
T-MOBILE US INC	533	496	6,659	845,889	電気通信サービス	
PTC INC	99	83	985	125,148	ソフトウェア・サービス	
ZOETIS INC	408	367	6,324	803,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEWS CORP-CLASS A	334	334	591	75,184	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	119	108	1,861	236,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
IHS MARKIT LTD	326	—	—	—	商業・専門サービス	
HOWMET AEROSPACE INC	365	315	1,138	144,590	資本財	
KEURIG DR PEPPER INC	595	525	1,847	234,715	食品・飲料・タバコ	
TWILIO INC - A	136	128	1,391	176,772	ソフトウェア・サービス	
COUPA SOFTWARE INC	60	60	439	55,858	ソフトウェア・サービス	
SNAP INC - A	817	833	1,298	164,996	メディア・娯楽	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35	330	1,736	220,620	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	186	153	975	123,887	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	265	33,741	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	172	135	564	71,657	メディア・娯楽	
OKTA INC	102	115	990	125,765	ソフトウェア・サービス	
BLACK KNIGHT INC	144	115	792	100,698	ソフトウェア・サービス	
BAKER HUGHES CO	579	627	2,334	296,522	エネルギー	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	129	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ALTICE USA INC- A	225	—	—	—	メディア・娯楽	
BROADCOM INC	352	324	18,933	2,404,903	半導体・半導体製造装置	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	63	63	420	53,464	ソフトウェア・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	107	522	66,379	運輸	
MONGODB INC	46	46	1,156	146,838	ソフトウェア・サービス	
BURLINGTON STORES INC	58	51	876	111,356	小売	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	360	860	109,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	117	112	1,935	245,892	ヘルスケア機器・サービス	
TWITTER INC	701	630	2,533	321,787	メディア・娯楽	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	654	83,149	資本財	
EVERGY INC	213	184	1,303	165,606	公益事業	
ALLEGION PLC	76	76	863	109,620	資本財	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	122	106	617	78,484	ソフトウェア・サービス	
STERIS PLC	71	80	1,884	239,334	ヘルスケア機器・サービス	
DOCUSIGN INC	155	149	1,290	163,973	ソフトウェア・サービス	
WIX.COM LTD	50	50	334	42,515	ソフトウェア・サービス	
DROPBOX INC-CLASS A	288	288	609	77,418	ソフトウェア・サービス	
KKR & CO INC	436	399	2,236	284,108	各種金融	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	43	43	156	19,834	各種金融	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価		額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	175	170	1,880	238,827	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	270	273	4,032	512,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	237	218	3,112	395,304	消費者サービス	
ARAMARK	209	209	721	91,642	消費者サービス	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	382	552	70,181	メディア・娯楽	
DELL TECHNOLOGIES -C	215	224	1,114	141,577	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DOW INC	636	573	3,960	503,039	素材	
AMCOR PLC	1,329	1,114	1,483	188,480	素材	
PINTEREST INC- CLASS A	457	457	935	118,882	メディア・娯楽	
PELTON INTERACTIVE INC-A	217	217	315	40,060	耐久消費財・アパレル	
NOVAVAX INC	57	57	318	40,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FOX CORP - CLASS A	276	276	980	124,575	メディア・娯楽	
FOX CORP- CLASS B	150	103	338	42,955	メディア・娯楽	
CLARIVATE PLC	273	273	407	51,775	商業・専門サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	156	144	2,415	306,802	ソフトウェア・サービス	
CHEWY INC - CLASS A	68	68	186	23,684	小売	
AVANTOR INC	479	429	1,417	180,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LYFT INC-A	212	212	378	48,050	運輸	
DYNATRACE INC	178	147	564	71,744	ソフトウェア・サービス	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	177	202	1,194	151,772	ソフトウェア・サービス	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	90	90	624	79,298	各種金融	
CARRIER GLOBAL CORP	706	631	2,541	322,768	資本財	
OTIS WORLDWIDE CORP	350	306	2,338	297,077	資本財	
INMODE LTD	—	55	146	18,610	ヘルスケア機器・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,031	1,136	2,689	341,680	運輸	
CORTEVA INC	649	585	3,680	467,463	素材	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	410	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
BILL.COM HOLDINGS INC	—	57	725	92,215	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	587	545	6,597	838,017	各種金融	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	14	63	8,106	小売	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	151	—	—	—	各種金融	
CARLYLE GROUP INC/THE	125	125	498	63,352	各種金融	
10X GENOMICS INC-CLASS A	56	56	299	38,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DATADOG INC - CLASS A	158	170	1,672	212,501	ソフトウェア・サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	179	150	1,327	168,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VOYA FINANCIAL INC	100	—	—	—	各種金融	
UPSTART HOLDINGS INC	—	31	158	20,124	各種金融	
INGERSOLL-RAND INC	315	315	1,530	194,396	資本財	
PAYCOM SOFTWARE INC	42	42	1,246	158,301	ソフトウェア・サービス	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	133	413	52,550	自動車・自動車部品	
PPD INC	110	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DRAFTKINGS INC	—	276	407	51,743	消費者サービス	
ASANA INC - CL A	—	49	113	14,439	ソフトウェア・サービス	
UNITY SOFTWARE INC	43	43	178	22,720	ソフトウェア・サービス	
AON PLC	193	175	4,931	626,418	保険	
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	389	294	37,397	各種金融	
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	1,753	3,290	417,955	メディア・娯楽	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	139	139	475	60,373	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	28	216	27,438	各種金融
AFFIRM HOLDINGS INC	—	128	388	49,406	ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP	67	67	582	73,947	メディア・娯楽
AIRBNB INC-CLASS A	46	230	2,774	352,433	消費者サービス
ZENDESK INC	105	88	880	111,825	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY	—	257	1,713	217,680	公益事業
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	155	261	1,078	136,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	219	901	114,456	メディア・娯楽
VIATRIS INC	1,035	907	1,111	141,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	175	175	906	115,092	消費者サービス
DRAFTKINGS INC - CL A	156	—	—	—	消費者サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19	166	2,157	274,018	ソフトウェア・サービス
DOORDASH INC - A	—	83	650	82,664	小売
OAK STREET HEALTH INC	76	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	51	188	1,998	253,890	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	268	1,621	205,950	各種金融
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	432	1,252	1,108	140,790	ソフトウェア・サービス
FNFGROUP	249	204	865	109,909	保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	704	633	3,853	489,478	半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	130	135	17,206	各種金融
LUCID GROUP INC	—	312	619	78,672	自動車・自動車部品
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	—	830	200	25,411	運輸
CATALENT INC	152	137	1,447	183,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	495	453	1,639	208,266	各種金融
HORIZON THERAPEUTICS PLC	179	179	1,700	215,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	360	322	1,318	167,424	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	453	57,552	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	60	60	354	44,995	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	160	149	2,176	276,503	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	40	36	1,284	163,220	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	96	85	959	121,926	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	25	25	313	39,788	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	135	112	1,415	179,852	メディア・娯楽
BIO-TECHNE CORP	32	32	1,254	159,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZILLOW GROUP INC-A	54	54	225	28,655	不動産
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	46	37	1,051	133,542	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC - CLASS A	159	137	1,037	131,797	ソフトウェア・サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—	27	120	15,278	資本財
ETSY INC	110	102	845	107,414	小売
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	633	566	3,101	393,946	資本財
TRANSUNION	170	157	1,388	176,428	商業・専門サービス
BLOCK INC	332	396	3,591	456,165	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	461	409	2,801	355,832	素材
CARVANA CO	57	57	192	24,507	小売
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	192	153	829	105,354	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	113	113	406	51,682	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WESTROCK CO	247	213	1,047	133,027	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	573	521	1,974	250,772	食品・飲料・タバコ	
NOVOCURE LTD	79	79	666	84,622	ヘルスケア機器・サービス	
FORTIVE CORP	257	257	1,594	202,566	資本財	
MATCH GROUP INC	218	201	1,612	204,762	メディア・娯楽	
WASTE CONNECTIONS INC	224	212	2,733	347,225	商業・専門サービス	
ALPHABET INC-CL A	259	235	52,804	6,707,224	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,091	987	1,559	198,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	959	882	7,517	954,881	ソフトウェア・サービス	
SEA LTD-ADR	6	251	2,081	264,342	メディア・娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	328	273	844	107,331	各種金融	
SUNRUN INC	139	139	367	46,738	資本財	
ZILLOW GROUP INC-C	134	134	554	70,419	不動産	
ALPHABET INC-CL C	254	223	50,482	6,412,231	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	62	62	997	126,694	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	342	322	2,893	367,517	食品・飲料・タバコ	
CABLE ONE INC	4	4	571	72,635	メディア・娯楽	
LINDE PLC	450	401	13,238	1,681,525	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	102	—	—	—	保険	
ROKU INC	97	91	879	111,777	メディア・娯楽	
AVALARA INC	76	68	590	74,942	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	116	98	5,002	635,354	メディア・娯楽	
VISTRA CORP	377	377	994	126,313	公益事業	
小 計	273,341	250,077	2,826,337	359,001,333		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	601	606	—	<68.6%>		
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES	202	363	2,499	249,608	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	741	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	1,535	1,390	3,639	363,452	素材	
ATCO LTD -CLASS I	52	—	—	—	公益事業	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	197	197	196	19,619	資本財	
BANK MONTREAL	558	513	7,015	700,650	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	1,047	965	8,231	822,074	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	272	272	2,649	264,631	銀行	
BCE INC	62	62	426	42,633	電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	1,108	1,105	7,104	709,513	各種金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	278	208	261	26,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAPUTO INC	244	208	530	52,991	食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LIMITED	394	394	328	32,816	ソフトウェア・サービス	
CGI INC - CL A	184	161	1,755	175,367	ソフトウェア・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	794	79,361	素材	
CAE INC	259	259	824	82,387	資本財	
CAMECO CORP	268	268	863	86,199	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	305	261	1,717	171,510	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	387	689	4,772	476,638	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,027	931	7,920	791,026	エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	35	609	60,896	小売	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	411	41,097	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	608	554	8,052	804,154	運輸
YAMANA GOLD INC	816	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	170	170	671	67,033	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	246	204	1,032	103,081	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	152	152	624	62,410	食品・生活必需品小売り
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	102	102	781	78,077	商業・専門サービス
FORTIS INC	426	368	2,348	234,588	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	550	430	1,562	156,058	素材
TELUS CORP	329	329	1,036	103,492	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	237	237	819	81,890	保険
IMPERIAL OIL	247	165	1,177	117,598	エネルギー
ENBRIDGE	1,731	1,564	9,198	918,693	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	294	29,379	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,630	1,478	3,425	342,058	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	129	129	1,498	149,686	食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	674	3,847	384,264	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	232	232	1,894	189,222	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	507	457	2,896	289,282	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	21	1,484	148,263	保険
METRO INC	188	188	1,316	131,463	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	237	187	1,185	118,399	公益事業
ONEX CORP	66	66	497	49,649	各種金融
TC ENERGY CORP	823	773	5,654	564,764	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	184	184	531	53,120	素材
POWER CORP OF CANADA	515	435	1,600	159,850	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	439	43,916	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,228	1,106	14,493	1,447,431	銀行
CP RAILWAY LIMITED	575	737	6,682	667,409	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	354	354	1,274	127,282	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,321	1,162	6,003	599,550	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	687	68,689	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	405	347	1,910	190,825	素材
THOMSON REUTERS CORP	150	132	1,669	166,729	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	77	55	617	61,645	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,563	1,414	13,581	1,356,368	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	78	78	901	90,066	素材
WESTON (GEORGE) LTD	68	52	807	80,688	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,084	1,084	627	62,711	素材
INTACT FINANCIAL CORP	130	133	2,399	239,596	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	395	342	1,847	184,542	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	15	3,006	300,286	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	169	153	2,783	277,954	素材
B2GOLD CORP	902	—	—	—	素材
TFI INTERNATIONAL INC	—	58	603	60,311	運輸
TOURMALINE OIL CORP	—	221	1,726	172,414	エネルギー
KEYERA CORP	186	186	627	62,661	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
PARKLAND CORP	140	140	515	51,447	エネルギー		
ALTAGAS INCOME LTD	243	243	743	74,234	公益事業		
PEMBINA PIPELINE CORP	456	456	2,341	233,825	エネルギー		
DOLLARAMA INC	267	220	1,571	156,897	小売		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	518	518	957	95,583	公益事業		
CENOVUS ENERGY INC	966	966	2,783	278,036	エネルギー		
NORTHLAND POWER INC	178	178	693	69,236	公益事業		
TMX GROUP LTD	46	46	645	64,480	各種金融		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	234	—	—	—	素材		
IVANHOE MINES LTD-CL A	518	518	515	51,520	素材		
INTER PIPELINE LTD	354	—	—	—	エネルギー		
NUTRIEN LTD	489	447	5,444	543,755	素材		
LIGHTSPEED COMMERCE INC	82	82	273	27,308	ソフトウェア・サービス		
WSP GLOBAL INC	106	86	1,189	118,811	資本財		
IA FINANCIAL CORP INC	100	100	654	65,346	保険		
FIRSTSERVICE CORP	36	26	430	42,992	不動産		
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	135	135	527	52,681	商業・専門サービス		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	43	43	281	28,087	ソフトウェア・サービス		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	112	112	541	54,122	公益事業		
AIR CANADA	138	138	307	30,676	運輸		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	230	230	1,500	149,894	消費者サービス		
SHOPIFY INC - CLASS A	97	87	4,109	410,402	ソフトウェア・サービス		
CANOPY GROWTH CORP	209	209	129	12,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HYDRO ONE LTD	322	232	821	82,079	公益事業		
小 計	株 数 ・ 銘 柄 数	金 額 <比 率>	35,167	31,347	195,658	19,540,448	
			89	86	—	<3.7%>	
(ドイツ)					千ユーロ		
ADIDAS AG	162	147	2,645	360,616	耐久消費財・アパレル		
COMMERZBANK AG	943	818	661	90,178	銀行		
FRESENIUS SE&CO KGAA	336	336	1,095	149,268	ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	95	293	40,036	電気通信サービス		
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	57	163	22,224	素材		
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	57	43	623	84,920	保険		
GEA GROUP AG	133	133	505	68,886	資本財		
CONTINENTAL AG	99	81	575	78,370	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE POST AG-REG	853	787	2,999	408,734	運輸		
MERCK KGAA	105	105	1,880	256,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
RWE STAMM	553	496	2,010	273,950	公益事業		
SAP SE	902	812	7,633	1,040,330	ソフトウェア・サービス		
E.ON SE	1,853	1,703	1,644	224,079	公益事業		
HENKEL AG & CO KGAA	87	87	532	72,635	家庭用品・パーソナル用品		
PUMA SE	92	92	613	83,638	耐久消費財・アパレル		
BAYER	838	760	5,060	689,656	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENKEL AG & CO KGAA -PPD	144	144	890	121,340	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	787	711	3,637	495,740	素材		
BEIERSDORF AG	91	74	708	96,524	家庭用品・パーソナル用品		
HEIDELBERGCEMENT AG	130	130	706	96,332	素材		

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	174	144	818	111,597	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE-REG	355	320	6,413	874,137	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	232	453	312	42,523	運輸	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	123	107	2,464	335,886	保険	
VOLKSWAGEN STAMM	24	24	489	66,780	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	163	142	2,174	296,334	自動車・自動車部品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	733	667	4,408	600,850	自動車・自動車部品	
NEMETSCHKE SE	54	54	369	50,302	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS	660	594	7,248	987,961	資本財	
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,772	1,606	1,669	227,480	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	286	261	2,108	287,389	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	368	50,166	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM	2,850	2,581	4,924	671,200	電気通信サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	22	18	661	90,214	ヘルスケア機器・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES	1,123	1,018	2,954	402,665	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	4	4	284	38,805	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	428	58,434	ヘルスケア機器・サービス	
BECHTLE AG	25	76	319	43,517	ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE	165	149	2,456	334,739	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	140	117	862	117,525	自動車・自動車部品	
LANXESS	72	72	278	37,979	素材	
MTU AERO ENGINES AG	47	39	748	102,056	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	280	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	114	97	1,019	138,899	素材	
BRENTAG SE	125	125	915	124,810	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	197	160	400	54,576	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	987	987	286	39,002	電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	69	52	497	67,751	不動産	
KION GROUP AG	58	58	266	36,378	資本財	
VONOVIA SE	450	590	2,101	286,410	不動産	
KNORR-BREMSE AG	68	50	322	44,010	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	245	215	1,213	165,427	ヘルスケア機器・サービス	
TEAMVIEWER AG	141	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS ENERGY AG	361	268	473	64,480	資本財	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	333	969	132,190	資本財	
ZALANDO SE	139	176	662	90,230	小売	
SCOUT24 SE	74	74	433	59,079	メディア・娯楽	
COVESTRO AG	172	144	609	83,091	素材	
HELLOFRESH SE	138	138	480	65,494	食品・生活必需品小売り	
UNIPER SE	73	73	177	24,212	公益事業	
DELIVERY HERO SE	134	134	457	62,396	小売	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	21,283 60	19,845 59	88,933 —	12,120,806 <2.3%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	975	856	1,462	199,348	保険	
INTESA SANPAOLO	14,414	12,510	2,560	349,026	銀行	
UNICREDIT SPA	1,890	1,683	1,821	248,215	銀行	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
MEDIOBANCA	539	539	514	70,109	銀行	
ENEL	6,929	6,179	3,822	520,957	公益事業	
ENI	2,185	1,976	2,805	382,336	エネルギー	
SNAM SPA	1,894	1,475	808	110,126	公益事業	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	239	32,580	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	4,701	—	—	—	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	465	359	812	110,789	運輸	
TERNA SPA	1,302	1,028	824	112,404	公益事業	
RECORDATI SPA	98	98	414	56,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPLIFON SPA	116	116	377	51,396	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	211	211	643	87,649	資本財	
DIASORIN SPA	20	20	251	34,263	ヘルスケア機器・サービス	
MONCLER SPA	182	143	618	84,338	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	413	314	305	41,587	ソフトウェア・サービス	
FINECOBANK SPA	531	531	694	94,587	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	460	460	457	62,314	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	303	303	316	43,198	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	46,163	37,335	19,750	2,691,788
(フランス)			20	19	—	<0.5%>
BOUYGUES ORD	214	166	544	74,143	資本財	
AIR LIQUIDE	404	369	6,115	833,414	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	434	510	1,355	184,710	公益事業	
LOREAL	216	198	6,443	878,212	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH	240	215	12,807	1,745,594	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT AVIATION SA	2	21	336	45,867	資本財	
THALES SA	96	74	874	119,248	資本財	
CAPGEMINI SA	139	127	2,372	323,364	ソフトウェア・サービス	
PUBLICIS GROUPE	170	170	883	120,467	メディア・娯楽	
FAURECIA	109	109	277	37,854	自動車・自動車部品	
BOLLORE SE	836	836	418	57,057	メディア・娯楽	
MICHELIN	138	138	1,664	226,899	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	182	159	2,930	399,438	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	173	173	437	59,594	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	23	13	235	32,038	食品・飲料・タバコ	
SEB SA	22	22	230	31,381	耐久消費財・アパレル	
VINCI S.A.	459	410	3,809	519,226	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	465	417	5,332	726,777	資本財	
VIVENDI SE	612	612	675	92,065	メディア・娯楽	
TOTALENERGIES SE	2,170	1,945	10,677	1,455,259	エネルギー	
VALEO SA	215	215	428	58,341	自動車・自動車部品	
ORANGE	1,715	1,538	1,800	245,356	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	27	25	2,772	377,876	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	114	527	2,080	283,529	ソフトウェア・サービス	
KERING	64	58	2,863	390,211	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	162	162	340	46,437	保険	
CARREFOUR	525	525	1,003	136,815	食品・生活必需品小売り	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ATOS SE	97	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	975	880	9,014	1,228,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR	144	144	442	60,362	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	678	633	1,575	214,742	銀行	
TELEPERFORMANCE	47	47	1,473	200,785	商業・専門サービス	
EURAZEO SA	33	33	244	33,262	各種金融	
SODEXO	81	60	432	58,994	消費者サービス	
AXA SA	1,668	1,485	3,606	491,479	保険	
ESSILORLUXOTTICA	251	220	3,370	459,351	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	1,074	895	1,007	137,298	銀行	
BNP PARIBAS	970	867	4,644	632,984	銀行	
ORPEA	43	43	115	15,766	ヘルスケア機器・サービス	
SAINT-GOBAIN	439	400	2,211	301,409	資本財	
WENDEL	20	20	193	26,330	各種金融	
ILIAD SA	12	—	—	—	電気通信サービス	
DANONE (GROUPE)	546	515	2,822	384,677	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	284	261	2,606	355,301	資本財	
ENGIE	1,582	1,415	1,797	245,030	公益事業	
ALSTOM	243	243	634	86,453	資本財	
ELECTRICITE DE FRANCE	395	395	333	45,492	公益事業	
IPSEN	35	35	336	45,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	59	43	495	67,464	素材	
LEGRAND SA	217	217	1,788	243,808	資本財	
EIFFAGE	79	59	560	76,394	資本財	
ADP	23	23	331	45,125	運輸	
NATIXIS	897	—	—	—	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	70	70	342	46,672	メディア・娯楽	
SCOR SE	133	—	—	—	保険	
BUREAU VERITAS SA	250	250	674	91,922	商業・専門サービス	
GETLINK	441	293	541	73,852	運輸	
SUEZ	325	—	—	—	公益事業	
EDENRED	227	186	861	117,468	ソフトウェア・サービス	
BIOMERIEUX	41	30	298	40,715	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	81	81	283	38,687	消費者サービス	
WORLDDLIN SA	203	203	810	110,426	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	24	19	623	84,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	62	46	247	33,730	各種金融	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	22,705	19,874	114,437	15,596,627	
(オランダ)		64	59	—	<3.0%>	
AIRBUS SE	501	458	5,131	699,336	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	42	34	998	136,143	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	112	75	397	54,140	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	874	791	2,038	277,790	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	153	153	1,261	171,959	素材	
WOLTERS KLUWER	229	208	1,941	264,588	商業・専門サービス	
QIAGEN N. V.	218	170	750	102,288	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)	期 末				業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
KONINKLIJKE DSM NV	149	137	1,945	265,087	素材	
VOPAK	63	—	—	—	エネルギー	
AEGON	1,662	1,146	581	79,313	保険	
ASML HOLDING NV	361	322	17,455	2,379,056	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,829	2,829	955	130,256	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS	550	550	2,052	279,797	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	772	717	1,699	231,627	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	3,434	3,016	3,073	418,885	銀行	
HEINEKEN NV	224	201	1,868	254,610	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	107	92	673	91,787	食品・飲料・タバコ	
FERRARI NV	101	101	1,903	259,472	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	930	810	1,126	153,498	資本財	
PROSUS	430	724	3,325	453,223	小売	
JDE PEET'S BV	70	70	191	26,121	食品・飲料・タバコ	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	490	490	485	66,151	食品・飲料・タバコ	
EURONEXT NV	—	64	514	70,087	各種金融	
IMCD NV	—	46	650	88,679	資本財	
NN GROUP NV	226	226	1,061	144,652	保険	
ARGENX SE	41	34	1,029	140,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	612	1,277	174,114	メディア・娯楽	
STELLANTIS NV	1,701	1,597	2,196	299,314	自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY	113	155	313	42,722	小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	399	399	428	58,461	銀行	
EXOR NV	103	78	547	74,652	各種金融	
ADYEN NV	16	15	2,375	323,816	ソフトウェア・サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,910 29	16,334 31	60,253 —	8,211,940 <1.6%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA	4,983	4,494	5,080	692,487	公益事業	
ENDESA	259	259	541	73,838	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA	5,769	5,348	2,696	367,473	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	233	100	284	38,717	公益事業	
REPSOL SA	1,273	1,111	1,665	227,000	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	14,703	13,394	4,072	554,980	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	396	306	595	81,197	公益事業	
TELEFONICA	4,346	4,179	2,067	281,785	電気通信サービス	
INDITEX	950	873	1,946	265,288	小売	
ENAGAS	252	156	340	46,445	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	224	224	402	54,854	資本財	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	196	211	562	76,650	資本財	
GRIFOLS SA	276	276	549	74,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	410	339	821	111,901	資本財	
CAIXABANK	3,801	3,304	1,111	151,503	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	214	214	488	66,557	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	390	355	2,147	292,633	ソフトウェア・サービス	
FERROVIAL SA-RTS	471	—	—	—	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	339	9	1,251	資本財	

銘柄	銘柄	当季首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AENA SME SA		65	55	786	107,160	運輸
CELLNEX TELECOM SA		414	414	1,793	244,466	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	39,636	35,960	27,963	3,811,091	
(ベルギー)						
UMICORE		176	176	742	101,158	素材
KBC GROEP NV		210	186	1,084	147,802	銀行
SOFINA		12	12	274	37,356	各種金融
SOLVAY SA		69	53	489	66,777	素材
UCB (GROUPE)		118	93	777	105,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		54	54	164	22,472	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		106	85	740	100,871	各種金融
AGEAS		160	110	516	70,438	保険
PROXIMUS		131	131	216	29,461	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV		29	29	448	61,152	公益事業
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		637	687	3,632	495,107	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,706	1,619	9,087	1,238,578	
(オーストリア)						
OMV AG		125	125	675	92,116	エネルギー
VERBUND AG		64	64	580	79,177	公益事業
VOESTALPINE AG		71	71	199	27,195	素材
ERSTE GROUP BANK AG		239	239	695	94,840	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		124	124	154	20,988	銀行
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	625	625	2,306	314,319	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		124	102	897	122,267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		406	406	651	88,804	エネルギー
ARCELORMITTAL		616	552	1,681	229,172	素材
AROUNDTOWN SA		940	640	277	37,800	不動産
INPOST SA		124	124	79	10,797	運輸
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,212	1,826	3,586	488,842	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		255	200	462	63,090	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ		419	419	331	45,143	資本財
UPM KYMMENE OYJ		456	423	1,420	193,643	素材
STORA ENSO OYJ R		547	421	792	107,961	素材
SAMPO OYJ-A SHS		430	386	1,665	226,957	保険
FORTUM OYJ		419	325	571	77,856	公益事業
ELISA A		133	102	552	75,322	電気通信サービス
NOKIA OYJ		4,506	4,276	2,059	280,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		372	321	1,398	190,594	エネルギー
KONE OYJ-B		290	263	1,261	171,981	資本財
ORION OYJ-CLASS B		98	98	372	50,711	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,930	7,238	10,888	1,483,926	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC	144	123	945	128,824	資本財	
CRH PLC	647	596	2,311	315,001	素材	
KERRY GROUP PLC-A	130	130	1,277	174,123	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	230	195	746	101,755	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	145	130	1,469	200,326	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,298 5	1,176 5	6,750 —	920,031 <0.2%>	
(ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,257	2,257	1,065	145,162	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	491	279	339	46,312	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	249	249	481	65,601	食品・生活必需品小売り	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,998 3	2,785 3	1,886 —	257,077 <0.0%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	163,471 233	144,622 228	345,843 —	47,135,029 <9.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
ANTOFAGASTA PLC	358	358	527	84,538	素材	
ASHTAD GROUP PLC	370	341	1,405	225,361	資本財	
SEVERN TRENT PLC	224	224	660	105,911	公益事業	
BHP GROUP PLC	1,824	—	—	—	素材	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	964	732	368	59,127	耐久消費財・アパレル	
BUNZL PLC	248	248	711	114,048	資本財	
AVIVA PLC	3,327	2,253	993	159,378	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	131	109	751	120,579	素材	
DIAGEO	2,008	1,805	6,576	1,054,860	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC	117	117	346	55,538	各種金融	
DCC PLC	91	66	371	59,647	資本財	
BAE SYSTEMS PLC	2,601	2,601	1,994	319,894	資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,882	1,682	5,974	958,278	食品・飲料・タバコ	
HALMA PLC	310	310	703	112,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC	2,124	2,124	1,332	213,645	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	809	760	1,367	219,278	食品・飲料・タバコ	
JOHNSON MATTHEY PLC	168	168	355	57,098	素材	
ANGLO AMERICAN PLC	1,089	1,021	3,884	623,113	素材	
COMPASS GROUP PLC	1,556	1,424	2,562	411,075	消費者サービス	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	17,544	15,838	8,432	1,352,502	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP	5,145	4,607	1,208	193,768	保険	
UNILEVER PLC	2,270	2,019	7,017	1,125,545	家庭用品・パーソナル用品	
MORRISON SUPERMARKETS	2,093	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	585	585	611	98,090	公益事業	
RSA INSURANCE GROUP LTD	972	—	—	—	保険	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	334	257	446	71,669	食品・飲料・タバコ	
PEARSON	663	663	492	78,994	メディア・娯楽	
PERSIMMON PLC	256	256	574	92,159	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL	2,253	2,109	2,172	348,522	保険	
RIO TINTO PLC REG	960	871	4,966	796,567	素材	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
VODAFONE GROUP PLC	23,595	22,047	2,869	460,200	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	605	546	3,342	536,065	家庭用品・パーソナル用品
RELEX PLC	1,668	1,495	3,413	547,486	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,404	1,404	715	114,730	商業・専門サービス
NATWEST GROUP PLC	3,691	4,437	1,008	161,687	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	505	409	518	83,216	各種金融
SSE PLC	922	816	1,431	229,541	公益事業
BP PLC	17,576	15,556	6,699	1,074,488	エネルギー
SAGE GROUP PLC	952	766	515	82,748	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	371	264	411	66,011	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	61,902	54,438	2,462	394,961	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	3,559	2,641	343	55,173	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	6,660	6,010	1,553	249,200	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	881	747	958	153,775	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	685	685	888	142,585	ヘルスケア機器・サービス
GSK PLC	4,300	3,888	6,740	1,081,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WPP PLC	1,130	958	887	142,375	メディア・娯楽
ASTRAZENECA	1,131	1,202	12,720	2,040,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	7,694	7,167	1,320	211,809	電気通信サービス
NATIONAL GRID PLC	3,067	2,860	3,329	534,030	公益事業
BARCLAYS	15,162	13,395	2,282	366,060	銀行
INTERTEK GROUP PLC	138	138	649	104,150	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	297	297	497	79,779	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	114	114	750	120,293	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,861	6,359	552	88,642	資本財
KINGFISHER PLC	1,985	1,537	408	65,507	小売
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	275	247	1,869	299,808	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	342	54,982	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	363	58,347	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	118	76	325	52,220	耐久消費財・アパレル
SHELL PLC-A SHS	3,542	—	—	—	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,200	—	—	—	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	160	125	619	99,285	消費者サービス
WHITBREAD PLC	174	174	475	76,337	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	164	164	277	44,560	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABRDN PLC	2,109	1,534	300	48,269	各種金融
EXPERIAN PLC	791	741	1,997	320,362	商業・専門サービス
MONDI PLC	367	367	572	91,880	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	330	330	281	45,203	各種金融
OCADO GROUP PLC	446	358	323	51,847	食品・生活必需品小売り
GLENCORE PLC	8,756	7,673	4,037	647,606	素材
ENTAIN PLC	496	496	711	114,069	消費者サービス
EVRAZ PLC	430	—	—	—	素材
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,137	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	315	50,569	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	109	109	248	39,799	ソフトウェア・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	510	510	329	52,859	保険

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FERGUSON PLC	194	177	1,695	271,878	資本財
M&G PLC	2,291	2,291	499	80,070	各種金融
INFORMA PLC	1,411	1,105	606	97,208	メディア・娯楽
SHELL PLC-NEW	—	5,982	14,237	2,283,612	エネルギー
AUTO TRADER GROUP PLC	973	724	417	67,036	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55	55	582	93,435	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,566	3,197	412	66,162	資本財
JD SPORTS FASHION PLC	413	2,068	248	39,790	小売
小 計	256,015	224,085	146,175	23,445,152	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	84	78	—	<4.5%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	125	109	2,917	386,797	素材
SGS SA	5	5	1,222	162,090	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	602	79,893	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM	21	21	1,256	166,561	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	29	29	1,574	208,759	資本財
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.82	0.82	782	103,722	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.1	0.08	799	105,965	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	7	7	2,669	353,963	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	127	116	5,150	682,867	保険
NOVARTIS	1,919	1,702	14,835	1,967,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,490	1,276	3,747	496,944	資本財
ROCHE HOLDING AG-BR	27	27	1,050	139,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS	608	546	18,036	2,391,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	145	104	388	51,473	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	453	406	1,950	258,563	素材
CLARIANT AG-REG	173	173	321	42,675	素材
NESTLE SA - REGISTERED	2,487	2,193	25,572	3,390,629	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	43	31	528	70,069	保険
TEMENOS AG - REG	65	51	491	65,115	ソフトウェア・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	18	136	18,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG	46	40	1,370	181,700	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	45	1,178	156,267	運輸
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8	85	1,022	135,538	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,133	2,133	1,486	197,048	各種金融
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	583	77,399	耐久消費財・アパレル
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	175	23,266	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	65	58	3,376	447,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	28	24	1,343	178,200	保険
VIFOR PHARMA AG	44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	462	61,265	素材
SWISS PRIME SITE-REG	74	56	568	75,373	不動産
PARTNERS GROUP HOLDING AG	19	18	1,920	254,703	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	37	30	608	80,681	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	21	13	266	35,368	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	146	146	837	111,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	459	413	4,293	569,243	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JULIUS BAER GROUP LTD	188	188	930	123,423	各種金融	
SWISS RE LTD	246	228	1,835	243,316	保険	
ALCON INC	426	393	2,817	373,614	ヘルスケア機器・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	28	—	—	—	銀行	
VIFOR PHARMA AG/NEW	—	33	558	74,042	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UBS GROUP AG	3,150	2,710	4,875	646,463	各種金融	
VAT GROUP AG	—	19	543	72,098	資本財	
小 計	14,980	13,540	115,089	15,259,717		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	40	41	—	<2.9%>		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ATLAS COPCO A	583	2,052	21,997	284,651	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,544	45,867	各種金融	
SKF AB-B	354	248	4,340	56,162	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,384	1,207	13,468	174,282	銀行	
SWEDBANK AB-A	725	725	10,962	141,852	銀行	
SCA SV CELLULOZA B	569	438	7,941	102,761	素材	
VOLVO AB-A SHS	135	135	2,477	32,053	資本財	
VOLVO B	1,232	1,117	19,392	250,940	資本財	
SWEDISH MATCH AB	1,272	1,272	12,968	167,816	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	500	328	3,993	51,677	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	212	212	3,227	41,762	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	295	295	3,158	40,871	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	1,576	1,427	26,091	337,618	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	659	552	7,317	94,692	小売	
ASSA ABLOY AB-B	865	781	18,882	244,345	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,311	1,107	10,903	141,085	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,538	2,255	18,356	237,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	966	876	17,669	228,637	資本財	
TELIA CO AB	2,306	2,306	9,366	121,201	電気通信サービス	
SKANSKA B	320	255	4,345	56,225	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	172	172	7,908	102,333	エネルギー	
BOLIDEN AB	239	184	7,533	97,488	素材	
ALFA LAVAL AB	272	272	6,904	89,341	資本財	
GETINGE AB-B SHS	—	177	4,982	64,478	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK AB - B	187	187	3,598	46,566	各種金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	94	567	4,174	54,022	不動産	
ICA GRUPPEN AB	94	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	3,454	44,703	資本財	
ATLAS COPCO B	319	1,276	11,913	154,160	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	101	118	3,057	39,561	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	111	111	2,851	36,894	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	1,697	1,538	18,583	240,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAGAX AB-B	—	124	3,447	44,613	不動産	
EPIROC AB-A	580	469	9,021	116,737	資本財	
EPIROC AB-B	379	288	4,860	62,897	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	494	494	12,561	162,545	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	201	232	6,509	84,233	各種金融	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
EVOLUTION AB	140	140	14,341	185,576	消費者サービス	
EMBRACER GROUP AB	187	375	3,269	42,310	メディア・娯楽	
LIFCO AB-B SHS	—	179	3,565	46,134	資本財	
EPIROC AB-A RED SHS	580	—	—	—	資本財	
EPIROC AB-B RED SHS	379	—	—	—	資本財	
INVESTOR AB-A SHS	—	389	7,796	100,889	各種金融	
BOLIDEN AB-RED	239	—	—	—	素材	
KINNEVIK AB-B-RED	187	—	—	—	各種金融	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,076	1,076	9,507	123,027	資本財	
NORDEA BANK ABP	2,809	2,538	26,339	340,834	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	140	140	3,360	43,484	資本財	
SINCH AB	33	441	2,068	26,762	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	28,992 45	29,554 44	402,017 —	5,202,107 <1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	855	—	—	—	銀行	
NORSK HYDRO	1,268	968	7,221	96,765	素材	
TELENOR ASA	657	511	6,670	89,384	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	70	70	1,343	18,002	メディア・娯楽	
ORKLA	698	698	5,133	68,787	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	763	763	26,939	360,989	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	164	124	6,046	81,023	素材	
MOWI ASA	409	319	7,774	104,179	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	—	61	2,379	31,886	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,878	51,968	保険	
ADEVINTA ASA	191	191	1,377	18,456	メディア・娯楽	
DNB BANK ASA	—	717	13,917	186,493	銀行	
SCHIBSTED ASA-B SHS	92	92	1,543	20,678	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,356 11	4,705 12	84,225 —	1,128,616 <0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	86	70	6,148	112,640	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	5	4	8,810	161,402	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	4,415	80,883	運輸	
GN STORE NORD A/S	119	92	2,362	43,286	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	648	561	6,255	114,608	銀行	
GENMAB A/S	51	52	11,082	203,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	191	171	7,287	133,508	素材	
ROCKWOOL A/S-B SHS	7	7	1,418	25,989	資本財	
DSV A/S	181	163	17,903	327,989	運輸	
DEMANT A/S	116	85	2,400	43,975	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSSEMS A/S	873	816	13,722	251,401	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,478	1,323	97,767	1,791,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	92	92	7,381	135,222	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	297	297	4,748	86,994	保険	
PANDORA A/S	94	81	4,127	75,610	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	103	84	4,356	79,817	素材	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMBU A/S-B	135	135	1,196	21,912	ヘルスケア機器・サービス
ORSTED A/S	154	154	12,152	222,625	公益事業
小 計	4,640	4,197	213,537	3,912,009	
銘柄数 <比率>	18	18	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	162	162	1,274	115,959	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	642	—	—	—	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,396	2,255	5,791	527,107	銀行
WESTPAC BANKING	3,189	2,837	6,836	622,264	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,384	1,273	2,495	227,103	素材
TELSTRA CORP	3,084	3,084	1,206	109,779	電気通信サービス
BRAMBLES LTD	1,378	1,080	1,184	107,843	商業・専門サービス
ASX LTD	181	145	1,186	108,005	各種金融
BHP GROUP LTD	2,523	3,972	17,349	1,579,157	素材
AMPOL LTD	206	206	701	63,840	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	1,013	92,253	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	388	376	10,131	922,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	52	35	404	36,798	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	2,334	2,334	3,359	305,823	運輸
COCHLEAR LIMITED	62	47	1,045	95,123	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,655	1,190	814	74,137	公益事業
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,523	1,340	14,297	1,301,327	銀行
RIO TINTO LTD	320	288	3,267	297,423	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	527	462	1,600	145,654	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	2,294	1,687	754	68,647	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	369	1,328	120,900	素材
ORICA LTD	382	382	633	57,676	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	493	347	631	57,503	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	298	270	4,954	450,962	各種金融
SUNCORP GROUP LIMITED	1,193	948	1,163	105,859	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,786	2,535	8,031	731,057	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	740	611	1,513	137,762	素材
OIL SEARCH LTD	1,861	—	—	—	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LIMITED	850	850	464	42,242	運輸
QBE INSURANCE GROUP	1,380	1,115	1,383	125,946	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,016	1,016	886	80,661	素材
REECE LTD	168	168	256	23,308	資本財
SANTOS	1,564	2,361	1,945	177,120	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	400	372	1,360	123,790	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	128	128	328	29,937	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	1,820	—	—	—	消費者サービス
WESFARMERS LTD	1,005	871	4,071	370,553	小売
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	744	1,461	4,406	401,060	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,099	999	3,413	310,707	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	109	—	—	—	各種金融
SEEK LTD	315	280	690	62,824	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	35	35	243	22,148	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AUSNET SERVICES	1,871	—	—	—	公益事業
MINERAL RESOURCES LTD	—	144	883	80,382	素材
CROWN RESORTS LTD	303	303	391	35,609	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	1,221	1,221	455	41,471	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	1,914	1,195	475	43,322	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	705	458	535	48,740	食品・飲料・タバコ
XERO LTD	113	113	991	90,283	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD	—	177	412	37,572	消費者サービス
AFTERPAY LTD	199	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LOTTERY CORP LTD/THE	—	1,820	873	79,520	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	1,099	796	72,523	食品・生活必需品小売り
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,698	2,321	740	67,415	保険
SOUTH32 LTD	3,411	3,411	1,606	146,245	素材
COLES GROUP LTD	1,154	1,084	1,898	172,801	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	138	138	575	52,344	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	57,250 53	51,842 51	123,056 —	11,200,637 <2.1%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,178	1,178	855	71,112	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD	363	363	366	30,481	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	668	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	545	399	779	64,785	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,731	1,731	812	67,542	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	646	646	361	30,068	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	488	40,603	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,238 7	5,424 6	3,665 —	304,593 <0.1%>
(香港)				千香港ドル	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	2,539	41,091	不動産
BANK EAST ASIA	1,091	—	—	—	銀行
CLP HOLDINGS	1,375	1,375	10,931	176,867	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	675	675	3,547	57,392	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,041	958	31,690	512,754	各種金融
MTR CORP	1,510	1,250	5,375	86,967	運輸
HANG SENG BANK	594	594	8,250	133,495	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	4,145	67,066	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,375	1,120	5,863	94,866	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	8,615	9,046	7,924	128,223	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,740	1,740	7,116	115,146	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,815	2,815	8,684	140,511	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,363	1,363	4,070	65,865	不動産
SINO LAND CO	3,154	3,154	3,551	57,461	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,185	1,080	10,465	169,326	不動産
SWIRE PACIFIC A	405	405	1,883	30,470	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,175	1,070	10,710	173,299	資本財
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,720	1,720	3,343	54,100	資本財
SJM HOLDINGS LTD	1,320	—	—	—	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	1,408	—	—	—	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,722	1,722	2,173	35,161	小売	
AIA GROUP LTD	10,452	9,338	74,003	1,197,379	保険	
SANDS CHINA LTD	1,980	1,980	2,811	45,491	消費者サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	1,200	3,612	58,442	運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,843	29,822	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,570	1,190	4,516	73,069	不動産	
ESR CAYMAN LTD	1,570	1,570	3,587	58,044	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,459	1,459	2,894	46,835	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	9,365	4,748	2,810	45,479	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,294	1,939	10,854	175,618	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,074	1,644	8,594	139,065	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68,995 30	59,102 28	247,794 —	4,009,320 <0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,474	1,474	596	55,410	資本財	
DBS GROUP	1,552	1,415	4,400	408,468	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	351	32,615	不動産	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	783	451	444	41,233	各種金融	
CAPITALAND LTD	2,235	—	—	—	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	6,150	6,150	482	44,811	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,373	1,373	933	86,660	資本財	
OCBC BANK	2,912	2,571	3,008	279,209	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	595	55,304	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	939	939	2,758	256,070	銀行	
UOL GROUP LIMITED	475	475	353	32,846	不動産	
VENTURE CORP LTD	257	257	448	41,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,522	5,845	1,578	146,494	電気通信サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	742	68,963	食品・飲料・タバコ	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	2,235	871	80,906	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	28,969 14	26,482 14	17,567 —	1,630,621 <0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェゲル			
BANK HAPOLIM BM	983	983	3,096	117,451	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,088	1,088	3,619	137,285	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	21	21	1,383	52,456	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,890	71,700	銀行	
ICL LTD	677	420	1,568	59,507	素材	
NICE LTD	58	49	3,361	127,489	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	125	1,382	52,446	銀行	
AZRIELI GROUP	43	43	1,114	42,268	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,992 8	3,726 8	17,417 —	660,605 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	947,412 1,233	848,710 1,220	— —	492,430,194 <94.1%>	

(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 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10	10	1,849	234,936	
BOSTON PROPERTIES	13	11	1,268	161,145	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20	—	—	—	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125	95	631	80,180	
PROLOGIS INC	63	57	7,302	927,506	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	11	2,390	303,581	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	7	1,123	142,700	
DUKE REALTY CORP	31	27	1,471	186,870	
CROWN CASTLE INTL CORP	36	33	6,420	815,513	
ESSEX PROPERTY TRUST	5	4	1,377	174,913	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32	27	2,120	269,339	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45	45	1,361	172,946	
WELLTOWER INC	35	32	2,952	374,972	
KIMCO REALTY CORP	—	47	1,137	144,431	
IRON MOUNTAIN INC	27	23	1,281	162,779	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16	14	1,089	138,416	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67	56	1,175	149,274	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	8	1,544	196,200	
REALTY INCOME CORP	31	44	3,062	389,015	
REGENCY CENTERS CORP	12	12	864	109,810	
UDR INC	28	24	1,179	149,761	
SIMON PROPERTY GROUP	28	25	2,902	368,632	
PUBLIC STORAGE	13	12	4,177	530,602	
SUN COMMUNITIES INC	9	9	1,506	191,334	
VENTAS INC	31	31	1,811	230,138	
VORNADO REALTY TRUST	15	11	404	51,417	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	10	1,956	248,523	
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	22	3,137	398,568	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	50	929	118,086	
AGNC INVESTMENT CORP	46	46	564	71,745	
VEREIT INC	21	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORPORATION	38	35	9,218	1,170,955	
WP CAREY INC	16	14	1,214	154,211	
INVITATION HOMES INC	51	46	1,805	229,298	
EQUINIX INC	7	7	4,939	627,351	

銘柄	当期首(前期末)		当期		期末	
	口数 (千口)	口数 (千口)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
VICI PROPERTIES INC	49	75	2,325	295,341		
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	8	2,983	378,914		
小計	1,058	1,002	81,478	10,349,418		
	銘柄数 <比率>	36	35	—	<2.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	4	238	23,851		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	352	35,193		
小計	24	20	591	59,045		
	銘柄数 <比率>	2	2	—	<0.0%>	
(フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	17	17	371	50,614		
GECINA SA	4	3	340	46,460		
COVIVIO (FP)	4	4	338	46,121		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	690	94,143		
ユーロ計	37	35	1,741	237,340		
	銘柄数 <比率>	4	4	—	<0.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	79	79	417	67,023		
SEGRO PLC	106	93	1,044	167,525		
LAND SECURITIES GROUP PLC	66	46	358	57,508		
小計	252	219	1,820	292,057		
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
MIRVAC GROUP	392	266	594	54,129		
APA GROUP	114	82	952	86,707		
GPT GROUP	167	167	799	72,736		
SYDNEY AIRPORT	124	—	—	—		
STOCKLAND	207	207	810	73,815		
DEXUS	94	94	987	89,922		
GOODMAN GROUP	139	133	2,656	241,755		
VICINITY CENTERS	365	365	684	62,317		
LENDLEASE GROUP	64	64	698	63,567		
SCENTRE GROUP	486	382	1,119	101,923		
小計	2,157	1,764	9,304	846,876		
	銘柄数 <比率>	10	9	—	<0.2%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	170	170	11,994	194,073		
HKT TRUST AND HKT LTD	375	205	2,218	35,888		

銘柄	口数 (千口)	当期首(前期末)	当 期 末	
		口数 (千口)	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220	220	1,697	27,471
小 計	766	596	15,910	257,433
	銘柄数 <比率>	3	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426	340	755	70,148
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284	284	772	71,736
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273	283	458	42,582
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220	220	389	36,144
小 計	1,203	1,127	2,376	220,612
	銘柄数 <比率>	4	—	<0.0%>
合 計	5,500	4,766	—	12,262,784
	銘柄数 <比率>	62	—	<2.3%>

(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 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外	S&P 500 EMIN	14,384	—
	S&P/TSE 60	1,277	—
	SWISS MKT IX	1,204	—
	DJ EURO STOXX	1,788	—
国	SPI 200 FUTU	556	—
	FTSE 100	340	—

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場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	492,430,194	94.0
投 資 信 託 受 益 証 券	213,635	0.0
投 資 証 券	12,049,149	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,049,920	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	523,742,898	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(521,971,770千円)の投資信託財産総額(523,742,898千円)に対する比率は99.7%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=127.02円	1カナダドル=99.87円	1ユーロ=136.29円
1イギリスポンド=160.39円	1スイスフラン=132.59円	1スウェーデンクローナ=12.94円
1ノルウェークローネ=13.40円	1デンマーククローネ=18.32円	1オーストラリアドル=91.02円
1ニュージーランドドル=83.10円	1香港ドル=16.18円	1シンガポールドル=92.82円
1イスラエルシェケル=37.927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 2022年5月30日現在
(A) 資 産	525,886,666,499円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	15,361,445,522
株 式(評価額)	492,430,194,549
投資信託受益証券(評価額)	213,635,587
投資証券(評価額)	12,049,149,251
未 収 入 金	2,520,238,732
未 収 配 当 金	778,482,292
差 入 委 託 証 拠	2,533,520,566
(B) 負 債	2,461,701,247
未 払 金	2,394,732,661
未 払 解 約 金	66,967,258
未 払 利 息	1,328
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	523,424,965,252
元 本	124,778,059,850
次 期 繰 越 損 益 金	398,646,905,402
(D) 受 益 権 総 口 数	124,778,059,850口
1万口当たり基準価額(C/D)	41,948円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	9,076,033,918円
受 取 配 当 金	9,069,884,084
受 取 利 息	160,716
そ の 他 収 益 金	19,562,796
支 払 利 息	△13,573,678
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,418,655,792
売 買 益	108,054,594,974
売 買 損	△59,635,939,182
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	737,388,472
取 引 益	2,635,676,118
取 引 損	△1,898,287,646
(D) そ の 他 費 用	△169,357,425
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	58,062,720,757
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	379,881,244,642
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	47,938,434,749
(H) 解 約 差 損 益 金	△87,235,494,746
(I) 計 (E+F+G+H)	398,646,905,402
次 期 繰 越 損 益 金(I)	398,646,905,402

(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137,722,653,603円、期中追加設定元本額は15,718,352,796円、期中一部解約元本額は28,662,946,549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。

SMT グローバル株式インデックス・オープン	31,891,617,739円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	15,863,198,047円
DC外国株式インデックス・オープン	11,770,844,166円
世界経済インデックスファンド	10,429,835,021円
DC世界経済インデックスファンド	9,650,097,206円
分散投資コア戦略ファンドS	8,037,948,513円
DCマイセクション75	4,395,959,459円
DCマイセクション50	3,623,631,364円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,890,361,169円
DCマイセクションS50	1,817,107,210円
DCマイセクションS75	1,519,066,014円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,505,554,380円
分散投資コア戦略ファンドA	1,421,677,202円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,345,785,667円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,286,512,288円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,285,687,705円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,240,448,028円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,136,804,848円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,127,752,855円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,082,356,527円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,070,221,107円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,062,514,562円
外国株式インデックス・オープン	863,039,188円
DCマイセクション25	803,273,450円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	729,877,138円
グローバル経済コア	643,200,142円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	594,961,570円
コア投資戦略ファンド(安定型)	581,693,447円
コア投資戦略ファンド(切替型)	530,929,433円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	404,580,459円
DCマイセクションS25	397,007,177円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	383,790,568円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	282,297,126円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	265,963,687円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	241,405,184円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	240,174,152円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	232,787,423円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	225,480,922円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	221,972,924円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	206,181,058円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	195,495,469円
SMT 世界経済インデックス・オープン	191,550,308円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	175,323,922円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	168,188,946円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	164,818,430円

DCターゲット・イヤー ファンド2035	163, 822, 551円
SMT インデックスバランス・オープン	156, 533, 319円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	137, 094, 789円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	132, 686, 530円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	119, 915, 396円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	118, 695, 108円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	99, 941, 540円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	87, 519, 316円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	72, 625, 573円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	56, 668, 260円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	56, 281, 250円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	52, 688, 817円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	45, 940, 393円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	33, 521, 145円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	33, 352, 178円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	32, 345, 308円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30, 330, 368円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	29, 915, 264円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	28, 835, 745円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	15, 432, 161円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	14, 319, 329円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13, 209, 075円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11, 496, 228円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11, 319, 798円
SBI資産設計オープン(分配型)	6, 439, 733円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5, 903, 238円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	4, 732, 946円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	3, 828, 753円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3, 692, 539円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2022年6月27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2021年7月8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	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)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割合には制限を設けません。

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1万口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	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	期中騰落率	円	期中騰落率				
設定日(2021年7月8日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 1,499
第1期(2022年6月27日)	11,016	10.2	11,169	11.7	91.0	6.4	2.4	1,721

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)です。

MSCIコクサイESGリーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務は一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

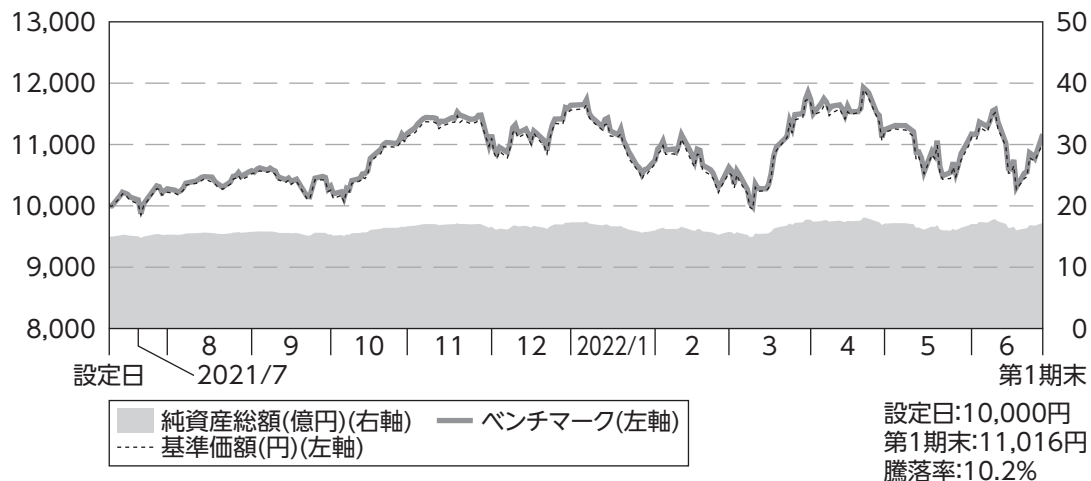
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託 証券組入比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
(設 定 日) 2021年 7月 8日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% —	
7月末	10,221	2.2	10,278	2.8	91.8	5.8	2.2		
8月末	10,524	5.2	10,573	5.7	91.9	5.4	2.2		
9月末	10,255	2.6	10,317	3.2	92.1	5.4	2.2		
10月末	11,129	11.3	11,180	11.8	91.9	5.4	2.2		
11月末	11,100	11.0	11,160	11.6	91.8	5.4	2.2		
12月末	11,561	15.6	11,639	16.4	93.5	3.8	2.3		
2022年 1月末	10,687	6.9	10,744	7.4	93.4	3.9	2.3		
2月末	10,534	5.3	10,628	6.3	93.3	3.9	2.2		
3月末	11,676	16.8	11,734	17.3	91.9	5.4	2.3		
4月末	11,199	12.0	11,242	12.4	91.2	5.9	2.4		
5月末	11,119	11.2	11,170	11.7	90.6	6.9	2.3		
(当 期 末) 2022年 6月27日	11,016	10.2	11,169	11.7	91.0	6.4	2.4		

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2021年7月8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MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、概ね良好な企業決算や米国で年末商戦期の小売売上高が好調であったと報じられたことなどが好感され、2021年末にかけて上昇しました。2022年3月上旬にかけては、ロシアのウクライナ侵攻開始を受けた欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速が懸念されたことなどを背景に下落しました。その後は一時反発する場面もありましたが、期末にかけては世界的なインフレ高進を受けて各国中央銀行が金融引き締めを加速させるとの警戒感が強まったことなどから一段安となりました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨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MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)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。

(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

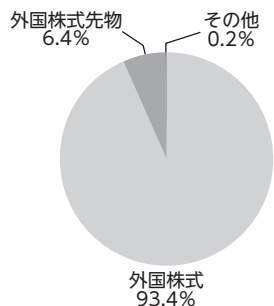
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	7.5%
2	S&P 500 EMIN 2209	アメリカ	6.1%
3	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	2.8%
4	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	2.6%
5	TESLA INC	アメリカ	2.5%
6	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.9%

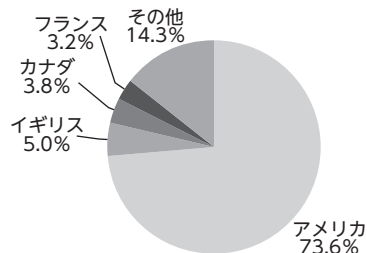
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	NVIDIA CORP	アメリカ	1.7%
8	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	1.4%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	1.3%
10	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	1.1%
組入銘柄数		593	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

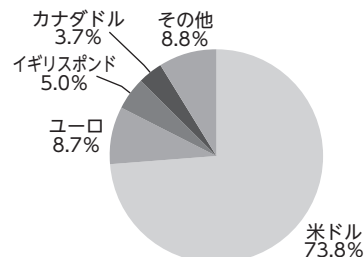
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

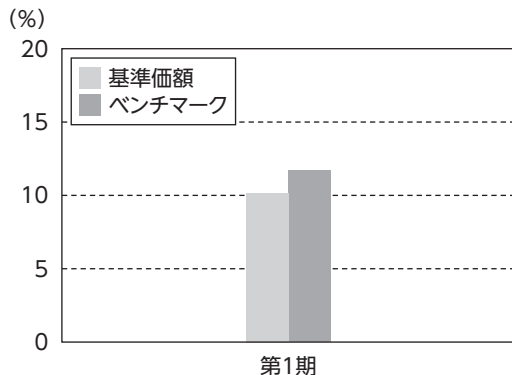


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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6.4%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、為替評価差要因*1、配当課税要因*2および取引コスト要因(いずれもマイナス要因)です。

※1 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

※2 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

主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年7月8日~2022年6月27日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	2円 (1) (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.015% (0.012) (-) (-) (0.000) (-) (0.003)	(a) 売買委託手数料= $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}$ ×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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	4 (4) (-) (-) (-) (0)	0.039 (0.038) (-) (-) (-) (0.001)	(b) 有価証券取引税= $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}$ ×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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	29 (29) (-) (0)	0.264 (0.262) (-) (0.003)	(c) その他費用= $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}$ ×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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	35	0.318	

(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(10,909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	ア メ リ カ	百株 731 (11)	千米ドル 9,787 (6)	百株 38 (0.43)	千米ドル 415 (11)
	カ ナ ダ	124 (2)	千カナダドル 796 (-)	31	千カナダドル 127
	ド イ ツ	44 (-)	千ユーロ 341 (△0.26018)	11	千ユーロ 64
	イ タ リ ア	127	67	5	8
	フ ラ ン ス	70 (2)	380 (-)	2	7
	オ ラ ン ダ	66 (4)	246 (△0.06216)	13	15
	ス ペ イ ン	96 (28)	77 (0.46369)	20 (27)	7 (0.46369)
	ベ ル ギ ー	3	25	0.86	5
	オ ー ス ト リ ア	4	17	2	6
	ル ク セ ン ブ ル ク	2	1	-	-
	フ ィ ン ラ ン ド	14	46	-	-
	ア イ ル ラ ン ド	6	36	-	-
	ポ ル ト ガ ル	3	4	-	-
国	イ ギ リ ス	909 (10)	千イギリスポンド 495 (△0.21889)	37	千イギリスポンド 13
	ス イ ス	21 (0.69)	千スイスフラン 367 (2)	0.85 (0.24)	千スイスフラン 38 (2)
	ス ウ ェ ー デ ン	93 (25)	千スウェーデンクローナ 1,665 (-)	9	千スウェーデンクローナ 115
	ノ ル ウ ェ ー	27	千ノルウェークローネ 439	-	千ノルウェークローネ -
	デ ン マ ー ク	20	千デンマーククローネ 1,111	2	千デンマーククローネ 36
	オ ー ス ト ラ リ ア	203 (1)	千オーストラリアドル 410 (0.74269)	22 (1)	千オーストラリアドル 22 (0.19864)
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	28	千ニュージーランドドル 24	2	千ニュージーランドドル 1

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香 港	257	千香港ドル 1,124	16	千香港ドル 226
	シ ン ガ ポ ー ル	99 (12)	千シンガポールドル 89 (2)	60 (12)	千シンガポールドル 55 (4)
	イ ス ラ エ ル	12	千イスラエルシェケル 30	5	千イスラエルシェケル 16

(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
外 国					
	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	BOSTON PROPERTIES	0.07	7	—	—
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	0.675	5	—	—
	PROLOGIS INC	0.352	43	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	0.205	41	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	0.165	13	0.165	12
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.25	8	—	—
	WELLTOWER INC	0.19	16	—	—
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	0.34	5	0.34	6
	VENTAS INC	0.25	14	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	0.236	65	—	—
	EQUINIX INC	0.042	34	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.065	21	—	—
	小 計	2	277	0.505	19
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.042	2	—	—
	小 計	0.042	2	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	KLEPIERRE	0.102 (—)	2 (△0.1734)	—	—
	GECINA SA	0.022	2	—	—
	COVIVIO(FP)	0.026	1	—	—

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.06	4	—	—
	小 計	0.21 (—)	11 (△0.1734)	—	—
	ユ ー ロ 計	0.21 (—)	11 (△0.1734)	—	—
	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	0.434	2	—	—
	SEGRO PLC	0.571	6	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	0.5	3	—	—
	小 計	1	12	—	—
	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	1	5	—	—
	APA GROUP	0.561	5	—	—
	GPT GROUP	0.927	4	—	—
	SYDNEY AIRPORT	0.629	4	0.629	5
	STOCKLAND	1	5	—	—
	DEXUS	0.517	5	—	—
	GOODMAN GROUP	0.791	16	—	—
	VICINITY CENTERS	1	3	—	—
	LENLEASE GROUP	0.327	3	—	—
	SCENTRE GROUP	3	9	—	—
	小 計	11	63	0.629	5
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	HKT TRUST AND HKT LTD	2	21	—	—
	小 計	2	21	—	—
	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2 (0.185)	4 (0.3101)	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (0.031)	— (0.03475)	0.031	0.03792
	小 計	2 (0.216)	4 (0.34485)	0.031	0.03792

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は合併・分割・減資・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。

<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 570	百万円 470	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,659,271千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,513,188千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.09

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 1,607	百万円 -	% -	百万円 42	百万円 0.699512	% 1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,442	25	0.7	3,440	24	0.7

(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 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル		
ABIOMED INC	0.21	5	721	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4	60	8,146	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	2	88	11,951	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	2	41	5,603	保険
ALLSTATE CORP	1	18	2,481	保険
AMGEN	2	67	9,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS	3	47	6,413	各種金融
AFLAC	3	17	2,350	保険
AMERICAN INT'L GROUP	4	21	2,940	保険
AMERCO	0.04	1	259	運輸
VALERO ENERGY CORP	1	20	2,742	エネルギー
ANSYS INC	0.41	10	1,418	ソフトウェア・サービス
APPLIED MATERIALS	4	42	5,727	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	1	20	2,720	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	2	44	6,008	ソフトウェア・サービス
BALL CORP	1	11	1,503	素材
BANK NEW YORK CO	3	17	2,341	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	2	16	2,166	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	21	109	14,686	電気通信サービス
BEST BUY COMPANY INC	1	8	1,126	小売
ROBERT HALF INTL INC	0.55	4	576	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	1	4	557	自動車・自動車部品
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0.65	6	908	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0.55	7	989	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.11	12	1,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10	84	11,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	2	11	1,564	エネルギー
UNITED RENTALS INC	0.34	8	1,136	資本財
SEMPRA ENERGY	1	22	3,037	公益事業
QUANTA SERVICES INC	0.75	9	1,271	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	5	3	426	メディア・娯楽
CSX CORP	10	32	4,346	運輸
CAMPBELL SOUP CO (US)	0.96	4	625	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	1	7	1,033	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CATERPILLAR	2	53	7,240	資本財
CITRIX SYSTEMS INC	0.59	5	767	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	7	7	1,061	電気通信サービス
CIGNA CORP	1	44	5,960	ヘルスケア機器・サービス
CISCO SYSTEMS	20	88	11,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	0.6	8	1,136	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	20	129	17,395	食品・飲料・タバコ
COPART INC	1	11	1,549	商業・専門サービス
COGNEX CORP	0.85	3	519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	3	30	4,165	家庭用品・パーソナル用品
CONAGRA BRANDS INC	2	7	1,055	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	1	15	2,051	公益事業
CUMMINS INC	0.7	13	1,837	資本財
MOODY'S CORP	0.8	22	2,988	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	2	35	4,819	小売
DEERE&CO	1	44	5,942	資本財
MORGAN STANLEY	6	52	7,039	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	1	15	2,063	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	9	88	11,951	メディア・娯楽
DOVER CORP	0.69	8	1,144	資本財
EBAY	3	14	1,997	小売
EATON CORP	1	25	3,371	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	1	20	2,821	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	1	22	3,094	素材
ELECTRONIC ARTS INC	1	17	2,401	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	4	90	12,238	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	0.62	6	911	公益事業
ESTEE LAUDER CO-CL A	1	29	3,964	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	0.81	8	1,095	運輸
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.18	7	951	各種金融
ASSURANT INC	0.28	4	651	保険
FASTENAL CO	2	14	1,921	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	1	3	504	各種金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1	20	2,736	保険
DENTSPLY SIRONA INC	1	3	524	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL MILLS INC	2	20	2,709	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	0.69	9	1,270	小売
GILEAD SCIENCES INC	5	37	5,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期末			業種
	株数 (百株)	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NVIDIA CORP	12	214	28,908	半導体・半導体製造装置
GRAINGER (WW) INC	0.21	9	1,303	資本財
HALLIBURTON CO	4	14	1,987	エネルギー
HASBRO INC	0.63	5	727	耐久消費財・アパレル
HP INC	5	21	2,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	1	8	1,183	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	5	144	19,504	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	0.87	7	1,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	1	6	911	食品・飲料・タバコ
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.16	3	438	資本財
HUMANA INC	0.61	27	3,750	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	0.45	7	982	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	7	8	1,178	銀行
BIOGEN INC	0.72	15	2,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	0.36	6	899	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	1	28	3,819	資本財
INTUIT INC	1	54	7,308	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	0.41	14	1,995	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	20	79	10,680	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1	14	1,944	素材
INT'L PAPER CO	1	7	1,032	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1	5	711	メディア・娯楽
JOHNSON & JOHNSON	13	244	32,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	1	11	1,520	保険
KELLOGG CO	1	8	1,180	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	4	8	1,120	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	1	21	2,914	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	0.73	47	6,365	各種金融
KROGER CO	3	16	2,263	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	0.68	30	4,120	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	2	5	687	資本財
LILLY (ELI) & CO	4	134	18,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	0.88	4	580	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	3	68	9,203	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	1	17	2,367	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOEWS CORP	1	6	885	保険
LOWES COMPANIES	3	63	8,565	小売
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1	10	1,407	食品・飲料・タバコ

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MCDONALD'S CORP	3	92	12,513	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	1	60	8,140	各種金融
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2	28	3,890	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	2	38	5,173	保険
MASCO CORP	1	6	864	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.34	10	1,417	素材
MERCK & CO	12	118	15,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	0.46	11	1,501	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	35	953	128,357	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	2	37	4,990	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.8	17	2,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	0.94	18	2,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	1	3	501	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	3	24	3,300	素材
NIKE B	6	72	9,788	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	1	27	3,722	運輸
EVERSOURCE ENERGY	1	13	1,840	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	0.95	9	1,241	各種金融
NUCOR CORP	1	15	2,137	素材
CHENIERE ENERGY INC	1	14	1,976	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.5	12	1,734	運輸
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.35	9	1,219	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	6	114	15,475	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	0.8	3	506	資本財
ESSENTIAL UTILITIES INC	1	5	699	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2	32	4,427	銀行
PPG INDUSTRIES INC	1	13	1,840	素材
PRICE T ROWE GROUP INC	1	13	1,782	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS	0.64	8	1,208	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	12	176	23,744	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	2	32	4,356	保険
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	0.88	8	1,095	各種金融
RESMED INC	0.69	14	1,964	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	6	32	4,356	銀行
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1	8	1,183	保険
ROLLINS INC	1	4	567	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	0.5	20	2,744	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	0.55	11	1,488	資本財

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ACCENTURE PLC-CL A	3	90	12,170	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	0.61	12	1,682	保険
TRAVELERS COS INC/THE	1	20	2,693	保険
SCHLUMBERGER	6	23	3,157	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	7	50	6,747	各種金融
POOL CORP	0.19	6	912	小売
BUNGE LIMITED	0.68	6	809	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	1	58	7,906	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	0.74	10	1,478	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1	8	1,208	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	27	3,766	素材
SVB FINANCIAL GROUP	0.34	14	1,901	銀行
SMITH (A. O.) CORP	0.75	4	563	資本財
SNAP-ON INC	0.26	5	706	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1	18	2,491	保険
ADVANCE AUTO PARTS	0.31	5	764	小売
EDISON INTL	1	11	1,538	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	6	31	4,260	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1	14	2,017	資本財
STATE STREET CORP	1	11	1,498	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	1	7	945	素材
NORTONLIFELOCK INC	3	6	907	ソフトウェア・サービス
TELEFLEX INC	0.22	5	764	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	4	68	9,194	半導体・半導体製造装置
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1	107	14,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAVITA INC	0.34	2	354	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	0.56	11	1,530	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS	1	7	985	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UGI CORP	1	4	541	公益事業
UNION PACIFIC CORP	3	68	9,265	運輸
VF CORP	1	7	1,027	耐久消費財・アパレル
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1	36	4,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WATERS CORP	0.29	9	1,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	1	6	906	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.35	10	1,418	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAIL RESORTS INC	0.19	4	594	消費者サービス
WEYERHAEUSER CO	3	12	1,658	不動産
NASDAQ INC	0.55	8	1,179	各種金融

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CME GROUP INC	1	35	4,833	各種金融
WILLIAMS COS	5	17	2,354	エネルギー
LKQ CORP	1	6	934	小売
CARMAX INC	0.78	7	1,032	小売
TJX COMPANIES INC	5	34	4,646	小売
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.25	7	1,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CBRE GROUP INC-A	1	11	1,525	不動産
REGIONS FINL CORP	4	9	1,214	銀行
MOSAIC CO/THE	1	8	1,097	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.18	4	672	各種金融
CELANESE CORP-SERIES A	0.61	7	1,047	素材
DEXCOM INC	1	14	1,923	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	0.56	13	1,879	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2	26	3,532	各種金融
MASTERCARD INC-CLASS A	4	145	19,574	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	2	3	451	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	0.51	3	519	資本財
DELTA AIR LINES INC	0.78	2	327	運輸
INSULET CORP	0.31	7	950	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1	13	1,868	各種金融
LULULEMON ATHLETICA INC	0.59	17	2,329	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	1	16	2,175	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	0.21	15	2,090	小売
ULTA BEAUTY INC	0.3	12	1,657	小売
INVESCO LTD	1	3	443	各種金融
VISA INC-CLASS A SHARES	8	172	23,154	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	0.87	12	1,737	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	3	26	3,586	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	0.67	4	570	資本財
KINDER MORGAN INC	10	17	2,380	エネルギー
XYLEM INC	0.86	6	921	資本財
SPLUNK INC	0.9	8	1,185	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	1	23	3,166	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0.29	4	599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	0.83	12	1,641	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	1	21	2,916	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	1	7	970	エネルギー
LEAR CORP	0.38	5	686	自動車・自動車部品

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	0.52	5	804	各種金融
TESLA INC	4	325	43,757	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	0.3	6	906	資本財
ALLY FINANCIAL INC	1	6	851	各種金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	0.6	11	1,525	各種金融
APTIV PLC	1	12	1,685	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	2	17	2,368	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	0.54	4	566	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	1	50	6,853	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	2	39	5,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KEURIG DR PEPPER INC	4	17	2,310	食品・飲料・タバコ
BAKER HUGHES CO	5	14	1,939	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	0.9	4	570	運輸
BURLINGTON STORES INC	0.31	4	667	小売
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3	7	943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGION PLC	0.44	4	589	資本財
STERIS PLC	0.48	9	1,343	ヘルスケア機器・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1	15	2,089	消費者サービス
AMCOR PLC	7	9	1,259	素材
CARRIER GLOBAL CORP	4	15	2,149	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	2	15	2,098	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	0.78	2	358	各種金融
INGERSOLL-RAND INC	2	9	1,224	資本財
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1	3	508	自動車・自動車部品
WARNER BROS DISCOVERY INC	10	15	2,072	メディア・娯楽
ZENDESK INC	0.68	5	678	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	2	7	1,015	メディア・娯楽
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	7	2	272	運輸
CATALENT INC	0.82	8	1,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	3	10	1,391	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1	7	947	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	0.89	12	1,682	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	0.25	8	1,156	ソフトウェア・サービス
BIO-TECHNE CORP	0.18	6	854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KORNIT DIGITAL LTD	0.24	0.8736	117	資本財
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	3	16	2,266	資本財
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	1	5	742	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	0.65	2	325	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期末			業種
	株数 (百株)	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
WESTROCK CO	1	6	853	素材
NOVOCURE LTD	0.44	3	447	ヘルスケア機器・サービス
FORTIVE CORP	1	8	1,166	資本財
ALPHABET INC-CL A	1	356	47,959	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	6	8	1,186	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EQUITABLE HOLDINGS INC	1	5	696	各種金融
ALPHABET INC-CL C	1	331	44,677	メディア・娯楽
CABLE ONE INC	0.03	3	511	メディア・娯楽
LINDE PLC	2	75	10,163	素材
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	703 271	8,555 —	1,151,595 <66.9%>
(カナダ)		千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	2	16	1,692	素材
BANK MONTREAL	3	37	3,927	銀行
BANK NOVA SCOTIA	5	43	4,520	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	1	13	1,394	銀行
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	7	44	4,632	各種金融
CAE INC	1	4	458	資本財
CAMECO CORP	1	5	586	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1	10	1,099	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP -CL A	0.27	4	467	小売
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2	40	4,221	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	0.97	3	373	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	1	7	798	ソフトウェア・サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	0.54	4	447	商業・専門サービス
FORTIS INC	2	13	1,389	公益事業
TELUS CORP	2	5	602	電気通信サービス
ENBRIDGE	9	51	5,387	エネルギー
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	4	22	2,311	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	1	10	1,057	自動車・自動車部品
METRO INC	1	8	854	食品・生活必需品小売り
POWER CORP OF CANADA	4	13	1,404	保険
LUNDIN MINING CORP	3	2	288	素材
THOMSON REUTERS CORP	0.83	11	1,160	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	0.4	4	420	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	9	79	8,291	銀行
KINROSS GOLD CORP	6	3	330	素材
INTACT FINANCIAL CORP	1	21	2,218	保険

銘	柄	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		2	10	1,104	素材
KEYERA CORP		1	3	329	エネルギー
PARKLAND CORP		0.74	2	255	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		2	11	1,213	エネルギー
NORTHLAND POWER INC		1	5	606	公益事業
IVANHOE MINES LTD-CL A		4	3	350	素材
NUTRIEN LTD		2	28	2,921	素材
FIRSTSERVICE CORP		0.19	3	315	不動産
SHOPIFY INC - CLASS A		0.55	27	2,849	ソフトウェア・サービス
HYDRO ONE LTD		1	5	564	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	94	583	60,849	
	銘 柄 数 <比 率>	36	—	<3.5%>	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG		0.9	15	2,177	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		4	3	513	銀行
GEA GROUP AG		1	3	471	資本財
MERCK KGAA		0.61	10	1,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAP SE		5	46	6,556	ソフトウェア・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		0.5	2	419	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE		0.51	3	484	耐久消費財・アパレル
HENKEL AG & CO KGAA -PFD		0.85	5	728	家庭用品・パーソナル用品
BEIERSDORF AG		0.48	4	667	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		0.71	3	488	素材
ALLIANZ SE-REG		1	35	5,095	保険
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		1	11	1,681	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		0.28	1	275	自動車・自動車部品
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		0.29	3	470	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE		0.9	14	2,010	各種金融
MTU AERO ENGINES AG		0.25	4	616	資本財
SYMRISE AG		0.61	6	920	素材
BRENNTAG SE		0.74	4	639	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		1	3	450	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		5	1	211	電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE		0.4	3	480	不動産
ZALANDO SE		1	3	503	小売
HELLOFRESH SE		1	3	523	食品・生活必需品小売り
DELIVERY HERO SE		0.75	2	421	小売
国 小 計	株 数 ・ 金 額	32	198	28,236	
	銘 柄 数 <比 率>	24	—	<1.6%>	

銘	柄	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(イタリア)					
	INTESA SANPAOLO	77	14	2,081	銀行
	ENEL	39	21	3,053	公益事業
	AMPLIFON SPA	0.59	1	249	ヘルスケア機器・サービス
	PRYSMIAN SPA	1	3	543	資本財
	NEXI SPA	3	3	456	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額	122	44	6,384	
	銘 柄 数 <比 率>	5	—	<0.4%>	
(フランス)					
	BOUYGUES ORD	1	3	486	資本財
	AIR LIQUIDE	2	37	5,364	素材
	LOREAL	1	40	5,693	家庭用品・パーソナル用品
	PUBLICIS GROUPE	1	4	708	メディア・娯楽
	MICHELIN	3	8	1,207	自動車・自動車部品
	SEB SA	0.13	1	172	耐久消費財・アパレル
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2	33	4,742	資本財
	VIVENDI SE	3	3	486	メディア・娯楽
	TOTALENERGIES SE	12	63	9,009	エネルギー
	VALEO SA	1	2	301	自動車・自動車部品
	ORANGE	9	10	1,506	電気通信サービス
	KERING	0.36	18	2,569	耐久消費財・アパレル
	CARREFOUR	2	5	717	食品・生活必需品小売り
	ACCOR	0.83	2	332	消費者サービス
	SOCIETE GENERALE	3	8	1,256	銀行
	TELEPERFORMANCE	0.28	8	1,169	商業・専門サービス
	AXA SA	9	20	2,938	保険
	ESSILORLUXOTTICA	1	19	2,809	耐久消費財・アパレル
	BNP PARIBAS	5	25	3,635	銀行
	DANONE (GROUPE)	3	16	2,315	食品・飲料・タバコ
	ALSTOM	1	3	447	資本財
	EIFFAGE	0.4	3	505	資本財
	BUREAU VERITAS SA	1	3	515	商業・専門サービス
	BIOMERIEUX	0.6	5	778	ヘルスケア機器・サービス
	WORLDLINE SA	1	4	684	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額	71	354	50,356	
	銘 柄 数 <比 率>	25	—	<2.9%>	
(オランダ)					
	RANDSTAD NV	0.58	2	390	商業・専門サービス

銘柄		当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
KONINKLIJKE AHOLD NV		4	12	1,765	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		0.91	5	833	素材
WOLTERS KLUWER		1	11	1,640	商業・専門サービス
KONINKLIJKE DSM NV		0.82	11	1,604	素材
ASML HOLDING NV		2	100	14,254	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)		16	5	782	電気通信サービス
ING GROEP NV-CVA		18	18	2,580	銀行
CNH INDUSTRIAL NV		4	5	781	資本財
PROSUS		4	23	3,346	小売
JDE PEET'S BV		0.38	0.9842	139	食品・飲料・タバコ
IMCD NV		0.3	3	548	資本財
NN GROUP NV		1	5	818	保険
国 小 計	株 数 ・ 金 額	56	207	29,487	
	銘柄 数 <比 率>	13	—	<1.7%>	
(スペイン)					
IBERDROLA SA		28	28	4,037	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA		32	13	1,973	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		1	3	522	公益事業
REPSOL SA		7	9	1,370	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		2	3	533	公益事業
INDITEX		5	11	1,600	小売
国 小 計	株 数 ・ 金 額	75	70	10,038	
	銘柄 数 <比 率>	6	—	<0.6%>	
(ベルギー)					
UMICORE		0.93	3	429	素材
D' IETEREN GROUP		0.19	2	365	小売
KBC GROEP NV		1	6	937	銀行
SOLVAY SA		0.35	2	396	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額	2	14	2,128	
	銘柄 数 <比 率>	4	—	<0.1%>	
(オーストリア)					
OMV AG		0.69	3	437	エネルギー
VERBUND AG		0.47	4	631	公益事業
VOESTALPINE AG		0.55	1	164	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額	1	8	1,233	
	銘柄 数 <比 率>	3	—	<0.1%>	
(ルクセンブルク)					
TENARIS SA		2	2	394	エネルギー
国 小 計	株 数 ・ 金 額	2	2	394	
	銘柄 数 <比 率>	1	—	<0.0%>	

銘柄	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(フィンランド)				
KESKO OYJ-B SHS	1	2	393	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	2	1	235	資本財
UPM KYMMENE OYJ	2	7	1,044	素材
STORA ENSO OYJ R	2	4	591	素材
SAMPO OYJ-A SHS	2	10	1,561	保険
ELISA A	0.67	3	494	電気通信サービス
NESTE OIL OYJ	1	8	1,173	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	0.5	1	267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額	14	40	5,762
	銘柄 数 <比 率>	8	—	<0.3%>
(アイルランド)				
KINGSPAN GROUP PLC	0.73	4	613	資本財
CRH PLC	3	12	1,735	素材
KERRY GROUP PLC-A	0.75	6	976	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1	5	710	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額	6	28	4,035
	銘柄 数 <比 率>	4	—	<0.2%>
(ポルトガル)				
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	2	2	378	エネルギー
JERONIMO MARTINS	1	2	330	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額	3	4	708
	銘柄 数 <比 率>	2	—	<0.0%>
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	391	977	138,767
	銘柄 数 <比 率>	95	—	<8.1%>
(イギリス)				
ANTOFAGASTA PLC	1	2	375	素材
ASHTREAD GROUP PLC	2	7	1,248	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	4	2	385	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	1	4	742	資本財
CRODA INTERNATIONAL PLC	0.67	4	697	素材
SCHRODERS PLC	0.61	1	278	各種金融
DCC PLC	0.48	2	396	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	0.94	1	308	素材
COMPASS GROUP PLC	8	14	2,376	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	102	54	9,072	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	28	6	1,152	保険
UNILEVER PLC	12	46	7,676	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	評 価 額			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1	2	464	食品・飲料・タバコ	
PEARSON	3	2	451	メディア・娯楽	
PERSIMMON PLC	2	3	627	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL	14	14	2,372	保険	
VODAFONE GROUP PLC	127	16	2,663	電気通信サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3	21	3,486	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	9	20	3,338	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	8	4	712	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	2	2	493	各種金融	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	336	14	2,412	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	17	2	347	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	36	9	1,556	食品・生活必需品小売り	
GSK PLC	23	41	6,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WPP PLC	5	4	786	メディア・娯楽	
ASTRAZENECA	7	86	14,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	42	8	1,327	電気通信サービス	
NATIONAL GRID PLC	20	21	3,620	公益事業	
INTERTEK GROUP PLC	0.77	3	549	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	1	3	546	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	0.63	3	622	小売	
KINGFISHER PLC	10	2	410	小売	
SAINSBURY (J) PLC	8	1	285	食品・生活必需品小売り	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	0.54	2	333	耐久消費財・アパレル	
INTERCONTINENTAL HOTELS	0.88	3	639	消費者サービス	
WHITBREAD PLC	0.98	2	413	消費者サービス	
ABRDN PLC	10	1	300	各種金融	
MONDI PLC	2	3	570	素材	
OCADO GROUP PLC	4	3	575	食品・生活必需品小売り	
COCA-COLA HBC AG-CDI	0.98	1	293	食品・飲料・タバコ	
FERGUSON PLC	1	9	1,625	資本財	
INFORMA PLC	7	3	650	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	0.35	3	560	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	881	477	78,876	
	銘柄 数 <比率>	44	—	<4.6%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	0.68	15	2,172	素材	
SGS SA	0.03	6	929	商業・専門サービス	
GEBERIT AG-REG	0.18	8	1,206	資本財	

銘柄	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	評 価 額			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.01	9	1,349	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	0.05	16	2,326	素材	
ABB LTD	8	21	2,966	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS	3	110	15,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	0.75	2	356	商業・専門サービス	
CLARIANT AG-REG	1	1	269	素材	
TEMENOS AG - REG	0.8	6	954	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG	0.26	8	1,129	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	0.26	5	826	運輸	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.5	5	774	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	0.36	18	2,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.15	7	995	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	2	25	3,546	耐久消費財・アパレル	
SWISS RE LTD	1	10	1,510	保険	
VIFOR PHARMA AG/NEW	0.24	3	554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	21	284	40,014	
	銘柄 数 <比 率>	18	—	<2.3%>	
(スウェーデン)					千スウェーデンクローナ
ATLAS COPCO A	15	150	1,994	資本財	
SKF AB-B	1	26	357	資本財	
SCA SV CELLULOSA B	2	43	584	素材	
HOLMEN AB-B SHARES	0.69	29	386	素材	
TELE2 AB-B SHS	2	27	359	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	1	14	189	耐久消費財・アパレル	
HENNES & MAURITZ B	3	42	558	小売	
ASSA ABLOY AB-B	4	100	1,340	資本財	
ERICSSON (LM) B	14	113	1,505	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	5	89	1,190	資本財	
TELIA CO AB	12	49	653	電気通信サービス	
BOLIDEN AB	1	42	566	素材	
ALFA LAVAL AB	1	36	487	資本財	
HUSQVARNA AB-B SHS	1	14	198	資本財	
ATLAS COPCO B	7	62	825	資本財	
EPIROC AB-A	3	52	696	資本財	
EPIROC AB-B	2	27	361	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	2	75	1,002	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	1	40	544	各種金融	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	6	48	648	資本財	

銘柄		当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NORDEA BANK ABP		15	143	1,903	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	109	1,231	16,353	
	銘柄 数 <比 率>	21	—	<1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
NORSK HYDRO		6	38	521	素材
TELENOR ASA		3	43	588	電気通信サービス
ORKLA		3	26	362	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		5	162	2,206	エネルギー
MOWI ASA		2	46	636	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA		1	33	451	エネルギー
SALMAR ASA		0.45	29	403	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		1	20	281	保険
DNB BANK ASA		4	77	1,051	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	27	477	6,503	
	銘柄 数 <比 率>	9	—	<0.4%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
A P MOLLER-MAERSK A/S-B		0.03	51	979	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A		0.02	33	642	運輸
GN STORE NORD A/S		0.62	15	289	ヘルスケア機器・サービス
GENMAB A/S		0.31	69	1,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		1	41	798	素材
DEMANT A/S		0.53	15	292	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSSEMS A/S		4	79	1,516	資本財
NOVO NORDISK A/S-B		8	644	12,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B		0.57	46	882	ヘルスケア機器・サービス
PANDORA A/S		0.48	22	430	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S		0.51	26	512	素材
ORSTED A/S		0.9	66	1,262	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	18	1,112	21,235	
	銘柄 数 <比 率>	12	—	<1.2%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		0.87	6	578	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP		13	29	2,757	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		8	13	1,294	素材
TELSTRA CORP		19	7	716	電気通信サービス
BRAMBLES LTD		6	7	706	商業・専門サービス
ASX LTD		0.92	7	701	各種金融
COMPUTERSHARE LIMITED		2	6	567	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期末			業種	
	株数 (百株)	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
REA GROUP LTD	0.25	2	265	メディア・娯楽	
TRANSURBAN GROUP	18	26	2,509	運輸	
COCHLEAR LIMITED	0.31	6	562	ヘルスケア機器・サービス	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	8	76	7,123	銀行	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2	9	891	消費者サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1	5	538	素材	
ORICA LTD	2	3	287	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD	2	3	363	素材	
MACQUARIE GROUP LIMITED	1	26	2,504	各種金融	
SUNCORP GROUP LIMITED	7	8	769	保険	
NEWCREST MINING LIMITED	3	8	830	素材	
QBE INSURANCE GROUP	7	8	786	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	5	4	390	素材	
SANTOS	17	12	1,206	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	2	7	668	ヘルスケア機器・サービス	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4	14	1,303	エネルギー	
SEEK LTD	1	3	315	メディア・娯楽	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	0.54	3	332	消費者サービス	
MINERAL RESOURCES LTD	0.8	3	358	素材	
EVOLUTION MINING LTD	8	2	267	素材	
AURIZON HOLDINGS LTD	8	3	306	運輸	
XERO LTD	0.62	5	473	ソフトウェア・サービス	
IDP EDUCATION LTD	1	4	390	消費者サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	12	8	832	食品・生活必需品小売り	
COLES GROUP LTD	6	11	1,051	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	181	351	32,650	
	銘柄数 <比率>	32	—	<1.9%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	5	4	366	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	2	5	454	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	8	4	353	電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	3	1	152	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD	6	2	226	公益事業	
小計	株数・金額	26	18	1,553	
	銘柄数 <比率>	5	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5	24	415	公益事業	
MTR CORP	5	20	351	運輸	

銘柄		当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HANG SENG BANK		3	41	710	銀行
HONG KONG & CHINA GAS		50	41	717	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS -R		15	46	797	銀行
SINO LAND CO		20	22	384	不動産
SWIRE PACIFIC A		5	23	396	不動産
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		10	14	242	小売
AIA GROUP LTD		62	499	8,570	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		6	11	195	不動産
WH GROUP LTD		60	33	576	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	241	778	13,357	
	銘柄 数 <比 率>	11	—	<0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CITY DEVELOPMENTS LTD		2	1	158	不動産
SINGAPORE EXCHANGE LTD		4	3	367	各種金融
KEPPEL CORP LTD		7	4	446	資本財
SINGAPORE AIRLINES		6	3	300	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		6	15	1,538	銀行
UOL GROUP LIMITED		2	1	142	不動産
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		12	4	448	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	39	35	3,402	
	銘柄 数 <比 率>	7	—	<0.2%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		6	21	848	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	6	21	848	
	銘柄 数 <比 率>	1	—	<0.0%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,742	—	1,566,009	
	銘柄 数 <比 率>	562	—	<91.0%>	

(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	口数 (千口)	当期評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
		末	
(アメリカ)		千米ドル	
BOSTON PROPERTIES	0.07	6	866
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	0.675	4	575
PROLOGIS INC	0.352	43	5,808
CROWN CASTLE INTL CORP	0.205	35	4,828
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.25	6	878
WELLTOWER INC	0.19	15	2,132
VENTAS INC	0.25	12	1,724
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.236	61	8,312
EQUINIX INC	0.042	28	3,896
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.065	21	2,867
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	2 10	236 — <1.9%>
(カナダ)		千カナダドル	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.042	1	196
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	0.042 1	1 — <0.0%>
(フランス)		千ユーロ	
KLEPIERRE	0.102	2	300
GECINA SA	0.022	2	291
COVIVIO (FP)	0.026	1	210
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.06	3	443
ユーロ計	口数・金額 銘柄数 <比率>	0.21 4	8 — <0.1%>
(イギリス)		千イギリスポンド	
BRITISH LAND CO PLC	0.434	2	354
SEGRO PLC	0.571	5	968
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.5	3	591
小計	口数・金額 銘柄数 <比率>	1 3	11 — <0.1%>
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP	1	3	371
APA GROUP	0.561	6	599
GPT GROUP	0.927	4	381
STOCKLAND	1	4	406
DEXUS	0.517	4	448
GOODMAN GROUP	0.791	14	1,373

銘	柄	当 期 末		
		口 数 (千口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
VICINITY CENTERS		1	3	337
LENLEASE GROUP		0.327	3	279
SCENTRE GROUP		3	8	784
小 計	口 数 ・ 金 額	11	53	4,982
	銘 柄 数 <比 率>	9	—	<0.3%>
(香港)			千香港ドル	
HKT TRUST AND HKT LTD		2	21	360
小 計	口 数 ・ 金 額	2	21	360
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		2	5	486
小 計	口 数 ・ 金 額	2	5	486
	銘 柄 数 <比 率>	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	19	—	41,075
	銘 柄 数 <比 率>	29	—	<2.4%>

(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 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	S&P 500 EMIN		105	—
	DJ EURO STOXX		5	—

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場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	1,566,009	90.8
投 資 信 託 受 益 証 券	1,240	0.1
投 資 証 券	39,835	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	116,711	6.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,723,795	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(1,721,970千円)の投資信託財産総額(1,723,795千円)に対する比率は99.9%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=134.61円	1カナダドル=104.22円	1ユーロ=142.03円
1イギリスポンド=165.13円	1スイスフラン=140.57円	1スウェーデンクローナ=13.28円
1ノルウェークローネ=13.61円	1デンマーククローネ=19.09円	1オーストラリアドル=92.95円
1ニュージーランドドル=84.75円	1香港ドル=17.15円	1シンガポールドル=97.13円
1イスラエルシェケル=39.5281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 2022年6月27日現在
(A) 資 産	1,725,410,834円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	86,978,828
株 式(評価額)	1,566,009,480
投資信託受益証券(評価額)	1,240,437
投 資 証 券(評価額)	39,835,092
未 収 入 金	3,609,153
未 収 配 当 金	1,860,482
差 入 委 託 証 拠 金	25,877,362
(B) 負 債	4,224,414
未 払 金	1,615,232
未 払 解 約 金	2,609,180
未 払 利 息	2
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,721,186,420
元 本	1,562,498,874
次 期 繰 越 損 益 金	158,687,546
(D) 受 益 権 総 口 数	1,562,498,874口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,016円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年7月 8日 至 2022年6月27日
(A) 配 当 等 収 益	27,516,266円
受 取 配 当 金	27,523,355
受 取 利 息	3,071
支 払 利 息	△10,160
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	135,619,416
売 買 益	358,328,644
売 買 損	△222,709,228
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△6,146,279
取 引 益	10,884,562
取 引 損	△17,030,841
(D) そ の 他 費 用	△4,515,656
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	152,473,747
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,306,981
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,093,182
(H) 計 (E+F+G)	158,687,546
次 期 繰 越 損 益 金(H)	158,687,546

(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) (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3) (G) 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1,499,250,000円、期中追加設定元本額は81,290,808円、期中一部解約元本額は18,041,934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。

DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	1,562,498,874円
--------------------------	----------------

お知らせ

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年11月10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2008年1月9日から無期限です。
運用方針	わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率	純 資 産 額
	円 騰 落	% 中 率	円 騰 落	% 中 率				
第11期(2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	97.5	103,475	
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441	
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598	
第14期(2021年11月10日)	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	96.1	111,120	
第15期(2022年11月10日)	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9	131,445	

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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		REIT 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率
	円 騰 落	% 騰 落 率	円 騰 落	% 騰 落 率			
(当期首) 2021年11月10日	21,895	—	21,683	—	3.8	96.1	
11月末	21,342	△2.5	21,136	△2.5	3.8	96.2	
12月末	22,081	0.8	21,868	0.9	3.7	96.2	
2022年 1月末	20,875	△4.7	20,673	△4.7	3.7	96.3	
2月末	20,262	△7.5	20,065	△7.5	3.6	96.4	
3月末	21,659	△1.1	21,450	△1.1	3.5	96.4	
4月末	21,403	△2.2	21,197	△2.2	3.6	96.4	
5月末	21,786	△0.5	21,577	△0.5	3.5	96.5	
6月末	21,423	△2.2	21,218	△2.1	3.5	96.5	
7月末	22,096	0.9	21,886	0.9	3.5	96.5	
8月末	22,358	2.1	22,145	2.1	3.4	96.5	
9月末	21,427	△2.1	21,225	△2.1	3.4	96.6	
10月末	21,790	△0.5	21,583	△0.5	3.3	96.6	
(当期末) 2022年11月10日	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9	

(注1)騰落率は期首比です。

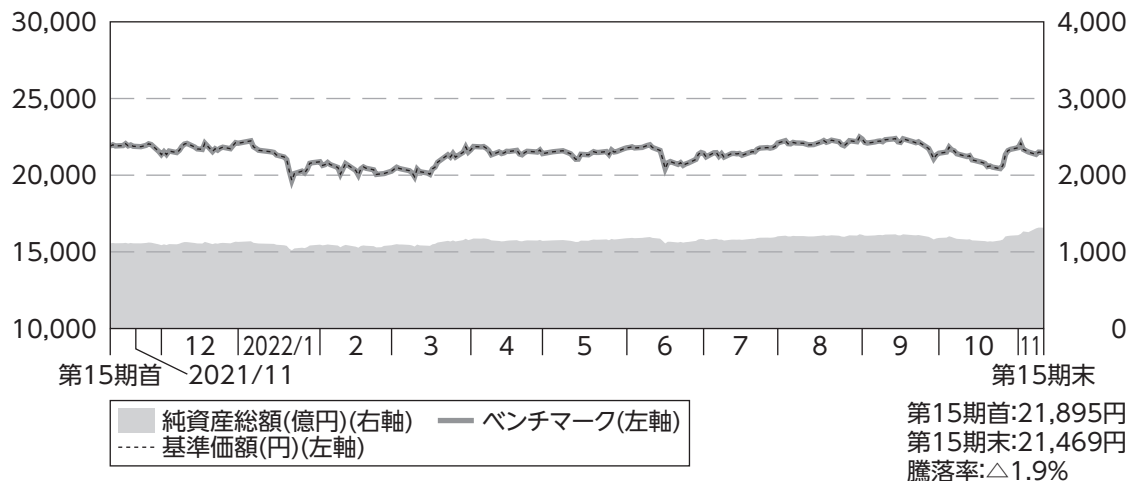
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。

「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及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。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

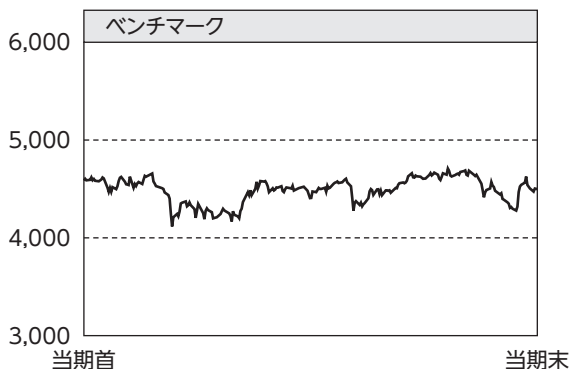


(注)ベンチマークは、2021年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。

投資環境



J-REIT市場は下落しました。

期初から2022年3月上旬にかけては、米長期金利の上昇やウクライナ情勢を巡る地政学リスクへの警戒感などから株式市場が急落したことで投資家心理が悪化し、J-REIT市場も大きく下落しました。その後は、日銀が指し値オペを実施し金利上昇を抑制する姿勢を示したことがJ-REIT市場にとっての安心感に繋がったことや、円建てで高利回りなJ-REITの特性に着目した個人や金融機関等による資金流入がみられたことなどから上昇しました。9月以降、世界的な金融引き締め継続への懸念や、公募増資の発表が相次ぎ短期的な投資口の供給増加による需給悪化が意識されたことなどから下落しましたが、期末にかけては株式市場のリスクオンの流れを受けてJ-REIT市場も反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。

主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券(J-REIT)に投資し、取引コストに留意しながらベンチマークの構成比率に合わせたポートフォリオを組成し、当期末時点では東証REIT指数を構成する全銘柄と東証REIT指数先物に投資しています。

当ファンドの組入資産の内容

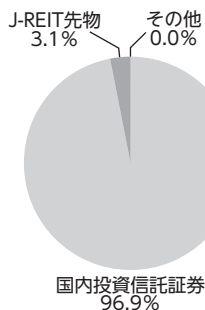
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.7%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.4%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.9%
4	日本都市ファンド投資法人	日本	4.8%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.6%
6	GLP投資法人	日本	4.4%

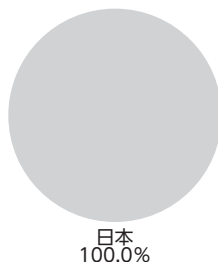
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	大和ハウスリート投資法人	日本	4.1%
8	オリックス不動産投資法人	日本	3.4%
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.1%
10	東証REIT指数先物 2212	日本	3.1%
組入銘柄数			62

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

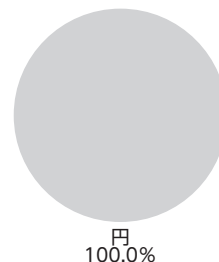
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

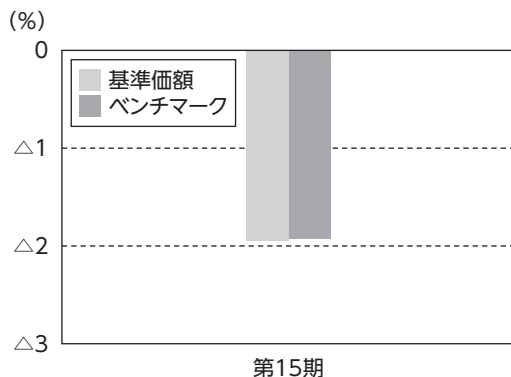


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.1%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。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月11日~2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.001% (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.000)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

(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(21,541円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜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
		口	千円	口	千円
国	エスコンジャパンリート投資法人	687	85,313	213	27,290
	サンケイリアルエステート投資法人	1,082	109,315	330	34,396
	SOS i LA物流リート投資法人	1,801 (180)	272,160 (28,675)	479	73,007
	SOS i LA物流リート投資法人	180 (△180)	28,675 (△28,675)	—	—
	東海道リート投資法人	791	96,735	96	11,064
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,150	730,868	377	242,488
	森ヒルズリート投資法人	3,893	596,290	1,259	189,367
	産業ファンド投資法人	5,560	969,089	1,504	272,451
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,318	1,140,930	1,078	375,185
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,671	555,529	740	156,048
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,755	737,572	620	256,605
	GLP投資法人	12,212	1,992,242	5,087	880,713
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,634 (41)	519,265 (12,814)	491	158,578
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	41 (△41)	12,814 (△12,814)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,849	1,965,271	1,663	569,946
	星野リゾート・リート投資法人	764	510,819	177	117,038
	Oneリート投資法人	575	153,737	176	48,791
	イオンリート投資法人	3,776	580,338	1,951	296,657
	ヒューリックリート投資法人	3,097	516,158	975	160,651
	日本リート投資法人	1,209	449,398	328	123,334
	積水ハウス・リート投資法人	10,065	804,071	3,226	258,911
	トーセイ・リート投資法人	828	111,359	209	28,016
	ケネディクス商業リート投資法人	1,732	467,757	422	115,589
	ヘルスケア&メディカル投資法人	950 (161)	160,029 (20,087)	243	39,940
	ヘルスケア&メディカル投資法人	161 (△161)	20,087 (△20,087)	—	—
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,075 (46)	132,015 (5,717)	223	27,738
	サムティ・レジデンシャル投資法人	46 (△46)	5,717 (△5,717)	—	—
内	野村不動産マスターファンド投資法人	10,710	1,754,847	3,466	560,292
	いちごホテルリート投資法人	553	52,228	182	16,399
	ラサールロジポート投資法人	4,060	688,151	1,317	228,360

		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国	スターアジア不動産投資法人	5,973	346,558	1,137	67,463
	マリモ地方創生リート投資法人	694	91,381	119	15,701
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,454 (52)	773,071 (28,349)	400	216,696
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	52 (△52)	28,349 (△28,349)	—	—
	大江戸温泉リート投資法人	537	36,503	176	12,001
	投資法人みらい	4,672	227,690	1,240	61,635
	森トラスト・ホテルリート投資法人	773	101,241	248	31,604
	三菱地所物流リート投資法人	1,816 (95)	805,360 (38,661)	294	135,532
	三菱地所物流リート投資法人	95 (△95)	38,661 (△38,661)	—	—
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,277	258,007	410	82,900
	ザイマックス・リート投資法人	612 (77)	74,162 (8,702)	164	20,083
	ザイマックス・リート投資法人	77 (△77)	8,702 (△8,702)	—	—
	タカラレーベン不動産投資法人	1,604 (225)	173,482 (23,554)	434	48,899
	タカラレーベン不動産投資法人	225 (△225)	23,554 (△23,554)	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,835	271,474	422	65,149
	日本ビルファンド投資法人	4,153	2,749,799	1,224	818,152
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,315	2,054,938	1,075	670,220
	日本都市ファンド投資法人	16,723	1,738,629	5,421	557,045
	オリックス不動産投資法人	6,597	1,206,595	2,134	380,072
	日本プライムリアルティ投資法人	2,501	979,021	716	281,551
	N T T都市開発リート投資法人	3,183	471,535	1,003	150,383
	東急リアル・エステート投資法人	2,217	438,838	715	137,484
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,278	255,165	831	92,786
ユナイテッド・アーバン投資法人	7,467	1,088,411	2,424	342,810	
森トラスト総合リート投資法人	2,364	337,385	763	107,355	
インヴィンシブル投資法人	14,586	621,954	4,727	196,403	
フロンティア不動産投資法人	1,394	717,434	369	187,430	
平和不動産リート投資法人	2,428 (134)	360,353 (18,480)	694	102,225	
平和不動産リート投資法人	134 (△134)	18,480 (△18,480)	—	—	
内	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,417	767,007	709	226,015
	福岡リート投資法人	1,716	285,471	558	92,382

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	ケネディクス・オフィス投資法人	1,300 (3,131)	677,736 (-)	545	358,464
	いちごオフィスリート投資法人	2,717	228,488	882	74,519
	大和証券オフィス投資法人	678	470,175	234	163,225
	阪急阪神リート投資法人	1,497	226,555	485	73,138
	スターツプロシード投資法人	623 (98)	146,008 (20,672)	166	39,141
	スターツプロシード投資法人	98 (△98)	20,672 (△20,672)	-	-
	大和ハウスリート投資法人	4,995	1,557,584	1,563	492,747
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,991	819,440	3,239	210,843
	大和証券リビング投資法人	4,765 (92)	543,533 (10,523)	1,426	163,567
内	大和証券リビング投資法人	92 (△92)	10,523 (△10,523)	-	-
	ジャパンエクセレント投資法人	3,054	403,207	1,099	143,335

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は合併・分割・減資・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。

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

<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
国 内	R E I T 先 物 取 引	百万円 16,277	百万円 16,429	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

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	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 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0	百万円 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	810,761	53,691	6.6	811,335	53,342	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。

* 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

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
エスコンジャパンリート投資法人		1,908		2,382	274,644	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		3,002		3,754	346,869	0.3
S O S i L A物流リート投資法人		3,976		5,478	763,633	0.6
東海道リート投資法人		726		1,421	169,667	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		3,273		4,046	2,512,566	1.9
森ヒルズリート投資法人		11,145		13,779	2,200,506	1.7
産業ファンド投資法人		13,455		17,511	2,735,218	2.1
アドバンス・レジデンス投資法人		9,476		11,716	3,948,292	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6,473		8,404	1,765,680	1.3
アクティブピア・プロパティーズ投資法人		5,051		6,186	2,681,631	2.0
G L P投資法人		30,696		37,821	5,741,227	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4,267		5,451	1,695,261	1.3
日本プロロジスリート投資法人		15,015		19,201	6,029,114	4.6
星野リゾート・リート投資法人		1,462		2,049	1,424,055	1.1
O n eリート投資法人		1,645		2,044	504,663	0.4
イオンリート投資法人		11,146		12,971	2,089,628	1.6
ヒューリックリート投資法人		8,841		10,963	1,881,250	1.4
日本リート投資法人		2,925		3,806	1,370,160	1.0
積水ハウス・リート投資法人		28,770		35,609	2,848,720	2.2
トーセイ・リート投資法人		1,980		2,599	347,746	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		3,784		5,094	1,364,682	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,021		2,889	548,043	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人		2,148		3,046	359,428	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		30,648		37,892	6,384,802	4.9
いちごホテルリート投資法人		1,570		1,941	199,728	0.2
ラサールロジポート投資法人		11,602		14,345	2,338,235	1.8
スターアジア不動産投資法人		9,794		14,630	814,891	0.6
マリモ地方創生リート投資法人		888		1,463	200,284	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		3,523		4,629	2,284,411	1.7
大江戸温泉リート投資法人		1,530		1,891	127,075	0.1
投資法人みらい		10,804		14,236	676,210	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,224		2,749	386,784	0.3
三菱地所物流リート投資法人		2,409		4,026	1,803,648	1.4
C R Eロジスティクスファンド投資法人		3,671		4,538	917,129	0.7
ザイマックス・リート投資法人		1,376		1,901	229,640	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		3,737		5,132	516,792	0.4

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,695	5,108	733,508		0.6
日本ビルファンド投資法人	10,741	13,670	8,776,140		6.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,478	11,718	7,054,236		5.4
日本都市ファンド投資法人	47,820	59,122	6,373,351		4.8
オリックス不動産投資法人	18,884	23,347	4,426,591		3.4
日本プライムリアルティ投資法人	6,229	8,014	3,129,467		2.4
NTT都市開発リート投資法人	9,084	11,264	1,617,510		1.2
東急リアル・エステート投資法人	6,354	7,856	1,653,688		1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	6,581	8,028	904,755		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,336	26,379	4,072,917		3.1
森トラスト総合リート投資法人	6,774	8,375	1,229,450		0.9
インヴィンシブル投資法人	41,715	51,574	2,341,459		1.8
フロンティア不動産投資法人	3,323	4,348	2,247,916		1.7
平和不動産リート投資法人	6,140	8,008	1,238,036		0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,193	7,901	2,536,221		1.9
福岡リート投資法人	4,902	6,060	1,029,594		0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	2,932	6,818	2,290,848		1.7
いちごオフィスリート投資法人	7,766	9,601	822,805		0.6
大和証券オフィス投資法人	2,005	2,449	1,648,177		1.3
阪急阪神リート投資法人	4,281	5,293	807,182		0.6
スターツプロシード投資法人	1,476	2,031	472,004		0.4
大和ハウスリート投資法人	14,231	17,663	5,343,057		4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,035	37,787	2,811,352		2.1
大和証券リビング投資法人	12,806	16,237	1,888,363		1.4
ジャパンエクセレント投資法人	8,794	10,749	1,460,789		1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	549,536	696,993	127,391,746	
	銘 柄 数 <比 率>	61	61	<96.9%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※当期末現在の保有銘柄のうち、当社または当社の利害関係人が資産運用会社または一般事務受託会社である投資法人

①資産運用会社

日本ロジスティクスファンド投資法人については、当社の利害関係人である三井物産ロジスティクス・パートナーズ株式会社が資産運用会社となっております。

②一般事務受託会社

以下の投資法人については、当社の利害関係人である三井住友信託銀行株式会社が一般事務受託会社となっております。

投資法人名	
エスコンジャパンリート投資法人	タカラレーベン不動産投資法人
SOS i LA物流リート投資法人	アドバンス・ロジスティクス投資法人
日本アコモデーションファンド投資法人	日本ビルファンド投資法人
森ヒルズリート投資法人	オリックス不動産投資法人
産業ファンド投資法人	NTT都市開発リート投資法人
アドバンス・レジデンス投資法人	東急リアル・エステート投資法人
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	ユナイテッド・アーバン投資法人
アクティビア・プロパティーズ投資法人	森トラスト総合リート投資法人
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	インヴィンシブル投資法人
日本プロロジスリート投資法人	フロンティア不動産投資法人
イオンリート投資法人	日本ロジスティクスファンド投資法人
ケネディクス商業リート投資法人	福岡リート投資法人
ヘルスケア&メディカル投資法人	ケネディクス・オフィス投資法人
ラサールロジポート投資法人	いちごオフィスリート投資法人
スターアジア不動産投資法人	大和証券オフィス投資法人
マリモ地方創生リート投資法人	阪急阪神リート投資法人
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	スターツプロシード投資法人
大江戸温泉リート投資法人	大和ハウスリート投資法人
投資法人みらい	ジャパン・ホテル・リート投資法人
森トラスト・ホテルリート投資法人	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	期		末					
			買	建	額	売	建	額		
			(百万円)		(百万円)					
国内	東	証	R	E	I	T	指	数	4,012	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 127,391,746	% 96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,290,134	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	131,681,880	100.0

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 2022年11月10日現在
(A)資 産	131,681,880,177円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,736,946,174
投 資 証 券(評価額)	127,391,746,400
未 収 入 金	91,536,649
未 収 配 当 金	1,111,331,754
差 入 委 託 証 拠 金	350,319,200
(B)負 債	236,364,451
未 払 金	161,682,453
未 払 解 約 金	74,675,818
未 払 利 息	6,180
(C)純 資 産 総 額(A-B)	131,445,515,726
元 本	61,225,723,115
次 期 繰 越 損 益 金	70,219,792,611
(D)受 益 権 総 口 数	61,225,723,115口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,469円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日
(A)配 当 等 収 益	4,112,764,847円
受 取 配 当 金	4,114,117,113
受 取 利 息	14,680
そ の 他 収 益 金	206
支 払 利 息	△1,367,152
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△6,004,940,087
売 買 益	1,898,230,392
売 買 損	△7,903,170,479
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△83,330,720
取 引 益	296,344,400
取 引 損	△379,675,120
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,975,505,960
(E)前 期 繰 越 損 益 金	60,368,009,748
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	18,157,282,749
(G)解 約 差 損 益 金	△6,329,993,926
(H)計 (D+E+F+G)	70,219,792,611
次 期 繰 越 損 益 金(H)	70,219,792,611

(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) (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3) (G)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50,752,359,768円、期中追加設定元本額は16,026,940,734円、期中一部解約元本額は5,553,577,387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。

Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	31,882,373,589円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,678,540,579円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,228,904,460円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,729,965,779円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,460,260,510円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,036,169,457円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	607,009,296円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	582,825,312円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	525,180,997円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	502,780,878円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	291,868,529円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-11(適各機関投資家専用)	255,963,362円
グローバル経済コア	246,084,185円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	229,316,589円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	214,944,241円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	112,071,896円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	84,403,221円
SMT インデックスバランス・オープン	26,406,174円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	19,640,628円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,004,824円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,445,182円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,348,365円
10資産分散投資ファンド	7,002円

お知らせ

該当事項はありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年11月10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2008年1月9日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券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。

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。
- ・ 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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率		
第11期(2018年11月12日)	18,126	1.6	19,461	2.2	99.4	74,818
第12期(2019年11月11日)	19,790	9.2	21,365	9.8	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838	△14.9	18,254	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699	46.7	26,879	47.2	99.5	102,118
第15期(2022年11月10日)	24,409	△1.2	26,667	△0.8	99.5	84,560

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		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2021年11月10日	24,699	—	26,879	—	99.5
11月末	24,668	△0.1	26,837	△0.2	99.6
12月末	26,284	6.4	28,634	6.5	99.2
2022年 1月末	24,428	△1.1	26,622	△1.0	99.6
2月末	24,435	△1.1	26,656	△0.8	99.5
3月末	27,464	11.2	29,949	11.4	99.4
4月末	27,912	13.0	30,422	13.2	99.6
5月末	25,788	4.4	28,131	4.7	99.6
6月末	25,158	1.9	27,451	2.1	99.3
7月末	26,508	7.3	28,918	7.6	99.4
8月末	25,935	5.0	28,316	5.3	99.6
9月末	23,076	△6.6	25,156	△6.4	99.2
10月末	25,123	1.7	27,436	2.1	99.4
(当期末) 2022年11月10日	24,409	△1.2	26,667	△0.8	99.5

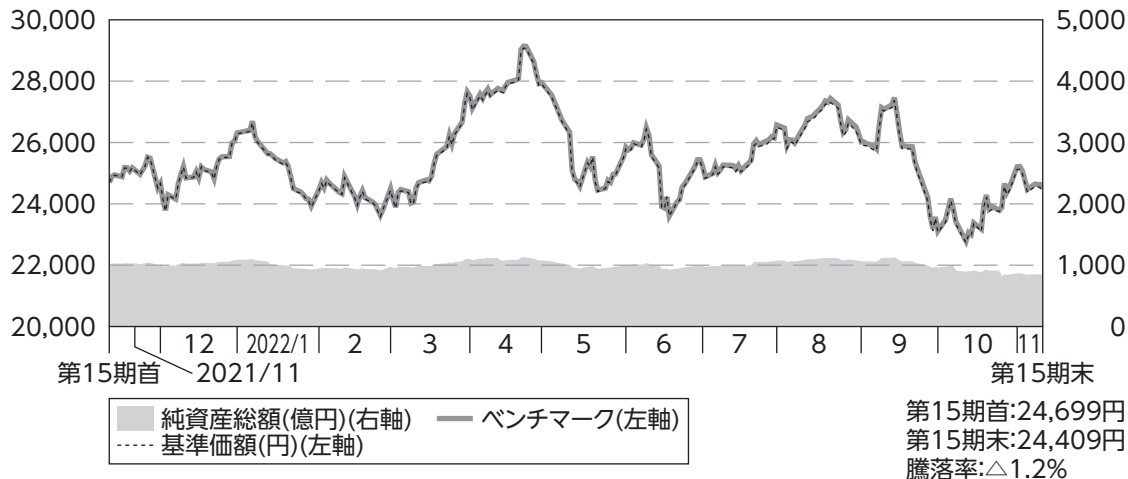
(注)騰落率は期首比です。

ベンチマークは、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)です。

S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当インデックスは、S&P Globalの一部門である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、S&P Globalの一部門である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、これら関係者のいずれも、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、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。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

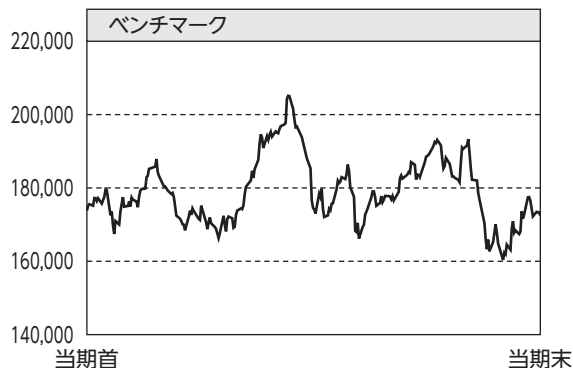


(注)ベンチマークは、2021年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

投資環境



海外REIT市場は、年末商戦期の米小売売上高の好調などが好感された一方、各国中央銀行のタカ派的な姿勢やウクライナ情勢の緊迫化などが意識され一進一退の展開となりましたが、2022年6月中旬にかけては各国の相次ぐ利上げを受けた景気減速懸念などから下落しました。その後は、米国のインフレ圧力緩和に伴う金融引き締めペース減速への期待などを背景に一時反発する場面もありましたが、期末にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)参加者の政策金利見通しが積極的な利上げ継続を示唆する内容であったことなどから米長期金利が継続的に上昇したことが嫌気され、下落しました。

外国為替市場では、日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨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&P先進国REIT指数(除く日本、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、REITを高位に組み入れ運用を行いました。

(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

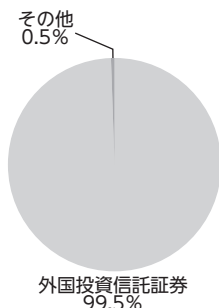
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.3%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.5%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.7%
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
5	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.1%
6	WELLTOWER INC	アメリカ	2.5%

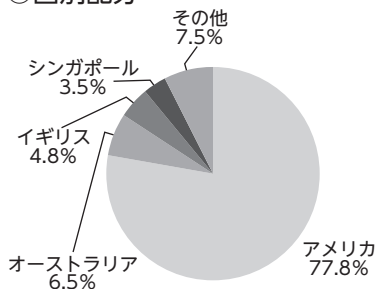
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.5%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.3%
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	1.8%
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.7%
組入銘柄数		324	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

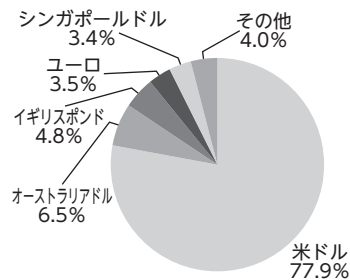
○資産別配分



○国別配分



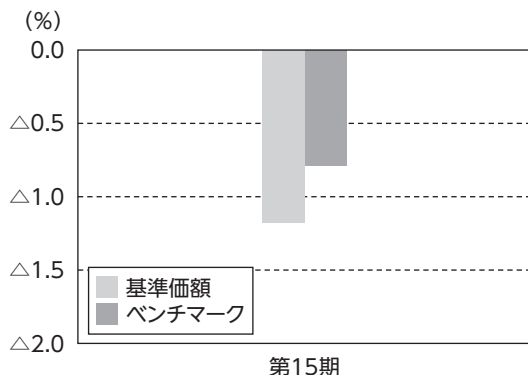
○通貨別配分



(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概ねベンチマーク騰落率に連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因※(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です。

今後の運用方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月11日~2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	2円	0.009%	(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)	(-)	(-)	
(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)	(2)	(0.009)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(b) 有価証券取引税	3	0.011	(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)	(-)	(-)	
(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)	(3)	(0.011)	
(c) その他費用	10	0.038	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(10)	(0.038)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.058	

(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(25,564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 — (1,399)	千米ドル — (4,097)	百株 — (1,399)	千米ドル — (4,097)

(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
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,983	3,511	26,383	4,349
	BOSTON PROPERTIES	18,702	1,927	30,320	2,911
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,456	902	55,086	1,650
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	13,600	130	21,327	182
	AGREE REALTY CORP	9,361	659	9,675	635
	SL GREEN REALTY CORP	9,576 (1,122)	654 (89)	17,066 (1,068)	1,092 (—)
	EPR PROPERTIES	7,003	356	13,404	588
	PROLOGIS INC	85,651 (103,749)	11,500 (12,363)	160,259	20,025
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,181	3,716	27,653	5,762
	LXP INDUSTRIAL TRUST	21,339	240	41,751	420
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,793	1,898	18,384	2,540
	VERIS RESIDENTIAL INC	—	—	4,726	72
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,531	679	29,308	1,232
	COUSINS PROPERTIES INC	13,979	414	24,920	717
	SITE CENTERS CORP	24,592	370	36,061	489
	ISTAR INC	47,982	609	7,566	69
	DUKE REALTY CORP	43,435 (△218,421)	2,455 (△12,363)	33,998	1,981
	ESSEX PROPERTY TRUST	6,035	1,777	11,368	3,175
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	40,950	3,222	70,990	5,383

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,537	1,003	13,617	1,519
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9,691	499	19,025	957
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	57,235	1,658	101,704	2,834
EQUITY COMMONWEALTH	17,008	469	32,193	845
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,300 (△80,080)	228 (△2,524)	9,830	290
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,879	301	15,959	539
SERVICE PROPERTIES TRUST	16,167	121	32,163	237
WELLTOWER INC	68,013	5,519	80,793	5,858
EASTGROUP PROPERTIES, INC	4,455	756	6,130	1,028
KIMCO REALTY CORP	62,333	1,386	109,429	2,361
KILROY REALTY CORPORATION	12,830	786	21,987	1,238
LTC PROPERTIES INC	2,685	116	4,134	154
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	—	—	16,000	53
MONMOUTH REIT -CL A	—	—	54,952	1,153
BRANDYWINE REALTY TRUST	—	—	12,403	78
IRON MOUNTAIN INC	23,339	1,129	46,118	2,227
MACERICH CO/THE	23,663	296	40,535	487
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,519	1,098	25,874	1,755
ACADIA REALTY TRUST	8,960	150	8,030	104
HOST HOTELS AND RESORTS INC	84,082	1,475	147,014	2,560
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,894	2,462	22,750	4,086
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,900	48	8,000	74
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,650	109	5,541	317
CENTERSPACE	3,791	324	3,941	302
PENN REAL ESTATE INVEST TST	— (△32,667)	— (—)	2,333	10
GETTY REALTY CORP	4,700	138	5,995	168
PS BUSINESS PARKS INC	1,562	264	12,734	2,295
REALTY INCOME CORP	96,049	6,454	108,852	6,941
REGENCY CENTERS CORP	16,221	1,044	28,179	1,763
UDR INC	42,878	2,178	52,099	2,431
CORPORATE OFFICE PPTYS	19,512	497	29,452	757
SIMON PROPERTY GROUP	41,034	4,915	67,046	7,869
LIFE STORAGE INC	9,357	1,204	13,572	1,643

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
PUBLIC STORAGE	20,145	6,722	29,337	9,618
SUN COMMUNITIES INC	15,910	2,629	21,976	3,363
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,119	265	24,082	416
UMH PROPERTIES INC	5,309	113	5,500	88
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	—	—	2,180	96
VENTAS INC	46,929	2,462	76,470	3,549
VORNADO REALTY TRUST	14,733	464	28,684	891
ELME COMMUNITIES	5,500	122	9,696	169
GEO GROUP INC/THE	—	—	64,306	425
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,402	444	84,196	5,449
KITE REALTY GROUP TRUST	16,577	327	31,440	608
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,348	3,271	27,441	5,108
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	—	—	12,000	73
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,246	414	60,788	660
CUBESMART	27,856	1,365	33,595	1,481
DIGITAL REALTY TRUST INC	32,681	4,298	52,060	6,346
DIAMONDRACK HOSPITALITY CO	10,100	88	24,494	206
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68,586	1,281	119,880	1,937
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	17,764	516	31,749	803
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	20,023	361	30,327	521
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	—	—	9,512	94
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,000	106	23,500	198
TERRENO REALTY CORP	9,847	648	17,025	1,040
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,974	269	11,700	377
RLJ LODGING TRUST	15,420	197	30,669	368
AMERICOLD REALTY TRUST	22,901 (139,990)	698 (4,097)	39,230 (139,990)	1,005 (4,097)
CORESITE REALTY CORP	1,000	171	25,830	4,392
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,552	147	15,939	294
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	—	—	4,892	69
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	—	—	29,639	737
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31,663	450	50,072	683
WHITESTONE REIT	11,384	150	7,400	96
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	6,400	157	30,107	491
STAG INDUSTRIAL INC	21,364	823	28,505	994

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
CYRUSONE INC	4,431	398	72,527	6,559
WP CAREY INC	27,457	2,235	32,652	2,446
ALEXANDER & BALDWIN INC	11,272	242	16,130	335
GLADSTONE LAND CORP	3,000	69	3,439	66
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	25,823 (80,080)	703 (2,524)	47,364	1,072
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,363	283	7,950	676
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	8,100	119	6,549	73
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,904	901	22,745	929
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,180	152	20,607	296
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	29,605	1,993	25,221	1,500
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	44,055	1,666	52,997	1,878
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	73,369	1,827	26,694	518
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,627	853	4,783	760
JBG SMITH PROPERTIES	14,920	394	33,752	840
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	12,000	109	8,504	53
RETAIL VALUE	—	—	9,529	28
INVITATION HOMES INC	82,794	3,176	128,801	4,789
COREPOINT LODGING INC	—	—	22,000	351
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	— (—)	— (△6)	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	—	—	13,000	87
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,451	323	12,065	265
SAFEHOLD INC	2,000	143	2,005	143
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	29,554	711	31,023	739
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,500	149	12,256	300
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	—	—	66,258	1,134
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	39,937	1,900	43,302	2,022
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,288	485	44,417	948
PRIME US REIT	— (—)	— (△8)	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,823	1,145	7,904	180
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	—	—	13,000	96
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	—	— (14,850)	— (207)
FARMLAND PARTNERS INC	14,928	208	4,277	57

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ORION OFFICE REIT INC	— (30,374)	— (—)	—	—
NETSTREIT CORP	7,645	141	4,806	85
CARETRUST REIT INC	4,980	104	11,525	204
INDUS REALTY TRUST INC	1,500	121	1,500	74
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	67,067	2,159	11,824	341
BLUEROCK HOMES TRUST INC	— (1,856)	— (—)	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	13,475	581	27,625	1,174
BROADSTONE NET LEASE INC-A	11,280	230	16,297	262
CTO REALTY GROWTH INC	— (5,600)	— (—)	—	—
CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	6,800	64
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	387	2,023	51
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800 (—)	154 (△1)	—	—
STORE CAPITAL CORP	29,242	845	38,730	1,225
PARAMOUNT GROUP INC	—	—	9,718	64
URBAN EDGE PROPERTIES	5,290	84	9,545	129
EQUINIX INC	10,764	7,334	17,358	11,196
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,639	113	10,316	165
XENIA HOTELS & RESORTS INC	6,867	132	15,765	270
NEXPOINT RESIDENTIAL	—	—	1,583	64
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,319	582	15,231	798
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	—	—	1,493	47
APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,591	233	29,221	476
GLOBAL NET LEASE INC	—	—	7,928	86
MANULIFE US REAL ESTATE INV	221,400 (—)	144 (△6)	122,800	39
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	20,494	361	45,472	689
VICI PROPERTIES INC	260,614	7,792	139,949	4,220
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	19,900	161
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,481	280	15,963	417
DIGITALBRIDGE GROUP INC	63,237	446	344,130	2,160
小 計	3,149,812 (31,603)	143,076 (4,163)	4,612,103 (155,908)	214,517 (4,305)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,314	404	24,127	713
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,654	510	16,399	781
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,000	124	28,398	330
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,373	577	45,127	968
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	3,300	128	7,563	252
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	—	—	47,120	553
PRIMARIS REIT	8,000 (20,309)	123 (—)	—	—
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,400	333	8,713	454
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10,000	120
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,900	105	8,200	97
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,500	94	19,871	203
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	22,000	319	21,101	278
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,000	101	13,272	232
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,700	516	9,071	775
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	95	17,145	217
PLAZA RETAIL REIT	—	—	25,000	103
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	102	—	—
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	214	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	7,810	116
SLATE GROCERY REIT	7,000	117	—	—
NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,015	72	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	—	—	7,950	120
小 計	171,656 (20,309)	3,942 (—)	316,867	6,319
ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	— (—)	— (△30)	92,500	1,752
小 計	— (—)	— (△30)	92,500	1,752
イタリア				
COIMA RES SPA	—	—	11,900	118
小 計	—	—	11,900	118
フランス				
ICADE	2,960 (—)	160 (△15)	5,530	264

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ALTAREA	600 (-)	95 (△15)	-	-
	KLEPIERRE	20,829 (-)	470 (△172)	35,340	711
	GECINA SA	5,880	581	10,436	1,003
	COVIVIO(FP)	4,658	311	9,439	574
	MERCIALYS	15,384	128	7,000	58
	CARMILA	7,392 (-)	106 (△25)	6,000	81
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,285	808	30,078	1,602
	ALTAREA-RTS	- (1,880)	- (-)	1,880	4
	小 計	71,988 (1,880)	2,664 (△228)	105,703	4,300
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,300 (277)	79 (2)	7,867	160
	小 計	4,300 (277)	79 (2)	7,867	160
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	65,084 (-)	444 (△25)	67,274	422
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- (-)	- (△5)	-	-
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	37,281 (-)	368 (△39)	66,879	604
	小 計	102,365 (-)	812 (△70)	134,153	1,027
	ベルギー				
	BEFIMMO S. C. A.	1,800	85	15,810	724
	COFINIMMO	3,670	452	5,238	574
	RETAIL ESTATES	-	-	1,065	61
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,800	642	30,658	957
	MONTEA NV	1,630	146	1,960	128
	AEDIFICA	5,100	465	6,152	534
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,730	73	2,357	63
	小 計	32,730	1,865	63,240	3,043

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	—	—	365,550	584
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	—	—	50,000	85
小 計	—	—	415,550	670
その他				
CROMWELL REIT EUR	43,300 (—)	86 (△8)	32,900	49
小 計	43,300 (—)	86 (△8)	32,900	49
ユ ー ロ 計	254,683 (2,157)	5,509 (△334)	863,813	11,122
イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	130,425	592	213,051	903
DERWENT LONDON PLC	10,500	322	20,126	531
BIG YELLOW GROUP PLC	16,822	252	31,095	405
HAMMERSON PLC	413,000	116	1,030,354	278
WORKSPACE GROUP PLC	11,000	64	16,031	61
UNITE GROUP PLC	52,356	537	82,534	771
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	220,000	304	317,933	402
SHAFTESBURY PLC	23,000	123	40,370	170
SEGRO PLC	163,782	1,859	260,792	2,655
LAND SECURITIES GROUP PLC	71,242	521	127,045	789
ASSURA PLC	477,000	318	543,231	320
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,500	199	62,680	360
PICTON PROPERTY INCOME LTD	—	—	62,000	63
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	—	—	84,028	50
SAFESTORE HOLDINGS PLC	15,300	178	32,441	338
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	159,220	409	192,644	424
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	—	—	56,600	46
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	98,011	162	214,151	266
GCP STUDENT LIVING PLC	—	—	258,000	549
WAREHOUSE REIT PLC	230,000	335	—	—
NEWRIVER REIT PL	—	—	60,000	56
PRS REIT PLC/THE	130,000	142	124,998	122
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	342,099	423	218,910	226

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	299,167	607	352,163	587
	HOME REIT PLC	287,000	344	45,698	39
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	80	—	—
	AEW UK REIT PLC	—	—	50,000	63
	LXI REIT PLC	726,409	1,020	305,829	392
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,000	437	36,579	45
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	52,000	61	—	—
	小 計	4,328,833	9,417	4,839,283	10,925
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	BWP TRUST	—	—	34,094	126
	MIRVAC GROUP	441,626	1,033	764,484	1,730
	CROMWELL PROPERTY GROUP	150,000	126	343,193	268
	CHARTER HALL RETAIL REIT	64,500	261	115,786	473
	GPT GROUP	186,173	871	360,843	1,647
	CENTURIA CAPITAL GROUP	40,000	115	121,372	244
	ABACUS PROPERTY GROUP	42,000	118	80,387	234
	STOCKLAND	356,553	1,398	552,903	2,075
	DEXUS	91,730	927	179,013	1,643
	GOODMAN GROUP	209,755	4,398	344,622	6,763
	VICINITY CENTERS	391,404	743	716,047	1,277
	CHARTER HALL GROUP	50,166	732	85,630	1,229
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	—	—	27,950	86
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	— (36,978)	— (226)	20,120	73
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	210,679	608	267,318	725
	ARENA REIT	50,500	240	90,275	386
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,000	120	86,130	271
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	75,980	371	109,328	484
	NATIONAL STORAGE REIT	166,000	389	293,750	703
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	35,000	130	—	—
	RURAL FUNDS GROUP	40,000	109	49,764	122
	IRONGATE GROUP	—	—	272,000	516
	SCENTRE GROUP	540,874	1,571	967,874	2,741
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	178	—	—
	HOME CONSORTIUM LTD	21,000	107	36,309	208

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	—	—	31,566	98
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	119,920 (513,700)	136 (743)	168,159	196
	HEALTHCO REIT	137,130	280	—	—
	AVENTUS GROUP	—	—	(233,500)	(810)
	WAYPOINT REIT LTD	—	—	53,143	133
	小 計	3,651,630 (550,678)	14,974 (970)	6,172,060 (233,500)	24,463 (810)
	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	AMP NZ OFFICE LTD	80,000	114	206,599	239
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	— (26,153)	— (77)	68,115	157
	GOODMAN PROPERTY TRUST	130,000	287	232,101	514
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	—	—	114,737	98
	ARGOSY PROPERTY LTD	—	—	85,000	132
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	543	—	—
	小 計	510,000 (26,153)	945 (77)	706,552	1,143
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	234,200	15,121	399,800	23,446
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	195,000 (302,660)	673 (976)	—	—
	CHAMPION REIT	170,000	574	563,000	1,745
	FORTUNE REIT	80,000	548	231,000	1,265
	YUEXIU REAL ESTATE IN-RIGHTS	— (302,660)	— (—)	— (302,660)	— (8)
	小 計	679,200 (605,320)	16,917 (976)	1,193,800 (302,660)	26,457 (8)
	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	596,800 (—)	1,267 (△0.84949)	1,018,300	2,012
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	307,700 (—)	878 (△65)	573,200	1,544
	SUNTEC REIT	332,500 (—)	539 (△6)	452,300	704
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	753,700 (58,485)	1,298 (57)	869,600	1,431

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	STARHILL GLOBAL REIT	190,000	111	200,000	126
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	365,700 (-)	401 (△15)	509,600	495
	KEPPEL REIT	100,000	107	215,100	205
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	45,000	102	209,400	446
	ESR-LOGOS REIT	350,000 (1,320,769)	141 (591)	701,200	229
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	56,400 (-)	70 (△5)	75,700	77
	CAPITALAND CHINA TRUST	260,000 (-)	309 (△20)	213,800	229
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△7)	-	-
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	- (-)	- (△7)	-	-
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	50,000 (-)	242 (△5)	112,300	488
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	284,400 (-)	728 (△1)	431,500	1,063
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	188,800 (-)	345 (△7)	340,200	603
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	- (-)	- (△0.34268)	- (744,977)	- (666)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	240,000 (-)	274 (△21)	1,462,100	1,727
	SPH REIT	577,800	545	745,000	677
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△4)	-	-
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	570,000 (160,950)	446 (115)	402,000	297
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400 (-)	218 (△5)	-	-
	IREIT GLOBAL	-	-	405,985	217
	KEPPEL DC REIT	50,000 (-)	98 (△14)	133,600	226
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	295,000 (-)	415 (△24)	540,300	701
	小 計	5,942,200 (1,540,204)	8,546 (551)	9,611,185 (744,977)	13,509 (666)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	76,363	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,000 (7,287)	79,288 (53,458)	—	—
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	— (—)	— (△402)	—	—
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	— (5,433)	— (34,731)	—	—
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD RIGHT	— (26,655)	— (—)	— (26,655)	— (2,324)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	74,038	—	—
JR REIT XXVII	— (12,345)	— (54,005)	— (—)	— (490)
SK REITS CO LTD	30,940 (8,289)	197,336 (42,381)	— (—)	— (439)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD RIGHT	— (7,287)	— (—)	— (7,287)	— (409)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	— (26,655)	— (167,260)	—	—
D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240 (—)	152,362 (△306)	—	—
SK REITS CO LTD-RIGHTS	— (8,289)	— (439)	— (8,289)	— (439)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT-RTS	— (5,433)	— (—)	— (5,433)	— (775)
JR REIT XXVII-RIGHTS	— (12,345)	— (490)	— (12,345)	— (490)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	78,164	—	—
小 計	111,530 (120,018)	657,553 (352,058)	— (60,009)	— (5,368)
イスラエル	口	千イスラエルシェケル	口	千イスラエルシェケル
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,157	—	—
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	722	—	—
小 計	475,000	1,880	—	—

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は合併・分割・減資・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

■ 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	18,398	73	0.4	34,706	—	—
金 銭 信 託	0.001857	0.001857	100.0	0.001857	0.001857	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	54,550	4,030	7.4	54,662	4,016	7.3

(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。

組入資産の明細

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		比 率 (%)
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,688	70,288	10,032	1,468,918	1.7
ALEXANDER'S INC	1,190	1,190	281	41,166	0.0
BOSTON PROPERTIES	79,135	67,517	4,776	699,375	0.8
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	135,453	110,823	3,434	502,831	0.6
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	79,751	72,024	517	75,818	0.1
AGREE REALTY CORP	38,105	37,791	2,592	379,617	0.4
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	102	15,007	0.0
SL GREEN REALTY CORP	37,875	30,439	1,128	165,294	0.2
EPR PROPERTIES	41,912	35,511	1,356	198,556	0.2
PROLOGIS INC	410,213	439,354	47,797	6,998,005	8.3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,265	66,793	10,618	1,554,691	1.8
LXP INDUSTRIAL TRUST	152,908	132,496	1,328	194,569	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	56,019	50,428	5,515	807,496	1.0
VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	37,510	555	81,279	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	83,841	3,679	538,756	0.6
COUSINS PROPERTIES INC	82,626	71,685	1,696	248,321	0.3
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	15,050	273	40,081	0.0
SITE CENTERS CORP	99,620	88,151	1,081	158,358	0.2
ISTAR INC	—	40,416	398	58,285	0.1
DUKE REALTY CORP	208,984	—	—	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST	36,162	30,829	6,392	935,865	1.1
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,281	160,241	9,563	1,400,145	1.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,550	34,470	3,479	509,469	0.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	62,519	2,938	430,210	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,893	255,424	6,104	893,779	1.1
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	52,660	1,363	199,687	0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,610	—	—	—	—

* 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。

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	49,792	1,386	202,954	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	78,173	558	81,719	0.1
WELLTOWER INC	233,908	221,128	14,705	2,152,960	2.5
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,299	20,624	3,105	454,655	0.5
KIMCO REALTY CORP	339,870	292,774	6,080	890,306	1.1
KILROY REALTY CORPORATION	58,949	49,792	2,036	298,162	0.4
LTC PROPERTIES INC	20,624	19,175	735	107,720	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	116,800	136	20,007	0.0
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	81,217	511	74,913	0.1
IRON MOUNTAIN INC	160,382	137,603	6,765	990,601	1.2
MACERICH CO/THE	118,542	101,670	1,175	172,076	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,155	82,800	5,116	749,064	0.9
ACADIA REALTY TRUST	46,940	47,870	674	98,681	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	401,344	338,412	5,685	832,387	1.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	64,502	54,646	8,320	1,218,189	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	18,550	165	24,253	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	21,139	1,153	168,953	0.2
CENTERSPACE	7,499	7,349	448	65,720	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	8,599	196	28,792	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	21,985	20,690	658	96,389	0.1
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	—	—	—	—
RPT REALTY	43,950	43,950	443	64,861	0.1
REALTY INCOME CORP	307,228	294,425	18,622	2,726,502	3.2
REGENCY CENTERS CORP	84,860	72,902	4,535	664,003	0.8
UDR INC	153,803	144,582	5,430	795,079	0.9
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	53,219	1,393	204,067	0.2
SAUL CENTERS INC	6,800	6,800	267	39,146	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	182,102	156,090	17,625	2,580,576	3.1
LIFE STORAGE INC	44,161	39,946	4,057	594,031	0.7
PUBLIC STORAGE	84,460	75,268	21,429	3,137,500	3.7
SUN COMMUNITIES INC	64,445	58,379	7,788	1,140,376	1.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	49,407	890	130,423	0.2
UMH PROPERTIES INC	25,320	25,129	422	61,809	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	20,150	356	52,158	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	4,793	230	33,676	0.0
VENTAS INC	218,755	189,214	7,899	1,156,592	1.4
VORNADO REALTY TRUST	90,208	76,257	1,715	251,207	0.3
ELME COMMUNITIES	45,570	41,374	749	109,763	0.1
GEO GROUP INC/THE	64,306	—	—	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	—	—	—	—
KITE REALTY GROUP TRUST	118,586	103,723	2,130	311,922	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,984	63,891	9,687	1,418,389	1.7
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	45,973	128	18,779	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,047	100,505	1,002	146,707	0.2
CUBESMART	111,990	106,251	4,125	604,047	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,521	137,142	13,315	1,949,466	2.3

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	99,846	834	122,210	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	334,846	283,552	3,187	466,626	0.6
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	97,197	83,212	1,332	195,050	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,259	58,955	844	123,690	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	58,412	585	85,777	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	52,970	405	59,328	0.1
TERRENO REALTY CORP	38,649	31,471	1,752	256,555	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,057	26,331	716	104,936	0.1
RLJ LODGING TRUST	92,291	77,042	852	124,753	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	143,840	127,511	3,586	525,155	0.6
CORESITE REALTY CORP	24,830	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	62,226	915	134,106	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	22,938	340	49,837	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	—	—	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,360	305	44,778	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	127,744	109,335	1,334	195,374	0.2
WHITESTONE REIT	19,090	23,074	207	30,404	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	61,023	646	94,615	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	91,978	84,837	2,631	385,298	0.5
CYRUSONE INC	68,096	—	—	—	—
WP CAREY INC	103,444	98,249	7,706	1,128,330	1.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	36,712	703	103,038	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15,500	15,061	304	44,652	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	121,604	180,143	3,462	506,922	0.6
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	26,109	2,198	321,864	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	32,051	361	52,932	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,382	64,541	2,479	362,953	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	107,135	1,511	221,324	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	76,595	80,979	4,340	635,488	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	143,210	4,273	625,666	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	58,331	105,006	1,717	251,517	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,398	13,242	1,373	201,165	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	65,943	47,111	871	127,604	0.2
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	59,590	63,086	393	57,635	0.1
RETAIL VALUE	9,529	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	320,490	274,483	8,182	1,197,976	1.4
COREPOINT LODGING INC	22,000	—	—	—	—
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	470,000	249	36,470	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	68,118	485	71,008	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	17,286	335	49,123	0.1
SAFEHOLD INC	8,340	8,335	230	33,766	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	68,320	66,851	1,409	206,421	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	38,922	33,166	129	18,986	0.0
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,258	—	—	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,303	120,938	6,052	886,211	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	141,856	3,007	440,305	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	28,700	103	15,085	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	0.00002	0.002	0.0

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
PRIME US REIT	295,000	295,000	141	20,731	0.0	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	7,000	106	15,639	0.0	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	5,700	103	15,121	0.0	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	31,919	791	115,896	0.1	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	13,000	—	—	—	—	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	—	—	—	—	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	22,851	313	45,834	0.1	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	25,050	231	33,888	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	—	30,374	281	41,268	0.0	
NETSTREIT CORP	20,992	23,831	434	63,676	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000	105	15,506	0.0	
CARETRUST REIT INC	52,477	45,932	863	126,495	0.1	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	2,340	124	18,226	0.0	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	—	55,243	1,653	242,077	0.3	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	1,856	40	5,951	0.0	
APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	72,989	2,616	383,104	0.5	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	81,949	1,371	200,729	0.2	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	8,400	165	24,191	0.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	—	—	—	—	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	11,597	328	48,051	0.1	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	—	178,800	107	15,706	0.0	
STORE CAPITAL CORP	135,277	125,789	3,968	581,049	0.7	
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	80,008	504	73,915	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	33,930	304	44,510	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	55,595	791	115,908	0.1	
EQUINIX INC	49,977	43,383	25,940	3,798,002	4.5	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	42,991	664	97,310	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	54,132	758	111,035	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	10,806	480	70,277	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,310	40,398	1,511	221,326	0.3	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	11,050	377	55,248	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	100,761	1,561	228,662	0.3	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	49,084	613	89,829	0.1	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	46	6,872	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	835,164	296	43,408	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	106,435	1,227	179,673	0.2	
VICI PROPERTIES INC	338,799	459,464	14,486	2,121,027	2.5	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	—	—	—	—	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,044	38,562	1,016	148,881	0.2	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	280,893	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,155,365	12,568,769	447,573	65,529,185	
	銘 柄 数 < 比 率 >	156	145	—	< 77.5% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	30,663	842	91,138	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	45,920	39,175	1,613	174,593	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	61,841	721	78,019	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,131	70,377	1,433	155,113	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	29,679	743	80,410	0.1	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)		
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	—	—	—	—	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	13,820	212	22,998	0.0	
PRIMARIS REIT	—	28,309	423	45,853	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	9,047	444	48,122	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	30,330	277	29,994	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	26,577	407	44,112	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	33,790	387	41,971	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	48,099	527	57,039	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	12,890	199	21,589	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	8,700	29	3,181	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	58,250	59,149	682	73,855	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	20,000	69	7,530	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	39,728	887	96,073	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,705	15,334	1,141	123,522	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	154	16,721	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	76,025	1,037	112,283	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	11,100	147	16,009	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	430	46,535	0.1	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	—	—	—	—	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	23,900	71	7,757	0.0	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	—	16,000	93	10,162	0.0	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	—	9,500	175	18,985	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	49,695	826	89,419	0.1	
SLATE GROCERY REIT	10,300	17,300	261	28,265	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	16,015	154	16,704	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	17,000	78	8,461	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	12,000	139	15,100	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	21,900	355	38,481	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,026,375	901,473	14,972	1,620,008	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 1.9% >	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	37,000	37,000	271	39,775	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	7,200	59	8,732	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	136,700	44,200	330	48,508	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	104	15,288	0.0	
COIMA RES SPA	11,900	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	45,690	33,790	104	15,288	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	18,140	15,570	599	87,868	0.1	
ALTAREA	1,880	2,480	320	46,992	0.1	
KLEPIERRE	107,485	92,974	1,914	280,756	0.3	
GECINA SA	30,292	25,736	2,380	349,135	0.4	
COVIVIO(FP)	26,753	21,972	1,238	181,583	0.2	
MERCIALYS	28,000	36,384	330	48,531	0.1	
CARMILA	25,000	26,392	359	52,795	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	65,171	49,378	2,391	350,791	0.4
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	302,721 8	270,886 8	9,535 —	1,398,455 < 1.7% >
(オランダ)			千ユーロ		
VASTNED RETAIL	10,650	10,650	222	32,566	0.0
WERELDHAVE NV	22,670	22,670	294	43,188	0.1
NSI NV	10,050	10,050	253	37,143	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	17,493	392	57,570	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	64,153 4	60,863 4	1,162 —	170,468 < 0.2% >
(スペイン)			千ユーロ		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	141,272	774	113,539	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI	34,000	34,000	133	19,646	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	187,486	157,888	1,375	201,687	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	364,948 3	333,160 3	2,283 —	334,873 < 0.4% >
(ベルギー)			千ユーロ		
BEFIMMO S. C. A.	14,010	—	—	—	—
COFINIMMO	15,767	14,199	1,243	182,316	0.2
RETAIL ESTATES	6,400	5,335	322	47,337	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	12,100	258	37,887	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	77,922	66,064	1,758	257,919	0.3
MONTEA NV	5,300	4,970	330	48,471	0.1
AEDIFICA	19,919	18,867	1,502	220,394	0.3
CARE PROPERTY INVEST	15,000	15,000	241	35,374	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	9,813	292	42,959	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	176,858 9	146,348 8	5,950 —	872,660 < 1.0% >
(アイルランド)			千ユーロ		
HIBERNIA REIT PLC	365,550	—	—	—	—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	210,000	234	34,371	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	625,550 2	210,000 1	234 —	34,371 < 0.0% >
(その他)			千ユーロ		
CROMWELL REIT EUR	160,000	170,400	260	38,236	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	160,000 1	170,400 1	260 —	38,236 < 0.0% >
ユーロ計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,876,620 31	1,269,647 28	19,861 —	2,912,862 < 3.4% >
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	528,668	446,042	1,703	283,644	0.3
DERWENT LONDON PLC	62,782	53,156	1,232	205,117	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	97,046	82,773	922	153,638	0.2
HAMMERSON PLC	2,291,000	1,673,646	379	63,161	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	70,347	65,316	284	47,428	0.1
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,543	0.0
UNITE GROUP PLC	220,572	190,394	1,724	287,155	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	630,955	721	120,055	0.1

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SHAFTESBURY PLC	157,193	139,823	525	87,519	0.1	
SEGR0 PLC	669,364	572,354	4,527	753,662	0.9	
LAND SECURITIES GROUP PLC	411,457	355,654	2,126	354,050	0.4	
ASSURA PLC	1,467,040	1,400,809	776	129,305	0.2	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	260,756	137	22,919	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	141,780	109,600	577	96,060	0.1	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	350,000	161	26,801	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	268,000	231	38,591	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	405,972	254	42,374	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	98,896	893	148,745	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	464,236	851	141,734	0.2	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	378,400	347	57,826	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	354,157	386	64,262	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	258,000	—	—	—	—	
WAREHOUSE REIT PLC	—	230,000	277	46,252	0.1	
NEWRIVER REIT PL	186,000	126,000	88	14,766	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	330,067	204	34,121	0.0	
PRS REIT PLC/THE	255,000	260,002	223	37,222	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	203,286	138	23,011	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	589,189	606	101,024	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	941,704	888,708	1,245	207,416	0.2	
CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,276	204	34,046	0.0	
HOME REIT PLC	132,934	374,236	309	51,521	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	306,000	269	44,877	0.1	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	110,000	69	11,572	0.0	
AEW UK REIT PLC	118,000	68,000	60	10,154	0.0	
LXI REIT PLC	391,008	811,588	983	163,747	0.2	
REGIONAL REIT LTD	222,000	222,000	139	23,171	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	—	223,421	320	53,371	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	229,355	238	39,631	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,539,477	14,029,027	24,157	4,021,509	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	37	—	< 4.8% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST	262,160	228,066	909	85,656	0.1	
MIRVAC GROUP	2,190,726	1,867,868	3,922	369,227	0.4	
CROMWELL PROPERTY GROUP	862,633	669,440	468	44,110	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	244,874	981	92,430	0.1	
GPT GROUP	1,081,455	906,785	3,899	367,029	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	274,928	467	43,994	0.1	
ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	194,329	522	49,205	0.1	
STOCKLAND	1,326,376	1,130,026	4,034	379,738	0.4	
DEXUS	596,428	509,145	3,956	372,383	0.4	
GOODMAN GROUP	939,643	804,776	13,785	1,297,658	1.5	
VICINITY CENTERS	2,156,333	1,831,690	3,562	335,351	0.4	
CHARTER HALL GROUP	259,369	223,905	2,944	277,151	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	138,810	445	41,942	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	173,646	694	65,381	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	528,421	1,395	131,314	0.2	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ARENA REIT	201,053	161,278	624	58,750	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	255,476	745	70,220	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	320,312	286,964	1,228	115,611	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	113,000	301	28,399	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	601,340	473,590	1,155	108,772	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	117,885	365	34,399	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	324,500	251	23,672	0.0	
HOME CONSORTIUM	107,500	—	—	—	—	
RURAL FUNDS GROUP	191,095	181,331	444	41,818	0.0	
IRONGATE GROUP	272,000	—	—	—	—	
SCENTRE GROUP	2,883,991	2,456,991	7,125	670,702	0.8	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	190,640	140	13,189	0.0	
HOME CONSORTIUM LTD	—	92,191	433	40,786	0.0	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	157,784	525	49,457	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	734,103	924	87,067	0.1	
HEALTHCO REIT	—	137,130	193	18,200	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	240,945	240,945	371	34,927	0.0	
AVENTUS GROUP	233,500	—	—	—	—	
WAYPOINT REIT LTD	390,099	336,956	923	86,906	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	18,190,725	15,987,473	57,744	5,435,457	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 6.4% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AMP NZ OFFICE LTD	682,894	556,295	667	57,529	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	181,387	426	36,735	0.0	
GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	498,199	1,021	88,016	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	743,753	639	55,123	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	417,278	488	42,074	0.0	
STRIDE PROPERTY GROUP	—	300,000	465	40,073	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,867,311	2,696,912	3,707	319,552	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 0.4% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT	1,163,400	997,800	49,690	926,726	1.1	
PROSPERITY REIT	752,000	752,000	1,210	22,579	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	1,315,660	2,039	38,032	0.0	
CHAMPION REIT	1,138,000	745,000	1,840	34,318	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	1,525	28,458	0.0	
FORTUNE REIT	756,000	605,000	3,121	58,221	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,188,400	4,976,460	59,428	1,108,337	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.3% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,805,044	2,383,544	4,528	473,071	0.6	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,847,318	1,581,818	4,096	427,963	0.5	
SUNTEC REIT	1,180,700	1,060,900	1,410	147,392	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,580,700	1,523,285	2,284	238,683	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	859,400	849,400	437	45,695	0.1	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	991,877	847,977	809	84,593	0.1	
KEPPEL REIT	1,051,400	936,300	833	87,047	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	634,262	469,862	916	95,709	0.1	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ESR-LOGOS REIT	1,448,995	2,418,564	846	88,425	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	397,900	485	50,708	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	553,921	545	56,994	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	538,100	137	14,333	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	275,000	335	35,046	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	225,500	163,200	660	69,043	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	941,863	2,053	214,483	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,241,473	1,090,073	1,722	179,913	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,222,100	—	—	—	—	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	326	34,127	0.0	
SPH REIT	576,800	409,600	352	36,796	0.0	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	79	8,273	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	211	22,092	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	1,273,644	407	42,574	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	883,950	592	61,866	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	328,400	188	19,725	0.0	
IREIT GLOBAL	405,985	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	709,903	626,303	1,102	115,145	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,610,096	1,364,796	1,514	158,248	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	24,807,958	21,934,200	26,880	2,807,955	
	銘 柄 数<比 率>	27	25	—	<3.3%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	42,950	172,659	18,543	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	—	13,200	68,508	7,357	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	36,380	251,022	26,959	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	11,253	49,794	5,347	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	72,480	72,480	256,216	27,517	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	25,433	119,153	12,797	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	—	14,201	52,543	5,643	0.0	
JR REIT XXVII	64,338	76,683	313,633	33,684	0.0	
SK REITS CO LTD	—	39,229	177,707	19,085	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	81,340	299,737	32,191	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	28,240	90,509	9,720	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	—	14,949	46,117	4,953	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	284,799	456,338	1,897,603	203,802	
	銘 柄 数<比 率>	7	12	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	103,500	103,500	1,857	76,520	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	115,000	1,003	41,336	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	—	360,000	617	25,444	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	103,500	578,500	3,479	143,301	
	銘 柄 数<比 率>	1	3	—	<0.2%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	83,040,530	75,398,799	—	84,101,972	
	銘 柄 数<比 率>	329	324	—	<99.5%>	

(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) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 84,101,972	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	582,428	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	84,684,400	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(84,571,382千円)の投資信託財産総額(84,684,400千円)に対する比率は99.9%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=146.41円	1カナダドル=108.20円	1ユーロ=146.66円
1イギリスポンド=166.47円	1オーストラリアドル=94.13円	1ニュージーランドドル=86.18円
1香港ドル=18.65円	1シンガポールドル=104.46円	1韓国ウォン=0.1074円
1イスラエルシェケル=41.1882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 2022年11月10日現在
(A)資 産	84,722,360,456円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	477,664,615
投 資 証 券(評価額)	84,101,972,004
未 収 入 金	40,041,724
未 収 配 当 金	102,682,113
(B)負 債	161,738,022
未 払 金	38,047,396
未 払 解 約 金	123,690,371
未 払 利 息	255
(C)純 資 産 総 額(A-B)	84,560,622,434
元 本	34,643,734,497
次 期 繰 越 損 益 金	49,916,887,937
(D)受 益 権 総 口 数	34,643,734,497口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,409円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日
(A)配 当 等 収 益	3,906,329,222円
受 取 配 当 金	3,905,347,679
受 取 利 息	1,076,690
そ の 他 収 益 金	103,158
支 払 利 息	△198,305
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,952,673,169
売 買 益	27,077,667,393
売 買 損	△32,030,340,562
(C)そ の 他 費 用	△43,448,050
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,089,791,997
(E)前 期 繰 越 損 益 金	60,773,417,444
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	12,865,843,146
(G)解 約 差 損 益 金	△22,632,580,656
(H)計 (D+E+F+G)	49,916,887,937
次 期 繰 越 損 益 金(H)	49,916,887,937

- (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) (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3) (G) 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41,344,855,558円、期中追加設定元本額は8,500,047,775円、期中一部解約元本額は15,201,168,836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。

グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	12,962,660,028円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,484,411,624円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,690,527,564円
分散投資コア戦略ファンドS	1,470,010,390円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,166,221,268円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,112,545,906円
分散投資コア戦略ファンドA	663,634,730円
コア投資戦略ファンド(切替型)	489,201,341円
コア投資戦略ファンド(安定型)	387,769,767円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	345,064,516円
グローバル経済コア	237,997,812円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	207,210,041円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	192,567,868円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	149,051,071円
SMT インデックスバランス・オープン	132,826,142円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	100,614,514円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	97,458,043円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	96,415,726円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	94,091,235円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	92,238,456円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	91,762,324円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	78,211,546円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	63,337,930円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	60,705,130円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	59,528,635円
グローバル3資産バランスオープン	58,177,468円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	34,531,715円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,431,078円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,192,112円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,334,542円
10資産分散投資ファンド	3,975円

お知らせ

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

運用報告書

第5期(決算日 2022年7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2017年10月11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	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。 別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。 iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
組入制限	株式(新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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		投信証券組入比率	純資産額
	円	%	期騰落	中率		
設定日(2017年10月11日)	10,000	—	10,000	—	—	百万円 3,000
第1期(2018年7月10日)	9,520	△4.8	9,624	△3.8	100.0	17,516
第2期(2019年7月10日)	10,200	7.1	10,341	7.5	99.8	27,180
第3期(2020年7月10日)	12,833	25.8	13,346	29.1	99.0	28,966
第4期(2021年7月12日)	12,644	△1.5	13,227	△0.9	98.9	36,114
第5期(2022年7月11日)	12,005	△5.1	12,602	△4.7	100.1	30,762

ベンチマークは、LBMA金価格(円ヘッジベース)です。

LBMA金価格とは、正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

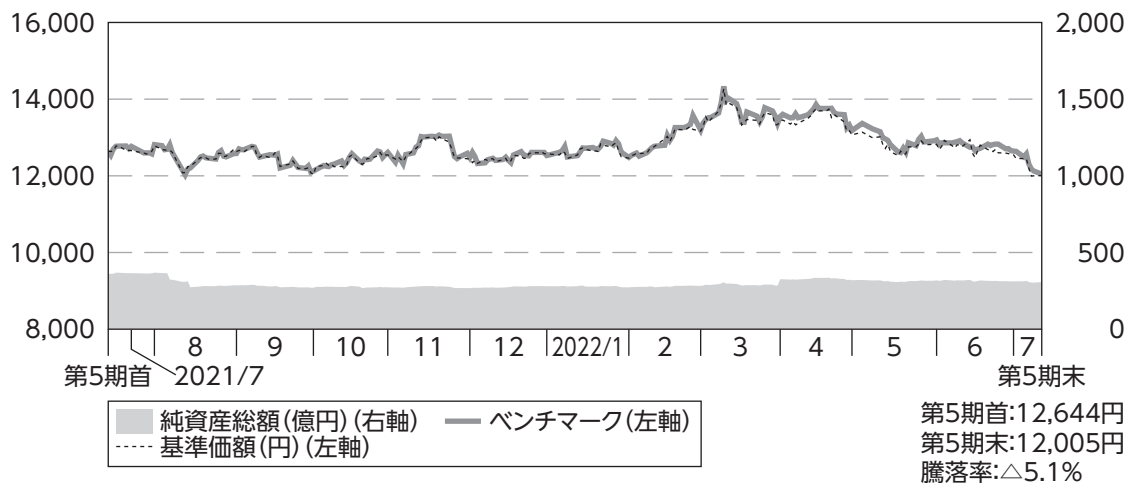
当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		投資信託証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(当 期 首) 2021年 7月12日	円 12,644	% ー	13,227	% ー	% 98.9
7月末	12,783	1.1	13,404	1.3	98.3
8月末	12,635	△0.1	13,161	△0.5	99.7
9月末	12,032	△4.8	12,681	△4.1	101.5
10月末	12,544	△0.8	13,192	△0.3	101.9
11月末	12,437	△1.6	13,052	△1.3	100.7
12月末	12,573	△0.6	13,106	△0.9	101.0
2022年 1月末	12,461	△1.4	13,055	△1.3	99.9
2月末	13,166	4.1	13,801	4.3	99.9
3月末	13,431	6.2	14,168	7.1	99.9
4月末	13,068	3.4	13,788	4.2	105.3
5月末	12,821	1.4	13,533	2.3	98.5
6月末	12,545	△0.8	13,228	0.0	106.0
(当 期 末) 2022年 7月11日	12,005	△5.1	12,602	△4.7	100.1

(注) 騰落率は期首比です。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

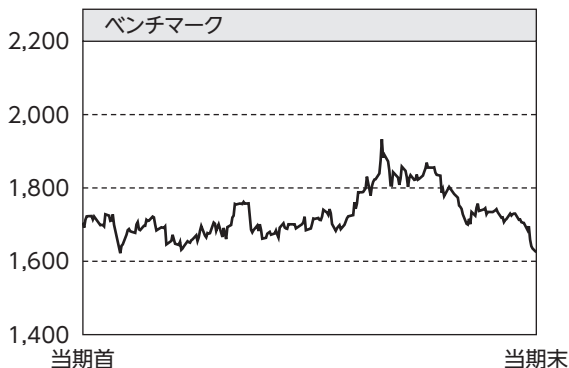


(注)ベンチマークは、2021年7月12日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

投資環境



金価格は下落しました。

新型コロナウイルスの感染拡大懸念が支えとなった一方、米国の利上げ前倒し観測が高まったことから2022年2月上旬にかけて一進一退の展開となりました。3月上旬にかけては、世界的にインフレ懸念が高まっていることや、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を背景に金に対する安全資産需要が強まったことなどから大幅に上昇しました。その後は、ドル高が大幅に進行したことやFRB(米連邦準備理事会)による利上げペースが一段と加速するとの見方が強まったこと、米10年国債利回りが約11年ぶりの高水準まで上昇したことなどが嫌気されて下落し、期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

金現物に投資するETF(上場投資信託証券)の組入比率を期を通じて高位に維持し、組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行うことでベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

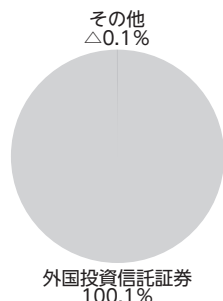
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	100.1%
2	――	――	――
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

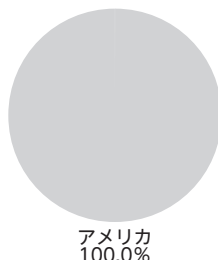
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数			1

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

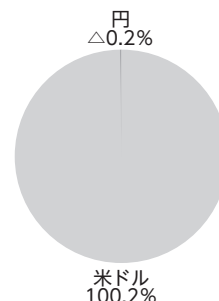
○資産別配分



○国別配分



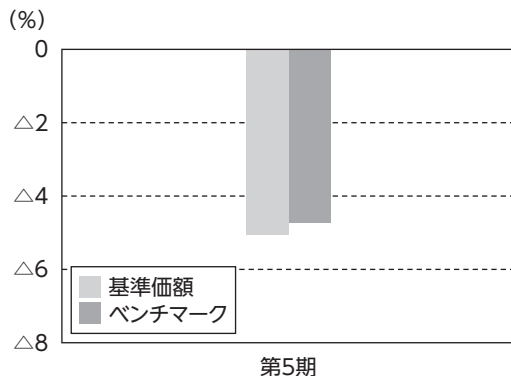
○通貨別配分



(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、キャッシュ要因(マイナス要因)です。

今後の運用方針

主として別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)(以下「ベンチマーク」といいます。)に連動する投資成果を目指します。

別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

別に定める「ベンチマーク」とは、次のものをいいます。

LBMA金価格(円ヘッジベース)

ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年7月13日~2022年7月11日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	1円 (-) (-) (-) (1) (-) (-)	0.006% (-) (-) (-) (0.006) (-) (-)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	0 (-) (-) (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (-) (-) (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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (2) (-) (0)	0.016 (0.016) (-) (0.000)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.022	

(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(12,708円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES GOLD TRUST	1,346	47,192	3,942	134,806
小 計	1,346	47,192	3,942	134,806

(注)金額は受渡代金です。

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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 41,881	百万円 1,671	% 4.0	百万円 41,925	百万円 1,673	% 4.0

(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。

組入資産の明細

<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 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ) ISHARES GOLD TRUST			千米ドル	
	9,416	6,820	225,696	30,800,841
合 計	口 数 ・ 金 額 9,416	6,820	225,696	30,800,841
	銘 柄 数 < 比 率 > 1	1	—	<100.1%>

(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。

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	30,800,841	98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	539,103	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	31,339,944	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(30,830,126千円)の投資信託財産総額(31,339,944千円)に対する比率は98.4%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=136.47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 2022年7月11日現在
(A)資 産	62,921,335,647円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	529,941,278
投資信託受益証券(評価額)	30,800,841,961
未 収 入 金	31,590,552,408
(B)負 債	32,158,581,840
未 払 金	32,146,857,996
未 払 解 約 金	11,723,825
未 払 利 息	19
(C)純 資 産 総 額(A-B)	30,762,753,807
元 本	25,625,430,409
次 期 繰 越 損 益 金	5,137,323,398
(D)受 益 権 総 口 数	25,625,430,409口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,005円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年7月13日 至 2022年7月11日
(A)配 当 等 収 益	△77,101円
受 取 利 息	1,327
支 払 利 息	△78,428
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,927,005,300
売 買 益	7,558,863,751
売 買 損	△9,485,869,051
(C)そ の 他 費 用	△4,866,307
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,931,948,708
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,551,613,217
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,041,828,694
(G)解 約 差 損 益 金	△2,524,169,805
(H)計 (D+E+F+G)	5,137,323,398
次 期 繰 越 損 益 金(H)	5,137,323,398

(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) (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3) (G) 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28,562,552,203円、期中追加設定元本額は6,967,660,991円、期中一部解約元本額は9,904,782,785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。

分散投資コア戦略ファンドS	10,094,568,830円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,170,298,646円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	2,991,595,246円
分散投資コア戦略ファンドA	2,712,735,507円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,142,523,185円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,401,776,538円
グローバル経済コア	865,761,480円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	703,991,983円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	531,503,932円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	517,708,034円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	319,203,374円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	114,323,910円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	59,439,744円

お知らせ

該当事項はありません。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

運用報告書

第7期（決算日 2022年8月25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2015年12月11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	ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	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1万口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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額	
					債 組 入 比 率
第3期(2018年8月27日)	円 10,311	% △0.2	% 97.0	% —	百万円 28,837
第4期(2019年8月26日)	10,196	△1.1	98.7	—	29,321
第5期(2020年8月25日)	10,695	4.9	97.0	—	27,866
第6期(2021年8月25日)	10,662	△0.3	97.9	—	43,449
第7期(2022年8月25日)	10,043	△5.8	97.5	—	43,727

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2021年 8月25日	円 10,662	% —	% 97.9	% —
8月末	10,677	0.1	97.9	—
9月末	10,757	0.9	97.8	—
10月末	10,682	0.2	97.8	—
11月末	10,689	0.3	97.6	—
12月末	10,649	△0.1	97.5	—
2022年 1月末	10,621	△0.4	95.9	—
2月末	10,609	△0.5	97.4	—
3月末	10,429	△2.2	97.3	—
4月末	10,424	△2.2	97.7	—
5月末	10,418	△2.3	97.8	—
6月末	10,380	△2.6	97.8	—
7月末	10,250	△3.9	97.5	—
(当 期 末) 2022年 8月25日	10,043	△5.8	97.5	—

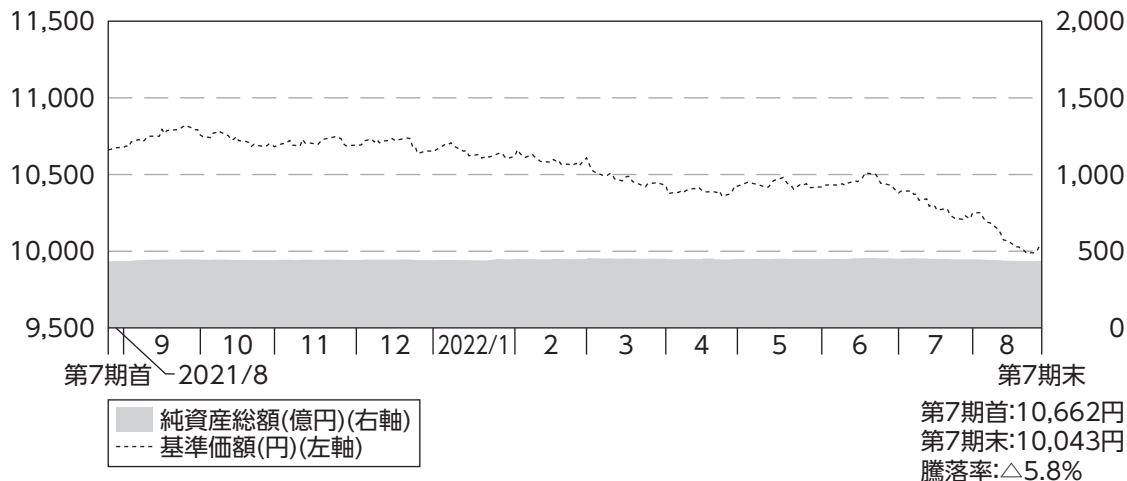
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初から2021年12月にかけては概ね横ばいで推移したものの、2022年1月以降、インフレの高進を背景にFRB(米連邦準備理事会)やECB(欧州中央銀行)による金融引き締めが加速したことや、ロシアによるウクライナ侵攻を受けて地政学リスクが高まる中で、軟調に推移しました。

戦略別には、エマージング債券などがプラスに寄与した一方、世界株式Ⅱやグレーター・チャイナ株式などがマイナスに影響しました。エマージング債券は、インフレの高進と中央銀行による連続利上げ、地政学リスクの高まりなどを受けて、ポーランドやハンガリーなどの東欧の金利スワップなどがプラスに寄与しました。一方で、世界株式Ⅱは、長期金利上昇によるバイオ株に対する売り圧力に加えて、決算実績が市場のコンセンサスを下回り株価が下落した米国のバイオテクノロジー企業のロング・ポジションなどがマイナスに影響しました。また、グレーター・チャイナ株式は、中国ADR(米預託証券)銘柄が上場廃止となる可能性が浮上する中、中国の自動車販売の鈍化が嫌気されて株価が下落した中国の電気自動車メーカーのロング・ポジションなどがマイナスに影響しました。

投資環境

株式市場は、2021年末にかけて新型コロナウイルス変異株の感染拡大が懸念される中、米国の良好な経済指標などを背景に底堅く推移しましたが、年明け以降、インフレの高進を背景にFRBやECBによる想定を上回る利上げの可能性が意識され長期金利が大幅に上昇したほか、ロシア・ウクライナ戦争による地政学リスクが警戒される中で、大幅に下落しました。また、債券市場は、インフレの高進を背景にFRBやECBによる利上げが加速するとの見方が広がったことなどから、下落(利回りは上昇)しました。7月以降は、金融引き締め加速による景気減速懸念の高まりを背景に2023年の利下げ期待から、株式および債券市場は上昇に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」(以下「PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンド」ということがあります。))の基準価額の値動きに概ね連動する円建債券の組み入れを高位に保つ運用を行いました。

<円建債券と「PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンド」の連動性>

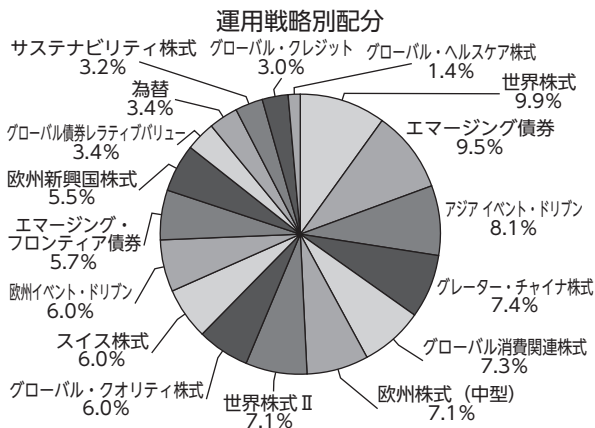
基準価額への反映期間(2021年8月20日~2022年8月22日)のパフォーマンス

PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンド	△5.7%
円建債券	△5.9%
差異	△0.2%

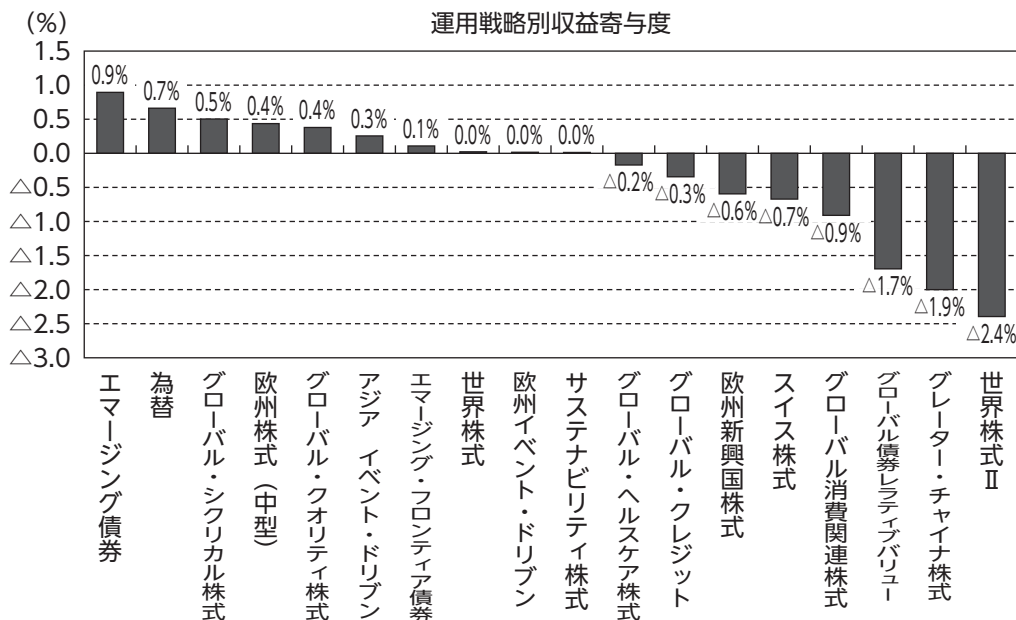
差異の要因は、管理報酬等によるものです。

管理報酬控除後の円建債券のパフォーマンスは概ねPTR ディバーシファイド・アルファ・ファンドのパフォーマンスに連動しています。

当ファンドのポートフォリオ



※配分比率は純資産総額に対する割合です。
 ※2022年7月末時点のPTR ディバーシファイド・アルファ・ファンドの運用戦略別配分です。
 なお、各戦略については、後掲「各戦略の概要」をご参照ください。



※グローバル・シクリカル株式は、2021年8月26日～2021年11月16日の寄与度です。
 ※その他の戦略は、2021年8月26日～2022年8月25日の寄与度です。

当ファンドのポートフォリオ

各戦略の概要

戦略名	概要
エマージング債券	エマージング債券市場における収益源泉(為替、金利等)からリターンを獲得を目指す、トータルリターンアプローチの債券投資戦略。
グレーター・チャイナ株式	グレーター・チャイナ株式(中国、香港、台湾等)市場におけるロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
グローバル・クオリティ株式	グローバル株式を対象に企業の「クオリティ」に注目し、クオンツを駆使してポートフォリオを構築するマーケット・ニュートラル戦略。大型株と流動性の高い銘柄を中心に投資。
グローバル・クレジット	主に流動性が高い投資適格債券を投資対象とするグローバル・クレジット投資戦略。デューレーション・リスクを極力抑制し、クレジット・スプレッドの相対価値取引によりリターンの創出を目指す。
グローバル・シクリカル株式	世界株式のうち景気循環セクターに注目し、ロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
グローバル債券レティバリュエーション	アンコンストレインド(投資制約の緩和された戦略)かつ柔軟なアプローチに基づく債券投資戦略。ボラティリティを抑制しながら目標リターンの達成を目指す。(主なリターンの源泉は、為替、クレジット・スプレッド、金利等)
スイス株式	スイス株式市場におけるロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
欧州イベント・ドリブン	欧州大型株を中心としたカタリストに着目したマーケット・ニュートラル戦略。カタリストとして、コーポレート・イベント(M&Aなど)、構造的な勝者と敗者(規制の変更による影響など)等に分類。
欧州株式(中型)	欧州の中型株を中心としたロング、ショートのリターン創出を目指す株式マーケット・ニュートラル戦略。
世界株式	ボトムアップのファンダメンタルズ分析とトップダウンのマクロ分析に基づき、グローバル株のロング、ショートのリターン創出を目指す戦略。
グローバル消費関連株式	グローバルな株式を対象に、主に消費、テクノロジー、メディア、通信等のセクターにおける消費関連株式に注目し、ロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
世界株式II	企業のファンダメンタルズ分析に基づき、グローバルな株式を投資対象としたロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
為替	流動性の高い通貨(G10および新興国)を対象に、為替スポット、フォワード、オプション等を主要ツールとして使用し、絶対リターン獲得を目指す為替戦略。
欧州新興国株式	東欧、ロシア、トルコおよびギリシャを含む欧州圏の新興国市場における、ロング・ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
エマージング・フロンティア債券	主にフロンティア市場(南米、東欧、アフリカ、中央アジア、中東、アジア太平洋の国々)を投資対象とする債券戦略。デューレーション・リスクを抑制し、金利の方向性などからアルファ獲得を目指す。
アジア イベント・ドリブン	アジア株式でカタリスト(コーポレート・イベント(規制変更や株主還元など)、M&A等)に着目したマーケット・ニュートラル戦略。
サステナビリティ株式	米国株式を対象に、サステナビリティの観点に注目し、ロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
グローバル・ヘルスケア株式	グローバル株式を対象に、ヘルスケアセクターにおける株式について、ロング、ショートのリターン創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。

<PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

当ファンドの組入資産の内容

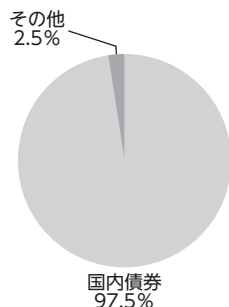
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	ケイマン諸島	97.5%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

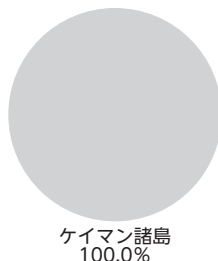
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

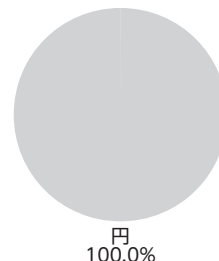
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年8月26日~2022年8月25日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.030 (0.030) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.030	

(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(10,548円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 2,798,597	千円 —

(注1)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2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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			期 末		
	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
コール・ローン	百万円 288,953	百万円 13,937	% 4.8	百万円 289,299	百万円 13,937	% 4.8

(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。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB/B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
	千円	千円	%	%	%	%	%
普通社債券 (含む投資法人債券)	41,824,000 (41,824,000)	42,651,278 (42,651,278)	97.5 (97.5)	— (—)	— (—)	97.5 (97.5)	— (—)
合 計	41,824,000 (41,824,000)	42,651,278 (42,651,278)	97.5 (97.5)	— (—)	— (—)	97.5 (97.5)	— (—)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)()内は非上場債で内書きです。

(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		期 末		
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
普通社債券(含む投資法人債券)					
S I G N U M G E N E V A 1 0 % 1 2 / 1 5 / 2 5	0	41,824,000	42,651,278	2025/12/15	
合 計		41,824,000	42,651,278		

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 42,651,278	97.5 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,076,101	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	43,727,379	100.0

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 2022年8月25日現在
(A)資 産	43,727,379,857円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,076,101,137
公 社 債(評価額)	42,651,278,720
(B)負 債	131,810
未 払 解 約 金	130,000
未 払 利 息	1,810
(C)純 資 産 総 額(A-B)	43,727,248,047
元 本	43,541,331,894
次 期 繰 越 損 益 金	185,916,153
(D)受 益 権 総 口 数	43,541,331,894口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,043円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年8月26日 至 2022年8月25日
(A)配 当 等 収 益	△409,052円
受 取 利 息	8,035
支 払 利 息	△417,087
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△2,673,608,800
売 買 損 益	△2,673,608,800
(C)そ の 他 費 用	△13,553,657
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,687,571,509
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,699,268,792
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	236,799,324
(G)解 約 差 損 益 金	△62,580,454
(H)計 (D+E+F+G)	185,916,153
次 期 繰 越 損 益 金(H)	185,916,153

- (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) (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3) (G) 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40,749,748,302円、期中追加設定元本額は4,217,192,528円、期中一部解約元本額は1,425,608,936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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	21,786,673,476円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	19,845,586,696円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(SMA専用)	822,608,827円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家専用)	676,314,383円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	410,148,512円

お知らせ

該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

運用報告書

第5期（決算日 2022年7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2017年10月10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	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券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割合には制限を設けません。

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1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未滿は切捨て、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	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
設定日(2017年10月10日)	10,000	—	—	—	0.4
第1期(2018年7月10日)	9,509	△4.9	96.5	—	13,283
第2期(2019年7月10日)	10,662	12.1	97.6	—	27,261
第3期(2020年7月10日)	10,113	△5.1	96.8	—	24,162
第4期(2021年7月12日)	9,712	△4.0	97.7	—	18,398
第5期(2022年7月11日)	10,481	7.9	98.4	—	21,178

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2021年7月12日	9,712	—	97.7	—
7月末	9,864	1.6	97.2	—
8月末	9,935	2.3	98.1	—
9月末	9,646	△0.7	99.9	—
10月末	9,542	△1.8	99.4	—
11月末	9,556	△1.6	98.4	—
12月末	10,152	4.5	99.4	—
2022年1月末	10,230	5.3	96.7	—
2月末	10,120	4.2	97.6	—
3月末	10,646	9.6	103.8	—
4月末	10,706	10.2	92.2	—
5月末	10,480	7.9	96.0	—
6月末	10,489	8.0	99.1	—
(当 期 末) 2022年7月11日	10,481	7.9	98.4	—

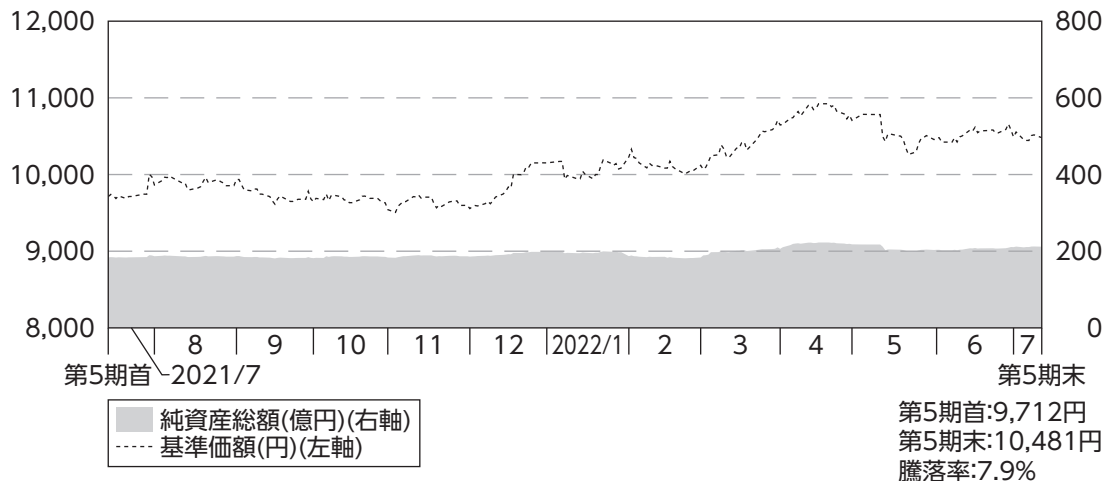
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

主要投資対象である米ドル建債券において、Two Sigmaグループの運用会社が活用する計量モデルに基づき銘柄選択を行いました。期初はもみ合いで推移しましたが、2021年12月以降は銘柄選択やトレード等が奏功し始め、2022年1月から2月の市場混乱期は下振れを抑制しつつ、3月以降再び市場の落ち着きと共に着実にパフォーマンスを積み上げたことから、基準価額は上昇しました。

投資環境

当期の米国株式市場は下落しました。期前半は米国でインフラ投資計画が可決されたことや、概ね良好な企業決算などを背景に上昇し、その後、2021年の年末にかけても底堅い経済指標などを受けて上昇基調を維持しました。2022年の年明け以降は米国の金融引き締めペースの加速懸念や、ロシアによるウクライナ侵攻を受けて地政学リスクが高まり、投資家心理が悪化したことから下落する展開となりました。期末にかけては、欧米中央銀行が金融引き締め姿勢を鮮明にしたことを受け、先行き景気に対する警戒感などが広がり軟調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ(米ドル売り/円買い)を行い、米ドル/円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期前半はロング・エクスポージャーは米ドル建債券の時価総額比で170%前後、ショート・エクスポージャーは150%前後で推移しました。期後半は、ロング・エクスポージャーは180%前後、ショート・エクスポージャーは150%程度から180%程度で推移しました。

当ファンドの組入資産の内容

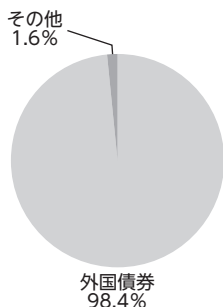
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 004 10/18/22	アイルランド	98.4%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

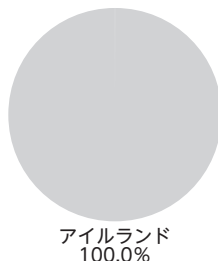
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

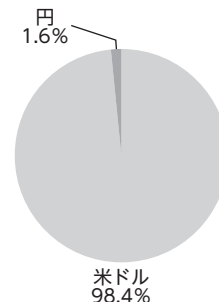
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

今後の運用方針

UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債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等の買建(ロングポジション)と売建(ショートポジション)を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年7月13日~2022年7月11日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.027 (0.027) (-) (-)	(c) 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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.027	

(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(10,113円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外国	ア メ リ カ	社債券(投資法人債券を含む)	千米ドル 11,225	千米ドル 35,565

(注1)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2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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	231,984	231,984	100.0	230,561	230,561	100.0
為替直物取引	1,294	1,294	100.0	4,362	4,362	100.0
コール・ローン	155,635	8,888	5.7	154,349	8,716	5.6

(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。

※ 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(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

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		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 133,000	千米ドル 152,737	千円 20,844,027	% 98.4	% —	% —	% —	% 98.4
合 計	133,000	152,737	20,844,027	98.4	—	—	—	98.4

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘 柄	当		期		末		償還年月日
	利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		債 還 年 月 日		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
(アメリカ) 普通社債券(含む投資法人債券) STAR HELIOS 004 10/18/22	—	千米ドル 133,000	千米ドル 152,737	20,844,027	2022/10/18		
合 計				20,844,027			

(注) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場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	
公 社 債	千円 20,844,027	% 92.6	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,662,886	7.4	
投 資 信 託 財 産 総 額	22,506,913	100.0	

(注1) 当期末における外貨建純資産(20,844,027千円)の投資信託財産総額(22,506,913千円)に対する比率は92.6%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=136.47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 2022年7月11日現在
(A)資 産	43,484,316,061円
コール・ローン等	1,650,504,328
公社債(評価額)	20,844,027,533
未 収 入 金	20,989,784,200
(B)負 債	22,306,281,983
未 払 金	22,303,557,000
未 払 解 約 金	2,724,479
未 払 利 息	504
(C)純 資 産 総 額(A-B)	21,178,034,078
元 本	20,206,233,087
次 期 繰 越 損 益 金	971,800,991
(D)受 益 権 総 口 数	20,206,233,087口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,481円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年7月13日 至 2022年7月11日
(A)配 当 等 収 益	△236,499円
受 取 利 息	5,765
支 払 利 息	△242,264
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,477,127,654
売 買 益	6,462,782,254
売 買 損	△4,985,654,600
(C)そ の 他 費 用	△5,318,917
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	1,471,572,238
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△545,970,453
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	127,004,236
(G)解 約 差 損 益 金	△80,805,030
(H)計 (D+E+F+G)	971,800,991
次 期 繰 越 損 益 金(H)	971,800,991

(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) (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3) (G)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18,944,877,100円、期中追加設定元本額は4,371,214,556円、期中一部解約元本額は3,109,858,569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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	13,674,134,537円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,003,339,241円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,649,982,651円
コア投資戦略ファンド(切替型)	920,450,992円
FOFs用米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	547,849,713円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	542,904,889円
米国株式LSファンド(SMA専用)	507,293,494円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	302,946,176円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	57,331,394円

お知らせ

該当事項はありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2022年5月26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2019年7月8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	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	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1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未滿は切捨て、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	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
設定日(2019年7月 8日)	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 2,500
第1期(2020年5月26日)	11,113	11.1	98.0	—	10,908
第2期(2021年5月26日)	11,168	0.5	98.9	—	20,334
第3期(2022年5月26日)	11,343	1.6	98.6	—	23,203

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2021年 5月26日	円 11,168	% —	% 98.9	% —
5月末	11,180	0.1	98.9	—
6月末	11,301	1.2	99.0	—
7月末	11,315	1.3	99.0	—
8月末	11,373	1.8	98.9	—
9月末	11,212	0.4	99.0	—
10月末	11,122	△0.4	99.0	—
11月末	11,661	4.4	99.2	—
12月末	11,832	5.9	99.4	—
2022年 1月末	11,524	3.2	99.2	—
2月末	11,416	2.2	99.0	—
3月末	11,152	△0.1	98.5	—
4月末	11,345	1.6	98.7	—
(当 期 末) 2022年 5月26日	11,343	1.6	98.6	—

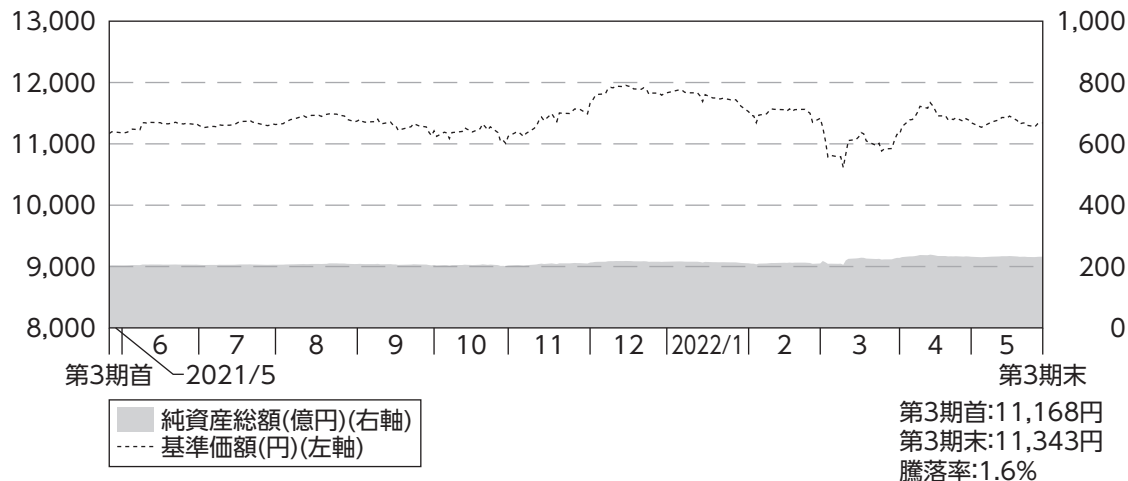
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、ブルームバーグ商品フォワード指数*の騰落率がブルームバーグ商品指数の騰落率を上回ったため、前期末比で上昇しました。

*ブルームバーグ商品指数と構成商品(エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物)および構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数です。

投資環境

商品市場は、世界的な経済活動の再開などを背景にエネルギーセクターや代替エネルギーの原料となる穀物セクターを中心に堅調に推移しました。天然ガス市場では、冬季の暖房用の備蓄需要などにより世界的に価格が高騰しましたが、2021年11月から12月にかけては、米国内での生産と在庫が増加したことや冬場の温暖な天候が予想されたことで足元の暖房需要が減退するとの見方などから期近物の価格下落幅が期先物を上回りました。2022年1月以降は、ロシアとウクライナ情勢の緊迫化を受けて原油市場をはじめとしたエネルギーセクターで需給逼迫懸念から期近物を中心に上昇する局面がありましたが、主要国による石油備蓄の放出などを受けて上昇分を戻しました。

当ファンドのポートフォリオ

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券[※]への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とブルームバーグ商品フォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指して運用を行いました。

[※]主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値と、ブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券です。なお、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値です。

当ファンドの組入資産の内容

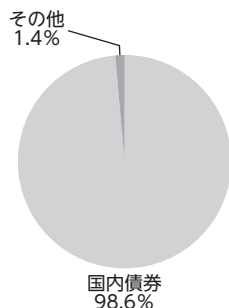
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 07/13/22	アイルランド	98.6%
2	――	――	――
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

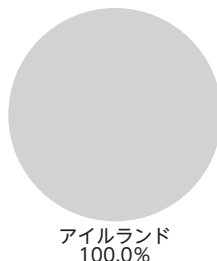
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数		1	

(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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数(以下、「フォワード指数※1」といいます。)の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。

※1 この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品(エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物)及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。

※2 運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年5月27日~2022年5月26日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.027 (0.027) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.027	

(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(11,369円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 2,372,840	千円 —

(注1)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2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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			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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
コール・ローン	75,531	3,690	4.9	75,450	3,658	4.8

(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。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A)債券種類別開示

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB格以下 B格以上比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
普通社債券 (含む投資法人債券)	20,030,000 (20,030,000)	22,876,263 (22,876,263)	98.6 (98.6)	— (—)	— (—)	— (—)	98.6 (98.6)
合 計	20,030,000 (20,030,000)	22,876,263 (22,876,263)	98.6 (98.6)	— (—)	— (—)	— (—)	98.6 (98.6)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)()内は非上場債で内書きです。

(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		末	
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)				
STAR HELIOS 0%	07/13/22	20,030,000	22,876,263	2022/7/13
合 計		20,030,000	22,876,263	

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 22,876,263	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	332,374	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	23,208,637	100.0

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 2022年5月26日現在
(A)資 産	23,208,637,555円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	332,374,555
公 社 債(評価額)	22,876,263,000
(B)負 債	5,438,153
未 払 解 約 金	5,437,917
未 払 利 息	236
(C)純 資 産 総 額(A-B)	23,203,199,402
元 本	20,455,898,129
次 期 繰 越 損 益 金	2,747,301,273
(D)受 益 権 総 口 数	20,455,898,129口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,343円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年5月27日 至 2022年5月26日
(A)配 当 等 収 益	△101,543円
受 取 利 息	2,066
支 払 利 息	△103,609
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	389,549,000
売 買 益	392,519,000
売 買 損	△2,970,000
(C)そ の 他 費 用	△5,615,093
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	383,832,364
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,126,032,414
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	363,176,344
(G)解 約 差 損 益 金	△125,739,849
(H)計 (D+E+F+G)	2,747,301,273
次 期 繰 越 損 益 金(H)	2,747,301,273

- (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) (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3) (G)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18,208,179,315円、期中追加設定元本額は3,088,386,699円、期中一部解約元本額は840,667,885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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	13,906,318,544円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,103,361,644円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,737,763,402円
コア投資戦略ファンド(切替型)	973,161,458円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	579,782,319円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	405,735,352円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	358,504,252円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	337,740,708円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	53,530,450円

お知らせ

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2022年3月10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10月6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	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	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1万口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 円	騰 落 率 %	債 券 先 物 率 %	債 券 先 物 率 %	純 資 産 額 百万円
設定日(2020年10月6日)	10,000	—	—	—	0.4
第1期(2021年3月10日)	9,132	△8.7	98.7	—	17,580
第2期(2022年3月10日)	7,851	△14.0	98.8	—	18,312

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率 %	債 組 入 比 率 %	債 券 先 物 率 %
(当 期 首) 2021年 3月10日	9,132	—	98.7	—
3月末	9,000	△1.4	96.3	—
4月末	8,983	△1.6	98.6	—
5月末	8,955	△1.9	99.1	—
6月末	8,966	△1.8	98.8	—
7月末	8,898	△2.6	99.2	—
8月末	8,865	△2.9	98.5	—
9月末	8,773	△3.9	98.0	—
10月末	8,666	△5.1	99.0	—
11月末	8,654	△5.2	99.0	—
12月末	8,449	△7.5	99.3	—
2022年 1月末	7,728	△15.4	99.1	—
2月末	7,859	△13.9	98.9	—
(当 期 末) 2022年 3月10日	7,851	△14.0	98.8	—

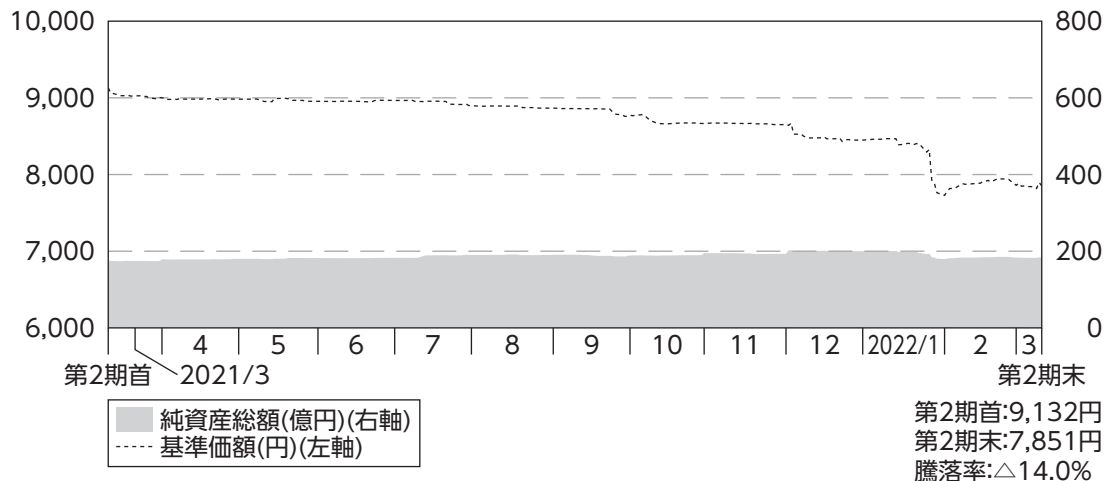
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の米国株式イントラデイ・トレンド戦略※のリターンがマイナスとなったことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

※米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。

投資環境

米国株式市場は、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展を背景に経済正常化への期待が高まったことや上院にて約1兆ドル規模のインフラ投資計画が可決されたこと、パウエルFRB(米連邦準備理事会)議長によるハト派的な発言などを受けて、2021年8月末にかけて堅調に推移しました。その後も、概ね良好な企業決算などを受けて2021年12月末にかけて一段高となりましたが、2022年1月以降は、世界的にインフレ懸念が高まったことやFRBの先行きの金融政策に対するタカ派的な姿勢が警戒されたこと、ロシアによるウクライナ侵攻を受けた欧米の対ロシア経済制裁に伴う世界経済の減速懸念などから軟調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

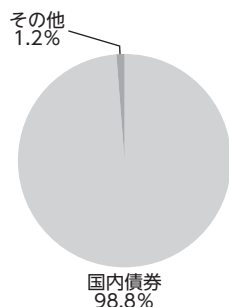
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 10/18/22	アイルランド	98.8%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

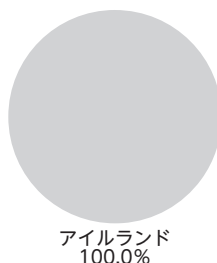
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

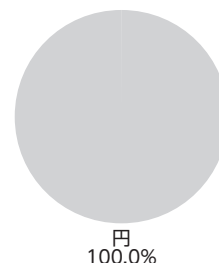
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

今後の運用方針

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年3月11日~2022年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.034 (0.034) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.034	

(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(8,649円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 4,397,624	千円 797,445

(注1)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2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

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			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
コール・ローン	百万円 56,010	百万円 521	% 0.9	百万円 56,019	百万円 502	% 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。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A)債券種類別開示

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 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
普通社債券 (含む投資法人債券)	千円 23,100,000 (23,100,000)	千円 18,087,300 (18,087,300)	% 98.8 (98.8)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 98.8 (98.8)
合 計	23,100,000 (23,100,000)	18,087,300 (18,087,300)	98.8 (98.8)	— (—)	— (—)	— (—)	98.8 (98.8)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)個別銘柄開示

当 期	期	末		
銘 柄 名	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)				
STAR HELIOS 0% 10/18/22	0	23,100,000	18,087,300	2022/10/18
合 計		23,100,000	18,087,300	

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	18,087,300	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	225,973	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	18,313,273	100.0

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 2022年3月10日現在
(A)資 産	18,313,273,905円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	225,973,905
公 社 債(評価額)	18,087,300,000
(B)負 債	500,349
未 払 解 約 金	500,265
未 払 利 息	84
(C)純 資 産 総 額(A-B)	18,312,773,556
元 本	23,324,628,395
次 期 繰 越 損 益 金	△5,011,854,839
(D)受 益 権 総 口 数	23,324,628,395口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,851円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年3月11日 至 2022年3月10日
(A)配 当 等 収 益	△99,181円
受 取 利 息	1,208
支 払 利 息	△100,389
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△2,859,119,000
売 買 損 益	△2,859,119,000
(C)そ の 他 費 用	△6,340,750
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,865,558,931
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△1,670,438,514
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△671,609,661
(G)解 約 差 損 益 金	195,752,267
(H)計 (D+E+F+G)	△5,011,854,839
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△5,011,854,839

- (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) (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3) (G)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19,250,812,921円、期中追加設定元本額は5,537,986,730円、期中一部解約元本額は1,464,171,256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。

分散投資コア戦略ファンドS	10,130,805,762円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	7,294,191,710円
分散投資コア戦略ファンドA	2,451,736,764円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,033,251,360円
コア投資戦略ファンド(成長型)	755,000,000円
コア投資戦略ファンド(安定型)	620,000,000円
コア投資戦略ファンド(切替型)	280,000,000円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	247,496,271円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	226,027,023円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	147,960,259円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	122,244,049円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	15,915,197円

お知らせ

該当事項はありません。

JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用報告書

第9期（決算日 2022年10月20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2014年1月7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	わが国の金融商品取引所等に上場され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1万口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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率 株式先物率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
第5期(2018年10月22日)	円	%		%	%	百万円
	14,302	0.1	16,786.56	0.1	98.0	83,790
第6期(2019年10月21日)	14,224	△0.5	16,697.91	△0.5	98.0	63,921
第7期(2020年10月20日)	14,639	2.9	17,186.91	2.9	98.4	47,872
第8期(2021年10月20日)	18,662	27.5	21,909.17	27.5	98.3	36,450
第9期(2022年10月20日)	17,828	△4.5	20,936.60	△4.4	97.7	12,762

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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		株式先物率 株式先物率 株式先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(当期首) 2021年10月20日	円	%		%	%
	18,662	－	21,909.17	－	98.3
10月末	18,422	△1.3	21,629.06	△1.3	98.2
11月末	17,781	△4.7	20,881.36	△4.7	98.2
12月末	18,415	△1.3	21,618.03	△1.3	99.0
2022年 1月末	17,490	△6.3	20,533.68	△6.3	98.9
2月末	17,379	△6.9	20,404.36	△6.9	98.7
3月末	18,175	△2.6	21,340.09	△2.6	97.2
4月末	17,727	△5.0	20,812.33	△5.0	96.9
5月末	17,869	△4.2	20,980.72	△4.2	97.7
6月末	17,443	△6.5	20,480.70	△6.5	98.2
7月末	18,118	△2.9	21,275.60	△2.9	98.4
8月末	18,348	△1.7	21,545.34	△1.7	98.6
9月末	17,289	△7.4	20,301.49	△7.3	97.3
(当期末) 2022年10月20日	17,828	△4.5	20,936.60	△4.4	97.7

(注1)騰落率は期首比です。

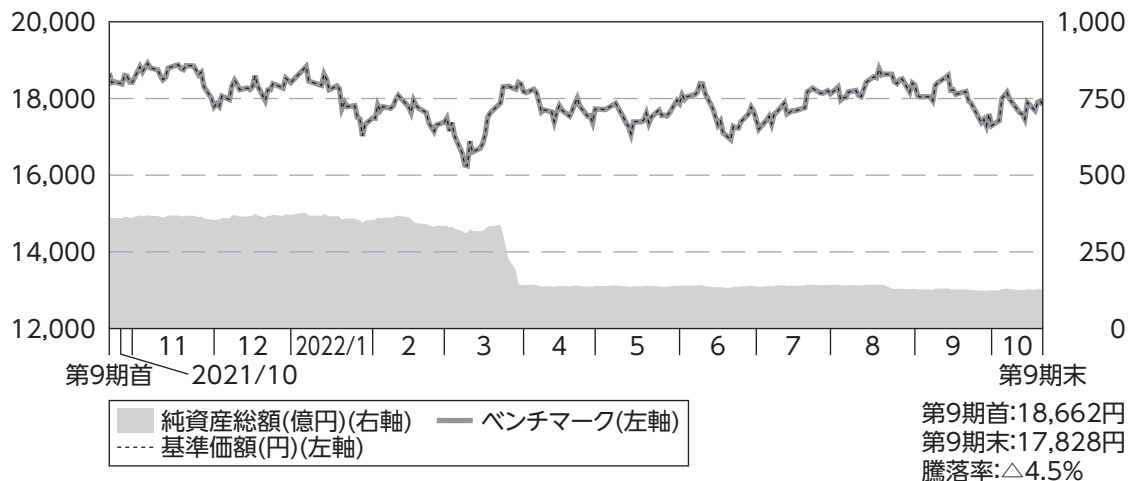
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JPX日経インデックス400(配当込み)です。

JPX日経インデックス400は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。起算日は2013年8月30日・基準値は10000ポイントです。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)及び株式会社日本経済新聞社(以下、「日経」)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、JPX及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。JPX及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

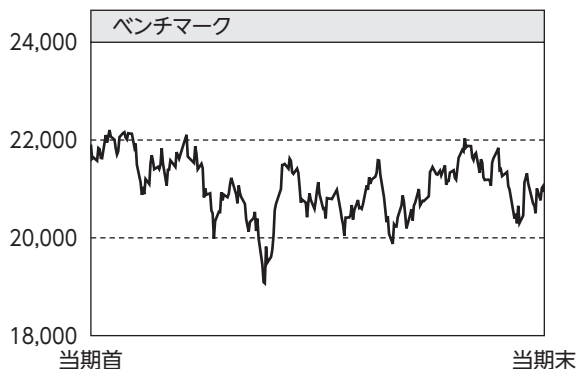


(注)ベンチマークは、2021年10月20日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPX日経インデックス400(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で下落しました。

投資環境



当期の国内株式市場は下落しました。

新型コロナウイルス・オミクロン株の感染拡大、米国の金融引き締め早期進行懸念、ウクライナを巡る地政学リスクなどが重荷となり、2022年3月にかけて国内株式市場は下落基調が続きました。その後は、ウクライナとロシアの停戦協定への進展期待や、FOMC（米連邦公開市場委員会）で決定された利上げが想定内の範囲内であったことなどが好感され急反発しました。期末にかけては、円安・米ドル高の進行などが下支えになった一方で、欧米の金融引き締め加速が警戒されたことなどから、一進一退の展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPX日経インデックス400(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式については、JPX日経インデックス400の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

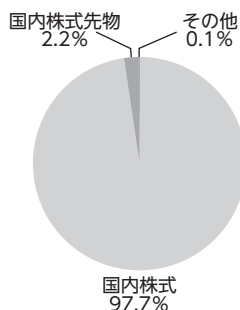
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	JPX日経インデックス400先物 2212	日本	2.2%
2	第一三共	日本	1.8%
3	ソフトバンクグループ	日本	1.6%
4	リクルートホールディングス	日本	1.6%
5	HOYA	日本	1.5%
6	日本電信電話	日本	1.5%

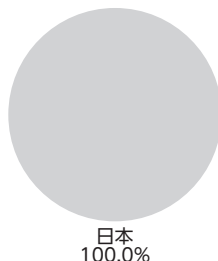
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	任天堂	日本	1.5%
8	キーエンス	日本	1.5%
9	三菱商事	日本	1.5%
10	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.5%
組入銘柄数		401	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

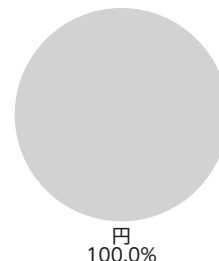
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

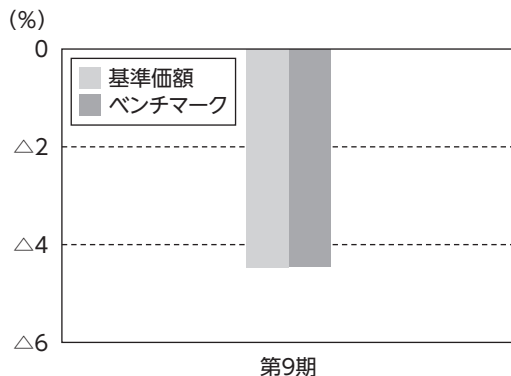


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.2%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概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年10月21日~2022年10月20日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (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) (商品) (先物・オプション)	1円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (1)	0.003% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.003)	(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
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(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、金銭信託預入に係る手数料等
合計	1	0.003	

(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(17,871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
国 内	上 場	千株 1,679 (108)	千円 4,886,983 (-)	千株 9,248	千円 26,716,732

(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。

<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
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 6,852	百万円 7,144	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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	31,603,715千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	22,313,888千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	1.41

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	$\frac{D}{C}$
コーポレートローン	百万円 98,939	百万円 5,835	% 5.9	百万円 99,096	百万円 5,817	% 5.9

(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	11百万円	102百万円	49百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.0%)			
日本水産	22.4	9	4,860
鉱業(0.4%)			
I N P E X	96.9	30.7	45,528
建設業(2.2%)			
ウエストホールディングス	—	0.8	3,604
ショーボンドホールディングス	—	1.1	7,040
ミライト・ワン	8.4	3.1	4,476
安藤・間	15.5	4.4	3,709
東急建設	7.1	—	—
コムシスホールディングス	8.6	3.1	7,626
東建コーポレーション	0.7	—	—
大成建設	17.4	6.2	24,986
大林組	55.8	20.8	20,051
清水建設	52.2	19.2	14,265
長谷工コーポレーション	18.3	6	9,342
鹿島建設	40.9	15.2	21,188
西松建設	4	1.4	5,285
三井住友建設	13.5	—	—
戸田建設	23.2	8.6	6,475
熊谷組	2.6	1.1	2,803
大東建託	6.1	—	—
N I P P O	4.6	—	—
五洋建設	23.7	8.2	5,994
住友林業	14.3	4.5	10,260
大和ハウス工業	51.5	17.7	52,790
積水ハウス	60.5	21.2	51,812
関電工	9.1	3.6	2,991
エクシオグループ	8.5	3.1	6,804
九電工	3.9	1.4	4,099
インフロンア・ホールディングス	21.5	7.8	7,956
食料品(3.9%)			
森永製菓	4.2	1.4	5,369
カルビー	8.1	3.3	10,032
森永乳業	3.3	1.2	5,046
ヤクルト本社	12.3	4.5	37,395
明治ホールディングス	11.8	3.9	24,375
プリマハム	2.5	0.9	1,836
日本ハム	6.8	2.5	9,062
アサヒグループホールディングス	42	13.5	57,739
キリンホールディングス	65.6	26.3	57,886
宝ホールディングス	—	4	4,224
サントリー食品インターナショナル	11.9	4.1	20,664
伊藤園	5.4	—	—
キッコーマン	12.8	4.3	35,260
味の素	42.4	14.3	58,501

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
キュービー	9.9	3.1	7,449
カゴメ	6.8	2.7	8,097
アリアケジャパン	1.6	—	—
ニチレイ	8.5	2.7	6,169
東洋水産	9.2	3.2	19,360
日清食品ホールディングス	7	2.3	22,195
日本たばこ産業	95.7	38.4	93,523
繊維製品(0.4%)			
帝人	16.4	6.1	8,436
東レ	126.1	43.3	31,284
ゴールドウイン	2.9	1.2	9,312
パルプ・紙(0.2%)			
王子ホールディングス	78.4	26.9	14,364
大王製紙	8.4	3	3,480
レンゾー	18	5.4	4,541
化学(6.9%)			
クラレ	25.5	9.4	9,616
旭化成	115.4	43.2	41,035
昭和電工	15.1	—	—
住友化学	137.1	47.6	24,038
日産化学	9.5	3.1	20,770
東ソー	26.9	8.6	13,940
トクヤマ	5.2	2.1	3,681
デンカ	6.4	2.4	7,680
信越化学工業	27.7	11.1	165,778
エア・ウォーター	17.8	5.6	9,228
日本酸素ホールディングス	14.3	5.8	13,531
三菱瓦斯化学	17.4	5.4	10,184
三井化学	15	5.4	14,995
三菱ケミカルグループ	116.4	43.3	28,937
KHネオケム	—	1	2,721
ダイセル	23.4	9.4	7,924
積水化学工業	36.4	13.3	23,634
日本ゼオン	15.7	5.1	6,696
アイカ工業	4.9	1.6	5,096
UBE	8.8	3.3	6,402
日油	6.6	2	10,420
花王	39.3	14.7	83,878
日本ペイントホールディングス	65.4	26.2	25,387
関西ペイント	19.6	6	12,678
D I C	7.4	—	—
富士フイルムホールディングス	31.3	12.5	85,150
資生堂	33.1	12.4	64,430
ライオン	21.5	7.1	11,246
ファンケル	6.5	2.9	8,328
コーセー	3.3	1.2	18,612

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ポーラ・オルビスホールディングス	7.6	—	—	—	—	—
小林製薬	5	1.8	14,310	—	—	—
タカラバイオ	—	1.9	3,178	—	—	—
デクセリアルズ	—	1.9	6,156	—	—	—
日東電工	10.7	4.3	34,271	—	—	—
エフピコ	3.3	1.3	4,771	—	—	—
ニフコ	6.5	2.4	7,560	—	—	—
ユニ・チャーム	34.3	12.4	57,498	—	—	—
医薬品(7.4%)						
協和キリン	20.9	7.2	24,192	—	—	—
武田薬品工業	138.5	48.7	183,501	—	—	—
アステラス製薬	154.2	60.9	122,134	—	—	—
住友ファーマ	13.2	4.4	4,580	—	—	—
塩野義製薬	22.4	8.3	56,838	—	—	—
日本新薬	5	1.6	12,016	—	—	—
中外製薬	55.6	18.6	67,034	—	—	—
科研製薬	3	1	3,800	—	—	—
エーザイ	19.6	7.9	65,269	—	—	—
ロート製薬	8.5	3.4	15,793	—	—	—
小野薬品工業	40.8	13.7	47,196	—	—	—
参天製薬	30.9	12.4	12,152	—	—	—
JCRファーマ	5	2	3,996	—	—	—
東和薬品	2.6	1	2,175	—	—	—
第一三共	139.7	51.7	228,669	—	—	—
大塚ホールディングス	37	13.6	63,294	—	—	—
ペプチドリーム	9.3	2.9	4,660	—	—	—
サワイグループホールディングス	3.9	—	—	—	—	—
石油・石炭製品(0.7%)						
出光興産	19.7	7.3	23,944	—	—	—
ENEOSホールディングス	267.5	107.2	51,616	—	—	—
コスモエネルギーホールディングス	5.6	2.8	10,696	—	—	—
ゴム製品(0.9%)						
横浜ゴム	10.3	3.4	7,806	—	—	—
TOYO TIRE	9.4	3.4	5,630	—	—	—
ブリヂストン	51.2	19	96,577	—	—	—
住友ゴム工業	16	5.8	7,203	—	—	—
ガラス・土石製品(0.8%)						
AGC	16.3	6	27,240	—	—	—
太平洋セメント	10.1	4.1	8,257	—	—	—
東海カーボン	14.9	5	4,700	—	—	—
TOTO	12.7	4.3	19,930	—	—	—
日本碍子	19.6	7	12,936	—	—	—
日本特殊陶業	13.5	5	13,460	—	—	—
MARUWA	—	0.3	4,713	—	—	—
ニチアス	4.5	1.5	3,384	—	—	—
鉄鋼(0.7%)						
日本製鉄	—	29.4	62,254	—	—	—
JFEホールディングス	—	16.3	22,934	—	—	—
東京製鐵	—	2.1	2,765	—	—	—
非鉄金属(0.7%)						
三井金属鉱業	4.7	1.9	5,709	—	—	—

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
住友金属鉱山	22.5	7.7	31,947	—	—	—
DOWAホールディングス	—	1.6	7,888	—	—	—
住友電気工業	61.4	24.6	37,613	—	—	—
アサヒホールディングス	6.6	2.8	5,409	—	—	—
金属製品(0.3%)						
SUMCO	27.1	11.6	21,274	—	—	—
三和ホールディングス	16.6	6.6	8,250	—	—	—
リンナイ	3.4	1.2	12,048	—	—	—
機械(5.5%)						
日本製鋼所	5.3	—	—	—	—	—
三浦工業	7.6	2.8	8,428	—	—	—
アマダ	25.8	11.1	11,499	—	—	—
FUJ I	7	2.8	5,440	—	—	—
オーエスジー	8.1	—	—	—	—	—
DMG森精機	10.4	3.6	6,084	—	—	—
ディスコ	2.4	1	31,000	—	—	—
オプトラン	2.2	0.9	1,885	—	—	—
ナブテスコ	10	3.8	11,533	—	—	—
SMC	5.2	2.1	122,262	—	—	—
小松製作所	80.6	32.3	86,031	—	—	—
住友重機械工業	10.2	3.8	10,560	—	—	—
日立建機	8.3	2.9	7,687	—	—	—
ロートツェ	—	0.4	2,776	—	—	—
クボタ	86.7	31.9	63,800	—	—	—
荏原製作所	7.4	2.4	11,424	—	—	—
ダイキン工業	22.7	7.8	173,511	—	—	—
ダイフク	9.8	3.4	23,154	—	—	—
竹内製作所	3	1.1	3,141	—	—	—
ホンザキ	5.2	3.9	16,419	—	—	—
日本精工	36.5	—	—	—	—	—
マキタ	23.2	8.1	22,671	—	—	—
三菱重工業	27.9	10.5	51,366	—	—	—
I H I	12	4.5	14,355	—	—	—
電気機器(16.2%)						
イビデン	—	3.4	13,838	—	—	—
ブラザー工業	21.7	8.1	20,962	—	—	—
ミネベアミツミ	30.7	11.3	23,583	—	—	—
日立製作所	81	28.9	185,306	—	—	—
三菱電機	177.8	66.5	92,368	—	—	—
富士電機	10.7	4	20,960	—	—	—
安川電機	19.1	7.1	28,861	—	—	—
日本電産	40	15.8	122,244	—	—	—
オムロン	14.8	5.9	40,320	—	—	—
MC J	5.6	2.5	2,305	—	—	—
日本電気	22.6	8.5	41,140	—	—	—
富士通	16	6.4	103,648	—	—	—
ルネサスエレクトロニクス	96.2	39	46,917	—	—	—
セイコーエプソン	22.1	8	16,248	—	—	—
ワコム	12.9	5.5	3,454	—	—	—
アルバック	3.3	1.4	7,672	—	—	—
エレコム	4.1	1.6	2,144	—	—	—

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
パナソニック ホールディングス	189.6	76	79,306	
シャープ	—	6.8	5,875	
アンリツ	10.7	4.5	7,267	
ソニーグループ	47.6	16.8	163,380	
T D K	25.8	10.3	47,122	
横河電機	17.8	6.5	15,392	
アズビル	12	4.1	16,277	
日本光電工業	7.3	2.7	9,193	
堀場製作所	3.3	1.3	7,514	
アドバンテスト	13.2	5.3	37,100	
キーエンス	9.2	4	192,200	
シスメックス	13.9	5.1	40,193	
フェローテックホールディングス	—	1.7	3,933	
レーザーテック	7.8	2.9	53,882	
スタンレー電気	12.4	—	—	
カシオ計算機	14.3	4.4	5,786	
ファナック	15.6	6.3	128,110	
浜松ホトニクス	12.8	4.8	31,152	
新光電気工業	—	2.1	6,804	
京セラ	27.1	10	73,250	
太陽誘電	7.9	3.2	12,128	
村田製作所	52.2	19.4	135,237	
小糸製作所	10.7	7.1	14,718	
SCREENホールディングス	3.1	1.1	8,525	
東京エレクトロン	10.4	4.2	154,140	
輸送用機器 (9.9%)				
トヨタ紡織	5.2	2.5	4,660	
豊田自動織機	14.4	5.1	37,332	
デンソー	39.2	14	99,666	
いすゞ自動車	47.2	20.6	34,360	
トヨタ自動車	265.3	88.5	177,354	
日野自動車	22.2	—	—	
アイシン	13	5.2	20,046	
本田技研工業	140	52.1	170,002	
スズキ	35.2	14.1	65,945	
S U B A R U	51	18.7	43,197	
ヤマハ発動機	23.2	9.3	27,723	
豊田合成	5.7	2	4,556	
シマノ	7.2	2.4	51,732	
テイ・エス テック	8.3	3	4,578	
精密機器 (3.6%)				
テルモ	54.5	20.2	88,657	
島津製作所	22.9	8.5	32,130	
ブイ・テクノロジ	0.8	—	—	
東京精密	3	1.1	4,664	
オリンパス	93.3	34.1	103,118	
H O Y A	34.7	13.6	195,772	
朝日インテック	19.5	7.8	19,523	
その他製品 (2.3%)				
パンダイナムコホールディングス	14.7	5.9	57,501	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
パイロットコーポレーション	3	0.9	5,238	
ヤマハ	10.6	4.1	22,837	
ビジョン	10.7	3.8	7,774	
任天堂	8	31.7	193,243	
電気・ガス業 (1.1%)				
中部電力	54.4	20.1	24,783	
関西電力	67.4	24.9	28,361	
中国電力	25.6	—	—	
東北電力	41.6	—	—	
九州電力	39.3	13.6	9,900	
北海道電力	16.6	6.2	2,697	
電源開発	14.1	5.3	11,151	
イーレックス	2.6	0.9	2,320	
レノバ	3	1.4	4,907	
東京瓦斯	34.1	12.5	32,337	
大阪瓦斯	32.2	12	26,436	
陸運業 (1.4%)				
S B Sホールディングス	—	0.5	1,446	
東海旅客鉄道	14.8	5	88,525	
阪急阪神ホールディングス	22.5	—	—	
日本通運	5.8	—	—	
ヤマトホールディングス	23.6	9.2	20,166	
山九	4.3	1.6	6,856	
センコーグループホールディングス	9.3	3.1	3,078	
日立物流	3.5	1.3	11,219	
AZ-COM丸和ホールディングス	3.6	1.1	1,628	
九州旅客鉄道	13	—	—	
S Gホールディングス	31.8	11.3	22,656	
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	2.2	16,368	
海運業 (0.7%)				
日本郵船	14.1	16.9	45,376	
商船三井	10	10.4	30,045	
川崎汽船	—	6.2	14,148	
倉庫・運輸関連業 (0.0%)				
三井倉庫ホールディングス	—	0.7	2,282	
近鉄エクスプレス	3.2	—	—	
情報・通信業 (10.0%)				
N E C ネットエスアイ	5.8	2.3	3,737	
システナ	6.2	10	4,170	
日鉄ソリューションズ	2.5	1.2	4,308	
T I S	17.4	6.1	24,064	
コーエーテクモホールディングス	4.6	4.5	9,868	
ネクソン	39.3	15.3	38,754	
ティーガイア	1.9	0.6	999	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4.7	1.8	3,834	
GMOペイメントゲートウェイ	3.4	1.4	13,972	
インターネットイニシアティブ	—	3.7	8,436	
ラクス	7	3.2	4,787	
アカツキ	0.7	—	—	
チェンジ	—	1.5	2,865	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
野村総合研究所	30.3	12.2	43,066	
インフォコム	1.6	0.8	1,624	
オービック	5.5	2.2	45,958	
ジャストシステム	2.5	1	3,020	
Zホールディングス	239.7	100.9	38,745	
トレンドマイクロ	9.3	3.4	25,738	
日本オラクル	3.5	1.1	8,921	
伊藤忠テクノソリューションズ	7.9	3.2	11,456	
大塚商会	9.4	3.4	15,929	
電通国際情報サービス	2.5	0.7	3,213	
東映アニメーション	0.7	0.3	4,065	
デジタルガレージ	2.9	1.2	4,074	
ネットワンシステムズ	—	2.6	7,852	
B I P R O G Y	6.1	2.2	7,062	
USEN-NEXT HOLDINGS	1.7	0.5	1,127	
日本電信電話	178	47.7	195,236	
KDD I	139.9	43.3	185,886	
ソフトバンク	—	105.9	153,872	
光通信	2.1	0.8	14,416	
GMOインターネットグループ	—	2.2	5,704	
東宝	10.3	4.1	21,197	
エヌ・ティ・ティ・データ	46.5	18.6	38,669	
D T S	—	1.3	4,498	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7.4	3.3	21,945	
カブコン	15	6.5	24,342	
S C S K	12.1	4.8	10,531	
NSD	—	2.2	5,438	
コナミグループ	6.3	2.5	15,825	
ソフトバンクグループ	66.3	35.5	205,190	
卸売業(6.5%)				
双日	19.3	7.2	15,825	
アルフレッサ ホールディングス	18.2	7.3	12,191	
神戸物産	13.6	4.8	15,336	
ダイワボウホールディングス	8	3	5,526	
TOKAIホールディングス	8.5	3.4	3,039	
シブハルスケアホールディングス	6.2	2	5,766	
コマダホールディングス	3.8	—	—	
メディカルホールディングス	17.5	6.5	11,953	
日本ライフライン	5.7	—	—	
伊藤忠商事	122.5	42.1	162,716	
丸紅	172.7	60.8	79,708	
豊田通商	17.6	6.3	29,232	
兼松	7	2.4	3,564	
三井物産	136	49.3	158,351	
住友商事	110.5	41.5	78,497	
三菱商事	106.6	46	187,496	
阪和興業	—	1.2	4,296	
岩谷産業	4.2	1.6	8,608	
P A L T A C	2.8	1	4,080	
日鉄物産	1.2	0.4	2,060	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ミスミグループ本社	22	8.8	27,720	
小売業(4.2%)				
ローソン	4.4	1.6	7,544	
エービーシー・マート	2.7	1.1	7,359	
日本マクドナルドホールディングス	8.1	3.5	17,640	
セリア	4.2	1.7	4,195	
ビックカメラ	10.4	—	—	
M o n o t a R O	22.1	8.9	19,936	
マツキヨココカラ&カンパニー	7.2	4.1	23,862	
Z O Z O	10.3	4.8	14,496	
ウエルシアホールディングス	9.3	3.7	11,840	
クワイエットSDホールディングス	2.6	1	3,220	
ネクステージ	—	1.4	3,725	
コスモス薬品	1.8	0.7	10,332	
セブン&アイ・ホールディングス	68.5	23.5	133,785	
ツルハホールディングス	3.8	1.5	13,170	
クスリのアオキホールディングス	1.7	0.6	4,278	
FOOD & LIFE COMPANIES	10.3	3.6	8,780	
ノジマ	3.1	2.3	2,858	
良品計画	20.2	8.1	11,016	
コーナン商事	2.5	1	3,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	35	14	36,330	
ゼンショーホールディングス	9.4	3.4	12,699	
ワークマン	2.3	0.7	3,178	
スギホールディングス	3.5	1.4	8,638	
日本瓦斯	—	3.4	7,265	
ライフコーポレーション	1.6	0.6	1,369	
丸井グループ	14.8	5.1	12,714	
イズミ	3.6	1.1	3,338	
ヤオコー	2	0.8	5,104	
ケーズホールディングス	14.9	6	7,092	
アインホールディングス	2.5	—	—	
ニトリホールディングス	6.9	2.8	34,076	
ファーストリテイリング	2.3	0.9	75,807	
サンドラッグ	6.6	2.6	9,360	
銀行業(5.4%)				
めぶきフィナンシャルグループ	91.1	28.9	8,467	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	106.8	34.8	16,216	
新生銀行	14.3	4.6	10,676	
あおぞら銀行	10.4	3.9	9,984	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	858.5	254.8	176,576	
りそなホールディングス	195.3	74.4	42,727	
三井住友トラスト・ホールディングス	33.2	11.6	49,868	
三井住友フィナンシャルグループ	121.4	45.6	187,188	
千葉銀行	58.5	19.9	16,477	
ふくおかフィナンシャルグループ	15.8	5.1	13,392	
セブン銀行	58.6	20.9	5,684	
みずほフィナンシャルグループ	238.3	84.3	136,692	
証券、商品先物取引業(0.7%)				
F P G	5.9	—	—	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
GMOフィナンシャルホールディングス	3.3	1.3	923
SBIホールディングス	21.6	—	—
ジャフコグループ	2.2	2.4	5,452
大和証券グループ本社	131.3	45.1	25,977
野村ホールディングス	267.8	107.3	51,654
マネックスグループ	—	5.9	2,849
保険業(3.0%)			
SOMPOホールディングス	30.9	10	60,840
MS&ADインシュアランス グループホールディングス	42.6	14.5	56,869
第一生命ホールディングス	86.3	34.2	79,275
東京海上ホールディングス	57.8	58.7	155,613
T&Dホールディングス	52.4	15.6	21,434
その他金融業(1.4%)			
全国保証	4.6	1.7	8,211
芙蓉総合リース	1.8	0.6	5,022
みずほリース	2.7	0.9	2,884
東京センチュリー	4.1	1.1	5,412
イオンフィナンシャルサービス	10.7	3.8	5,472
アコム	34.6	13.9	4,461
オリエントコーポレーション	47.4	1.8	2,088
オリックス	106.5	41.8	88,009
三菱HCキャピタル	60.7	22.7	14,459
日本取引所グループ	47.4	16.4	32,176
不動産業(2.6%)			
大東建託	—	2.3	33,120
いちご	19.5	—	—
ヒューリック	41.9	13.6	14,606
野村不動産ホールディングス	10.1	3.6	12,330
サムティ	2.5	—	—
プレサンスコーポレーション	2.9	0.8	1,198
オープンハウスグループ	5.6	2.1	10,773
東急不動産ホールディングス	47.7	19.1	14,955
飯田グループホールディングス	14.6	5.7	11,981
ケイアイスター不動産	—	0.3	1,369
三井不動産	79.9	27.4	78,816
三菱地所	115.2	40	77,120
東京建物	17.3	5.6	11,653
住友不動産	39.4	12.6	43,759
スターツコーポレーション	2.1	1	2,616
日本エスコ	3.3	1.3	1,082
イオンモール	8.8	3.5	5,754
カチタス	4.3	1.7	5,270
サービス業(4.0%)			
MI XI	4.3	—	—
日本M&Aセンターホールディングス	27.9	—	—
UTグループ	2.5	1	2,184
エス・エム・エス	5.8	2.3	7,210
パーソルホールディングス	17	6.8	19,869
総合警備保障	6.8	2.5	9,450

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)		
カカココム	12.6	5	12,680	
ディップ	2.7	1.2	4,722	
ベネフィット・ワン	6.2	2.5	5,337	
エムスリー	30	12	50,556	
アウトソーシング	9.7	—	—	
博報堂DYホールディングス	23.6	8.6	10,698	
パリュエコマース	—	0.5	1,128	
H. U. グループホールディングス	—	1.8	4,942	
オリエンタルランド	18.1	—	—	
ピー・エム・エル	—	0.9	3,060	
ユー・エス・エス	19	7.6	16,834	
サイバーエージェント	—	14.6	18,133	
フルキャストホールディングス	1.4	0.6	1,709	
エン・ジャパン	3	1.2	2,980	
テクノプロ・ホールディングス	10.2	4.1	13,714	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.7	—	—	
ジャパンマテリアル	5.2	2.1	3,853	
リクルートホールディングス	94.2	46.5	204,460	
ベルシステム24ホールディングス	2.8	1	1,409	
ベイカレント・コンサルティング	1.1	0.5	18,375	
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	4.9	2.2	3,830	
リログループ	9.3	3.7	7,940	
カナモト	3	—	—	
トランス・コスモス	—	0.9	3,145	
セコム	16.7	6.7	57,586	
メイテック	2.1	2.4	5,820	
イオンディライト	2.1	0.8	2,340	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数<比率>	12,023 400	4,563 400	12,462,409 <97.7%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >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 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 J P X 日経400	281	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	12,462,409	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	311,345	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	12,773,754	100.0

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 2022年10月20日現在
(A)資 産	12,772,557,269円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	156,407,528
株 式(評価額)	12,462,409,610
未 収 入 金	3,378,160
未 収 配 当 金	141,981,011
差 入 委 託 証 拠 金	8,380,960
(B)負 債	10,482,609
未 払 解 約 金	10,482,306
未 払 利 息	303
(C)純 資 産 総 額(A-B)	12,762,074,660
元 本	7,158,313,455
次 期 繰 越 損 益 金	5,603,761,205
(D)受 益 権 総 口 数	7,158,313,455口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,828円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年10月21日 至 2022年10月20日
(A)配 当 等 収 益	408,896,104円
受 取 配 当 金	409,025,247
受 取 利 息	1,691
そ の 他 収 益 金	1,372
支 払 利 息	△132,206
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,554,786,400
売 買 益	2,173,065,442
売 買 損	△3,727,851,842
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△4,286,517
取 引 益	113,467,881
取 引 損	△117,754,398
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,150,176,813
(E)前 期 繰 越 損 益 金	16,919,052,686
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,488,089,565
(G)解 約 差 損 益 金	△12,653,204,233
(H) 計 (D+E+F+G)	5,603,761,205
次 期 繰 越 損 益 金(H)	5,603,761,205

(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) (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3) (G)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19,531,476,594円、期中追加設定元本額は3,169,883,202円、期中一部解約元本額は15,543,046,341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。

SMT JPX日経インデックス400・オープン	5,437,345,365円
JPX日経400オープン(適格機関投資家専用)	921,867,894円
SMTAM JPX日経インデックス400オープン	799,100,196円

お知らせ

該当事項はありません。