

GSビッグデータ・  
ストラテジー（外国株式）

第12期末(2023年12月25日)		第12期	
基準価額	18,087円	騰落率	6.8%
純資産総額	1,629百万円	分配金合計	0円

(注)騰落率は収益分配金(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す。

## ■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／海外／株式
信託期間	原則として無期限
運用方針	主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)をベンチマークとして信託財産の長期的な成長をめざします。計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時に、ポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行います。
主要投資対象	
本ファンド	コクサイ計量株式マザーファンドの受益証券
コクサイ計量株式マザーファンド	日本を除く世界各国の株式
運用方法・組入制限	①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入比率は高位に保ちます。 ②実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。 ③本ファンドおよびマザーファンドにおける組入制限は下記のとおりです。 ・株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	原則として毎計算期末(毎年6月25日および12月25日。休業日の場合は翌営業日。)に収益の分配を行います。投信会社が経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の中から基準価額水準、市場動向等を勘案して分配金を決定します。

## 追加型投信／海外／株式

第12期(決算日2023年12月25日)

作成対象期間:2023年6月27日～2023年12月25日

## 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「GSビッグデータ・ストラテジー(外国株式)」は、このたび、第12期の決算を行いました。本ファンドは、ビッグデータやAI(人工知能)を活用した独自開発の計量モデルを用いて、多様な銘柄評価基準に基づき日本を除く先進国の株式の幅広い銘柄に分散投資することにより、長期的にベンチマークを上回る投資成果を獲得することをめざして運用を行っております。今期の運用経過等について、以下のとおりご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒106-6147 東京都港区六本木6-10-1 六本木ヒルズ森タワー  
お問合せ先: 03-6437-6000(代表)  
受付時間: 営業日の午前9時～午後5時 | [www.gsam.co.jp](http://www.gsam.co.jp)

## ■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分 配 落)	税 引 前 分 配 金	期 騰 落 中 率	ベンチマーク	期 騰 落 中 率	株 式 組 入 比 率	純 資 産 総 額
8期（2021年12月27日）	15,213	0	9.2	17,367	11.1	99.7	1,725
9期（2022年6月27日）	14,341	0	△ 5.7	16,924	△ 2.6	99.5	1,518
10期（2022年12月26日）	14,129	0	△ 1.5	16,665	△ 1.5	99.7	1,412
11期（2023年6月26日）	16,931	0	19.8	20,389	22.3	99.4	1,598
12期（2023年12月25日）	18,087	0	6.8	22,204	8.9	99.3	1,629

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ベンチマーク（MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース））は、2017年12月19日を10,000として指数化しております。

(注3) 株式組入比率には投資信託証券を含みます。

(注4) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率は、実質比率を記載しております。

## ■当期中の基準価額と市況推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	株 式 組 入 比 率
(期 首) 2023年6月26日	16,931	—	20,389	—	99.4
6月末	17,299	2.2	20,834	2.2	98.8
7月末	17,467	3.2	21,155	3.8	99.1
8月末	17,695	4.5	21,523	5.6	99.2
9月末	17,379	2.6	21,005	3.0	99.0
10月末	16,805	△0.7	20,305	△0.4	99.4
11月末	17,966	6.1	21,897	7.4	99.6
(期 末) 2023年12月25日	18,087	6.8	22,204	8.9	99.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

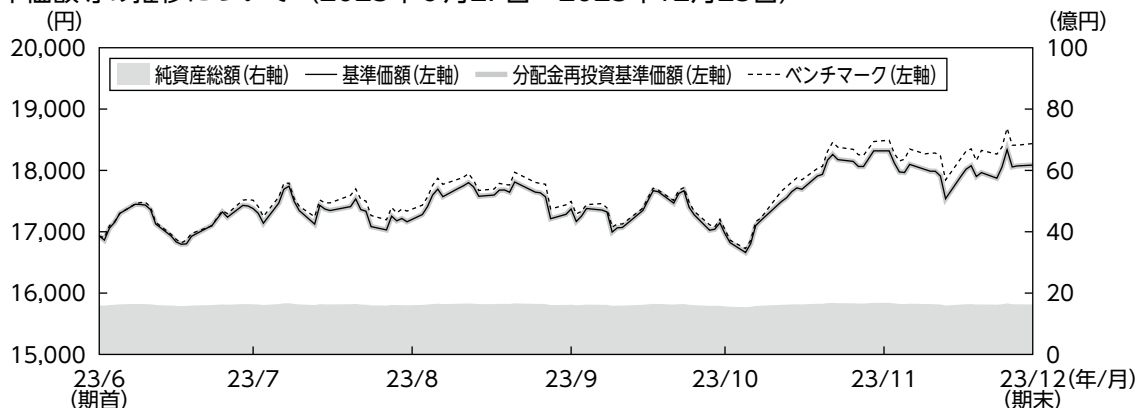
(注2) ベンチマーク（MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース））は、2017年12月19日を10,000として指数化しております。

(注3) 株式組入比率には投資信託証券を含みます。

(注4) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率は、実質比率を記載しております。

## ■運用経過

### ◆基準価額等の推移について（2023年6月27日～2023年12月25日）



第12期首：16,931円

第12期末：18,087円

(当期中にお支払いした分配金：0円)

騰落率：+6.8%（分配金再投資ベース）

(注1) ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）です。MSCIおよびMSCIの情報の編集、計算、および作成に関与するその他すべての者（以下総称して「MSCI当事者」といいます）は、MSCIの情報について一切の保証（独創性、正確性、完全性、商品性および特定目的への適合性を含みますが、これらに限定されません）を明示的に排除します。MSCI、その関連会社およびMSCI当事者は、いかなる場合においても、直接損害、間接損害、特別損害、付随的損害、懲罰損害、派生的損害（逸失利益を含みます）およびその他一切の損害についても責任を負いません。MSCIの書面による明示的な同意がない限り、MSCIの情報を配布または流布してはならないものとします。

(注2) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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3) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

(注4) 分配金再投資基準価額、ベンチマークは、期首の基準価額を起点として指数化しています。

(注5) 騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

### ◆基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の16,931円から1,156円上昇し、期末には18,087円となりました。

#### 上昇要因

各国株式市場の上昇や、スイス、ノルウェーにおける銘柄選択効果がプラス寄与となったことなどが基準価額の上昇要因となりました。

#### 下落要因

カナダ、ドイツ、オーストラリアにおける銘柄選択効果がマイナス寄与となったことなどが基準価額の下落要因となりました。

## ◆投資環境について

## ＜外国株式市場＞

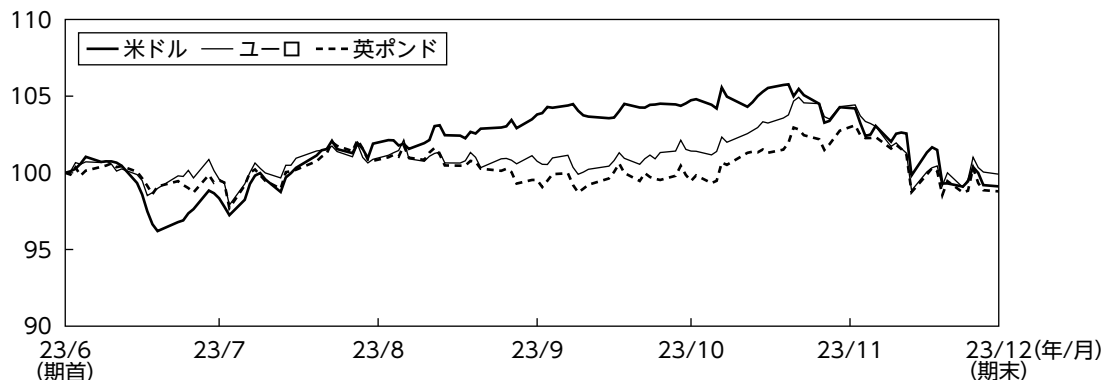
当期の外国株式市場（現地通貨ベース）は上昇しました。

2023年7月中旬には、米CPI（消費者物価指数）の伸び率が鈍化したことにより、利上げの停止が近づいているとの見方が強まったことで投資家心理が改善し外国株式市場は上昇しましたが、8月になると格付け機関のフィッチによる米国債の格下げ、中国不動産大手の信用不安などが意識され、外国株式市場は下落しました。さらに、9月には、米連邦議会において政府機関閉鎖の危険性が高まったことや、10月にはハマスとイスラエルの武力衝突やそれに付随する原油価格の上昇、インフレ継続への警戒感、米金利上昇などが嫌気され、外国株式市場は下落しました。11月になると、米経済指標が市場予想を下回ったことでFRB（米連邦準備制度理事会）の追加利上げ観測が後退し、上昇を続けていた米金利が低下傾向に転じ、外国株式市場は再上昇しました。米CPIが市場予想を下回り、インフレの鈍化基調が現れたこともあり、2024年にはFRBが利下げに転じることへの期待感から外国株式市場は期末まで上昇を続けました。

## ＜外国為替市場＞

外国為替市場では、米ドル、ユーロ、英ポンドは円に対して下落しました。

## ○為替レート（対円）の推移



(注) 各通貨は期首を100として指数化しています。

出所：一般社団法人投資信託協会

## ◆ポートフォリオについて

## ＜本ファンド＞

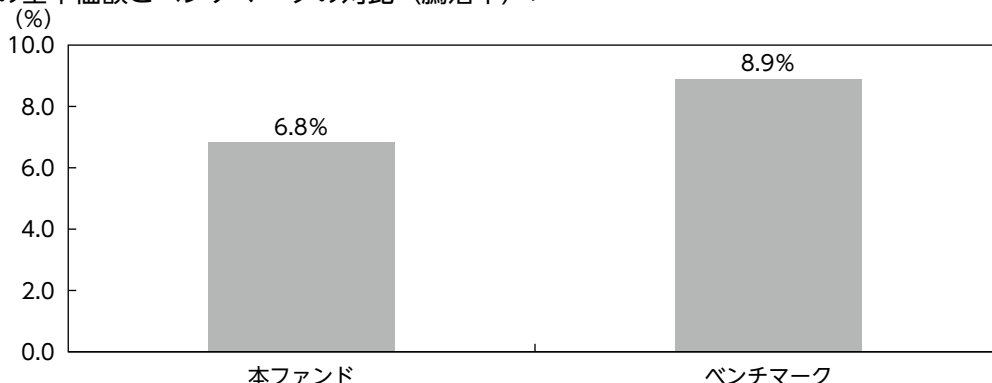
コクサイ計量株式マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行いました。

## ＜本マザーファンド＞

本マザーファンドでは、日本を除く先進国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）を長期的に上回る投資成果を獲得することをめざしました。

## ◆ベンチマークとの差異について

## ＜当期の基準価額とベンチマークの対比（騰落率）＞



(注1) 基準価額の騰落率は収益分配金（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す。

(注2) ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）です。

当期の本ファンドのパフォーマンス（分配金再投資ベース）は、+6.8%となり、ベンチマーク（+8.9%）を下回りました。

当期はスイス、ノルウェーにおける銘柄選択効果がプラス寄与となった一方、カナダ、ドイツ、オーストラリアにおける銘柄選択効果はマイナス寄与となりました。

## ◆分配金について

収益分配金（1万口当たり、税引前）については、分配方針および基準価額の水準などを勘案し、当期の分配は行わないこととしました。収益分配金に充てなかった収益については、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

## 今後の運用方針について

## ＜本ファンド＞

今後も引き続き本マザーファンドを通じて、日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

## ＜本マザーファンド＞

本マザーファンドでは、日本を除く先進国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）を長期的に上回る投資成果を獲得することをめざします。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2023年6月27日～2023年12月25日 金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	117円 ( 57)	0.673% (0.328)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ファンドの運用、受託会社への指図、基準価額の算出、目論見書・運用報告書等の作成等の対価
(販売会社)	( 57)	(0.328)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、分配金・換金代金・償還金の支払い業務等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.016)	ファンドの財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料 (株式)	5 ( 4)	0.026 (0.021)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	( 1)	(0.005)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
有価証券取引税	3 ( 3)	0.017 (0.017)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
その他費用 (保管費用)	12 ( 6)	0.069 (0.037)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	( 1)	(0.007)	海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用
(その他)	( 4)	(0.025)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用
合計	137	0.785	

期中の平均基準価額は17,435円です。

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、本ファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、本ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

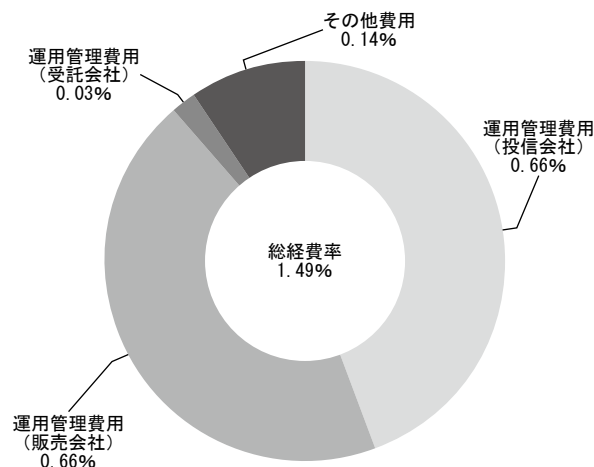
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 株式には投資信託証券を含みます。

## (参考情報)

## ■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.49%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■売買及び取引の状況（2023年6月27日から2023年12月25日まで）

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
コクサイ計量株式マザーファンド	千口 21,994	千円 45,344	千口 63,887	千円 132,184

## ■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

項 目	当 期
	コクサイ計量株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	16,498,103千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,983,553千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.36

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 株式には投資信託証券を含みます。

(注3) マザーファンドの金額および割合は、当該子ファンドの計算期間で算出。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年6月27日から2023年12月25日まで）

利害関係人との取引はありません。

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

## ■組入資産の明細（2023年12月25日現在）

## 親投資信託残高

種 類	前 期 末	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
コクサイ計量株式マザーファンド	千口 810,038	千口 768,145	千円 1,640,835

## ■投資信託財産の構成

2023年12月25日現在

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
コクサイ計量株式マザーファンド	千円 1,640,835 % 99.4
コール・ローン等、その他	10,630 0.6
投資信託財産総額	1,651,465 100.0

(注1) コクサイ計量株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（3,330,569千円）の投資信託財産総額（3,355,050千円）に対する比率は99.3%です。

(注2) 外貨建資産は、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。なお決算日における邦貨換算レートは1米ドル=142.22円、1カナダドル=107.05円、1ユーロ=156.34円、1英ポンド=180.48円、1スイスフラン=165.80円、1スウェーデンクローナ=14.16円、1ノルウェークローネ=13.95円、1デンマーククローネ=20.97円、1オーストラリアドル=96.67円、1ニュージーランドドル=89.44円、1香港ドル=18.20円、1シンガポールドル=106.95円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2023年12月25日
(A) 資 産	1,651,465,380円
コクサイ計量株式 マザーファンド(評価額)	1,640,835,089
未 収 入 金	10,630,291
(B) 負 債	22,136,962
未 払 解 約 金	10,630,291
未 払 信 託 報 酬	10,941,038
そ の 他 未 払 費 用	565,633
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	1,629,328,418
元 本	900,849,694
次 期 繰 越 損 益 金	728,478,724
(D) 受 益 権 総 口 数	900,849,694口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,087円

## ■損益の状況

項 目	当 期
	自 2023年6月27日 至 2023年12月25日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	114,169,753円
売 買 益	119,993,482
売 買 損	△ 5,823,729
(B) 信 託 報 酬 等	△ 11,506,671
(C) 当 期 損 益 金(A + B)	102,663,082
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	544,446,120
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	81,369,522
(配 当 等 相 当 額)	( 84,451,918)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 3,082,396)
(F) 計 (C + D + E)	728,478,724
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F + G)	728,478,724
追 加 信 託 差 損 益 金	81,369,522
(配 当 等 相 当 額)	( 84,505,775)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 3,136,253)
分 配 準 備 積 立 金	647,109,202

(注1) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(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引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程において、マザーファンドの配当等収益を繰入れております。

(注5) 期首元本額は943,945,243円、当作成期間中において、追加設定元本額は25,884,671円、同解約元本額は68,980,220円です。

## ■分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項 目	第 12 期
	2023年6月27日～2023年12月25日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,121

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税引前)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## &lt;お知らせ&gt;

約款変更について

・デリバティブの利用目的を運用の実態に即したものに変更しました。



# コクサイ計量株式 マザーファンド

## 親投資信託

第6期(決算日2023年2月15日)

作成対象期間: 2022年2月16日～2023年2月15日

### ■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	親投資信託
信託期間	原則として無期限
運用方針	主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)をベンチマークとして信託財産の長期的な成長をめざします。計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時に、ポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行います。外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
主要投資対象	日本を除く世界各国の株式
組入制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。法令・諸規則に基づき、親投資信託(マザーファンド)の期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒106-6147 東京都港区六本木6-10-1 六本木ヒルズ森タワー  
お問合せ先: 03-6437-6000(代表)  
受付時間: 営業日の午前9時～午後5時 | [www.gsam.co.jp](http://www.gsam.co.jp)

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		ベンチマーク	期 騰 落 中 率		株 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	%			%		%	百万円
2期 (2019年2月15日)	10,677	1.9		10,819	3.8		98.4	52,075
3期 (2020年2月17日)	12,435	16.5		13,189	21.9		98.9	27,815
4期 (2021年2月15日)	13,893	11.7		14,892	12.9		99.1	30,021
5期 (2022年2月15日)	16,449	18.4		18,009	20.9		98.8	62,546
6期 (2023年2月15日)	17,876	8.7		19,827	10.1		98.6	44,664

(注1) 本ファンドの設定日は2017年9月8日ですが、ポートフォリオ構築のタイミング等を考慮し、ベンチマーク (MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)) の計算開始日を2017年9月13日としています。

(注2) 株式組入比率には投資信託証券を含みます。

■当期中の基準価額と市況推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		ベンチマーク	騰 落 率		株 組 入 比 率
(期 首) 2022年2月15日	円 16,449	%			%		%
2月末	16,347	△ 0.6		18,009	-		98.8
3月末	18,066	9.8		17,883	△ 0.7		98.9
4月末	17,354	5.5		19,780	9.8		98.7
5月末	17,202	4.6		19,316	7.3		98.8
6月末	17,202	4.6		18,901	5.0		98.6
7月末	16,601	0.9		18,459	2.5		98.6
8月末	17,251	4.9		18,459	2.5		98.6
9月末	17,489	6.3		19,160	6.4		98.8
10月末	17,489	6.3		19,302	7.2		98.7
11月末	16,715	1.6		18,340	1.8		98.7
12月末	18,434	12.1		18,340	1.8		98.7
2023年1月末	18,434	12.1		20,126	11.8		99.0
(期 末) 2023年2月15日	円 17,876	%			%		%
	17,876	8.7		19,550	8.6		98.7
	17,130	4.1		18,348	1.9		98.9
	17,130	4.1		19,056	5.8		98.9
	17,876	8.7		19,827	10.1		98.6

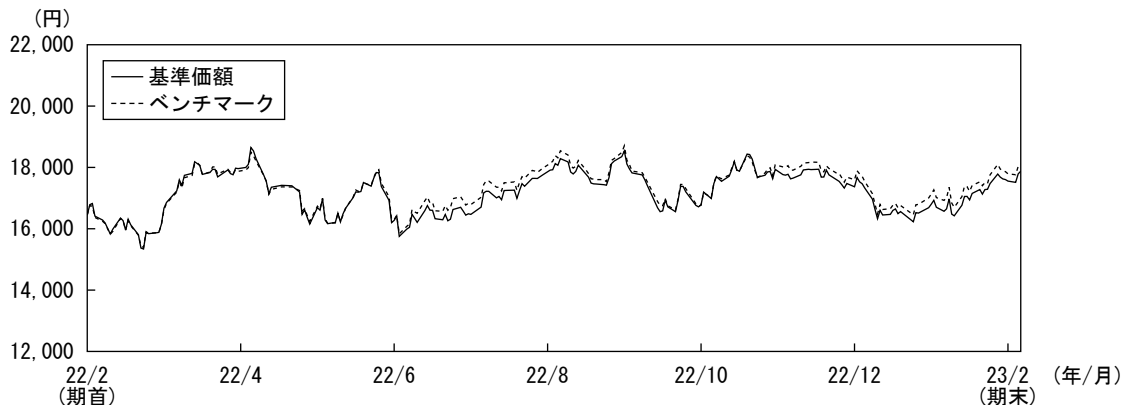
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 本ファンドの設定日は2017年9月8日ですが、ポートフォリオ構築のタイミング等を考慮し、ベンチマーク (MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)) の計算開始日を2017年9月13日としています。

(注3) 株式組入比率には投資信託証券を含みます。

■運用経過

◆基準価額等の推移について（2022年2月16日～2023年2月15日）



(注1) ベンチマークはMSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）です。

(注2) ベンチマークは、期首の基準価額を起点として指数化しています。

◆基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の16,449円から1,427円上昇し、期末には17,876円となりました。

上昇要因

外国為替市場において日本円が下落したこと、スウェーデンやスイスにおける銘柄選択効果がプラス寄与となったことが基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

英国やデンマークにおける銘柄選択効果およびドイツへのオーバーウェイトがマイナス寄与となったことなどが基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境について

＜外国株式市場＞

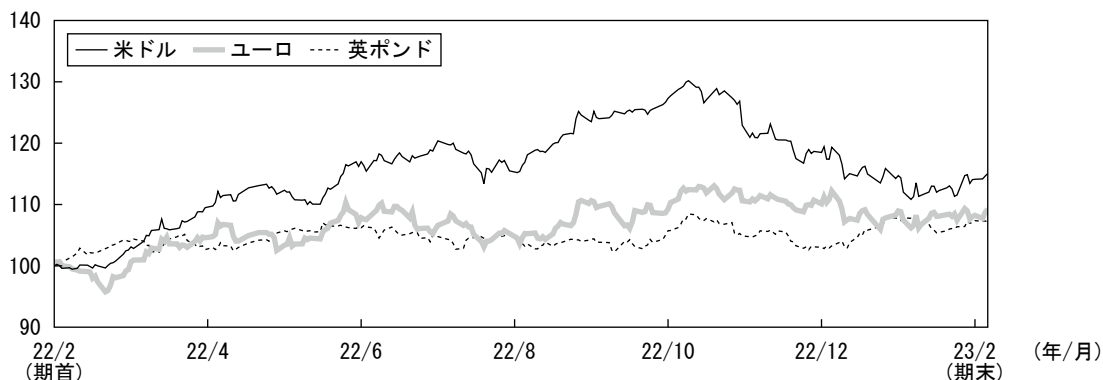
当期の外国株式市場は下落しました。

期初、ロシアのウクライナに対する軍事侵攻などを背景に外国株式市場は下落しました。また、ロシアに対する米欧の経済制裁により商品価格が高騰し、世界経済に打撃を与えとの懸念もマイナス材料となったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）メンバーによる金融引き締めに向きな発言を受け、米長期金利が上昇したことなどが嫌気され、外国株式市場は下落しました。中旬では、米国において企業業績の改善期待や、米長期金利が低下したことなどから、外国株式市場は上昇する場面もありましたが、ペロシ米下院議長の台湾訪問による地政学リスクが嫌気されたことなどを背景に外国株式市場は下落しました。下旬は、8月の米求人件数や9月のISM（全米供給管理協会）製造業景況感指数が市場予想を下回ったこと、英国の減税計画撤回、10月の米総合CPI（消費者物価指数）が市場予想以上に減速したことで、利上げ幅の縮小観測が高まり、外国株式市場は上昇する局面もありました。しかしながら、ISMの非製造業総合景況感指数が市場予想に反して上昇したことで、FRBが金融引き締めを継続するとの観測が広がり、外国株式市場は再び下落しました。その後、米雇用統計で米賃金インフレ鈍化の兆しが示されたことから金融引き締め長期化への懸念の後退、中国のゼロコロナ政策解除による景気回復への期待から外国株式市場は上昇しましたが、結果として前期末を下回る水準で期を終えました。

＜外国為替市場＞

外国為替市場では、米ドルや英ポンド、ユーロなどは円に対して上昇しました。

○為替レート（対円）の推移



(注) 各通貨は期首を100として指数化しています。

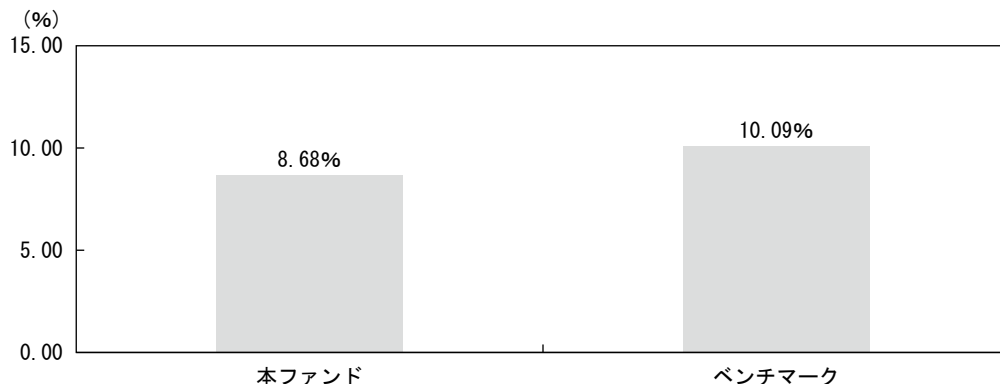
出所：一般社団法人投資信託協会

◆ポートフォリオについて

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、株式への投資割合は、概ね高位に保ちました。運用においては、計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時に、ポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行い、信託財産の長期的な成長をめざしました。

◆ベンチマークとの差異について

<当期の基準価額とベンチマークの対比（騰落率）>



当期の本ファンドのパフォーマンス（分配金再投資ベース）は+8.68%となり、ベンチマーク（+10.09%）を下回りました。

当期は、スウェーデンやスイスにおける銘柄選択効果がプラス寄与となった一方、英国やデンマークにおける銘柄選択効果およびドイツへのオーバーウェイトがマイナス寄与となりました。投資テーマでは「モメンタム」、「バリュー」の2つがマイナス寄与となり、「収益性」はほぼ中立の寄与となりました。

◆今後の運用方針について

引き続き運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2022年2月16日～2023年2月15日		
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	6円 (6) (0)	0.037% (0.035) (0.001)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
有価証券取引税 (株式)	10 (10)	0.060 (0.060)	有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (2) (2)	0.024 (0.009) (0.015)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 信託事務処理等に要するその他の諸費用
合計	20	0.121	

期中の平均基準価額は17,236円です。

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は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) 株式には投資信託証券を含みます。

■ 売買及び取引の状況（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

(1) 株式

		買		付		売		付	
		株	数	金	額	株	数	金	額
外	アメリカ		百株 74,716 (4,179)		千米ドル 578,984 (4,327)		百株 85,450 (874)		千米ドル 693,568 (4,336)
	カナダ		2,917		千カナダドル 23,005		4,224		千カナダドル 28,354
国	ユ	ドイツ	6,800		千ユーロ 32,887		11,581		千ユーロ 42,049
		イタリア	13,585		7,602		6,851		5,121
	フランス	5,664		39,156		3,319		36,194	
	オランダ	6,842		23,618		7,982		28,569	
	ロ	スペイン	9,326 (649)		10,295 (11)		6,987 (-)		6,212 (11)
		ベルギー	58		314		58		290
	オーストリア	539		695		150		210	
	ルクセンブルク	-		-		430		3,893	
	ポルトガル	140		158		140		154	
	その他	267		720		2,008		5,097	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	イ ギ リ ス	百株 8,283 ( 30)	千英ポンド 12,214 ( 40)	百株 10,133 ( 98)	千英ポンド 16,274 ( 315)
	ス イ ス	2,990	千スイスフラン 13,638	2,586 ( -)	千スイスフラン 18,108 ( 10)
	ス ウ ェ ー デ ン	26,887 ( 946)	千スウェーデンクローナ 371,980 ( 21,441)	26,176 ( 473)	千スウェーデンクローナ 284,632 ( 47,231)
	ノ ル ウ ェ ー	8,893 ( 659)	千ノルウェークローネ 73,219 ( 19,942)	13,127 ( 0.01)	千ノルウェークローネ 124,258 ( 1,131)
	デ ン マ ー ク	1,289	千デンマーククローネ 117,463	1,254	千デンマーククローネ 127,862
	オ ー ス ト ラ リ ア	24,888 ( 2,720)	千オーストラリアドル 41,761 ( 7,710)	42,430 ( 2,637)	千オーストラリアドル 61,019 ( 7,378)
	香 港	4,028	千香港ドル 43,595	9,022	千香港ドル 81,086
	シ ン ガ ポ ー ル	7,908	千シンガポールドル 3,195	11,315	千シンガポールドル 7,174

(注1) 金額は受渡し代金。

(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。

(注3) 株式には投資信託証券を含みます。

(2) 先物取引の銘柄別取引状況

		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	S&P 500 EMINI	百万円 1,825	百万円 1,919	百万円 16,881	百万円 16,935
		S&P/TSE 60	95	96	870	873
		SPI 200	255	258	439	441
		FTSE 100	382	397	1,224	1,227
		HANG SENG	213	214	243	243
		EURO STOXX 50	1,090	1,121	3,480	3,495

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 外国の取引金額は、各月中の取引額を当該月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	248,532,678千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	55,881,144千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	4.44

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 株式には投資信託証券を含みます。

■主要な売買銘柄（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

株 式

当				期				
買		付		売		付		
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価	
	千株	千円	円		千株	千円	円	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37	1,525,079	40,205	MICROSOFT CORP	55	2,003,706	36,267	
MARSH & MCLENNAN COS	64	1,448,072	22,389	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	39	1,643,487	41,290	
MICROSOFT CORP	36	1,243,385	33,870	ALPHABET INC-CL A	40	1,558,402	38,476	
AMAZON.COM INC	68	1,175,580	17,174	TEXAS INSTRUMENTS INC	64	1,515,058	23,339	
NOVO NORDISK A/S-B	64	989,320	15,288	AMAZON.COM INC	64	1,432,386	22,194	
UNITEDHEALTH GROUP INC	15	982,903	64,108	UNITEDHEALTH GROUP INC	19	1,339,560	67,966	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	30	980,428	32,122	INTUIT INC	23	1,296,500	54,271	
MERCK & CO. INC.	83	977,037	11,749	MARSH & MCLENNAN COS	60	1,275,028	21,009	
PEPSICO INC	46	971,567	20,869	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	19	1,145,659	58,851	
CISCO SYSTEMS INC	150	962,897	6,380	JOHNSON & JOHNSON	49	1,084,678	21,868	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 株式には投資信託証券を含みます。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

利害関係人との取引はありません。

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



■組入資産の明細（2023年2月15日現在）

(1) 外国株式

銘柄	前期末		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
ABBVIE INC	416	115	1,757	233,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	—	19	299	39,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	84	14	412	54,797	素材
APTIV PLC	—	17	216	28,800	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	—	25	436	58,018	資本財
PERRIGO CO PLC	1,105	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	—	45	296	39,422	資本財
ALLY FINANCIAL INC	569	—	—	—	各種金融
ALTRIA GROUP INC	—	739	3,503	465,261	食品・飲料・タバコ
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	4	64	8,590	保険
TE CONNECTIVITY LTD	—	8	106	14,167	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	—	7	255	33,959	各種金融
AMETEK INC	127	166	2,398	318,486	資本財
ELEVANCE HEALTH INC	68	15	783	104,095	ヘルスケア機器・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	756	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	—	18	254	33,849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTONATION INC	212	—	—	—	小売
AUTOZONE INC	—	14	3,564	473,366	小売
AVANTOR INC	—	44	108	14,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	—	707	3,657	485,727	各種金融
WR BERKLEY CORP	202	—	—	—	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	66	48	1,493	198,260	各種金融
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	15	116	15,412	消費者サービス
BOEING CO/THE	—	8	191	25,469	資本財
BOSTON SCIENTIFIC CORP	188	629	2,977	395,364	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	—	141	1,019	135,410	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	110	330	43,933	公益事業
BROWN & BROWN INC	—	17	100	13,397	保険
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	88	—	—	—	素材
CIGNA CORP	66	20	603	80,179	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	564	21	129	17,201	公益事業
CVS HEALTH CORP	—	86	768	102,006	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
COTERRA ENERGY INC	—	36	92	12,292	エネルギー
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	358	29	338	44,895	各種金融
CARRIER GLOBAL CORP	—	61	279	37,137	資本財
CATERPILLAR INC	286	—	—	—	資本財
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	—	234	1,828	242,813	メディア・娯楽
CENTENE CORP	—	371	2,723	361,653	ヘルスケア機器・サービス
CHEVRON CORP	—	142	2,455	326,119	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	—	26	127	16,947	小売
CHOICE HOTELS INTL INC	35	—	—	—	消費者サービス
CITIGROUP INC	—	141	729	96,823	銀行
CONAGRA BRANDS INC	74	35	126	16,788	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	—	84	955	126,883	エネルギー
CORNING INC	53	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVEREST RE GROUP LTD	—	2	110	14,620	保険
DR HORTON INC	213	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	—	14	159	21,243	公益事業
DANAHER CORP	—	45	1,170	155,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DELL TECHNOLOGIES -C	675	20	87	11,582	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DEVON ENERGY CORP	—	20	132	17,592	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	—	20	236	31,446	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	6	—	—	—	消費者サービス
DOW INC	912	—	—	—	素材
EOG RESOURCES INC	—	42	569	75,645	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	—	41	315	41,912	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	105	136	18,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELEMENT SOLUTIONS INC	—	214	436	57,904	素材
EMERSON ELECTRIC CO	—	17	148	19,719	資本財
EPAM SYSTEMS INC	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	596	—	—	—	各種金融
EVERCORE INC - A	33	—	—	—	各種金融
EXXON MOBIL CORP	—	44	513	68,160	エネルギー
FORD MOTOR CO	2,326	—	—	—	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	—	22	156	20,768	資本財
FREEPORT-MCMORAN INC	1,298	85	368	48,945	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	13	261	34,671	保険
GARTNER INC	154	5	202	26,901	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	—	115	2,689	357,164	資本財

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENERAL MOTORS CO	390	778	3,304	438,814	自動車・自動車部品
GSK PLC-SPON ADR	—	931	3,358	446,001	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	218	—	—	—	保険
GODADDY INC - CLASS A	—	11	96	12,784	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	224	15	393	52,187	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	—	77	236	31,410	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	—	59	233	31,015	エネルギー
HEICO CORP	—	8	149	19,839	資本財
HESS CORP	67	20	304	40,442	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	164	1,050	1,737	230,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	338	32	486	64,622	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	—	660	2,841	377,324	資本財
CHUBB LTD	—	28	597	79,343	保険
HUBSPOT INC	27	15	561	74,517	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	—	6	342	45,433	ヘルスケア機器・サービス
HYATT HOTELS CORP - CL A	39	—	—	—	消費者サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	—	22	544	72,325	資本財
INGERSOLL-RAND INC	—	29	171	22,741	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	27	—	—	—	各種金融
IQVIA HOLDINGS INC	203	12	285	37,901	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	—	197	2,829	375,727	銀行
JOHNSON & JOHNSON	428	174	2,822	374,745	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
KEYCORP	1,916	—	—	—	銀行
KINDER MORGAN INC	—	1,480	2,710	359,903	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	76	464	61,739	運輸
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	—	6	166	22,085	ヘルスケア機器・サービス
LENNAR CORP-A	—	17	177	23,534	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	43	—	—	—	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	103	—	—	—	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	—	75	3,659	485,884	資本財
LOEWS CORP	—	15	94	12,609	保険
LOWE'S COS INC	—	20	441	58,587	小売
M & T BANK CORP	—	13	211	28,111	銀行
MSCI INC	—	8	462	61,399	各種金融
MACY'S INC	—	1,201	2,695	357,973	小売
MANPOWERGROUP INC	32	—	—	—	商業・専門サービス

銘柄	前期末		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
MARATHON OIL CORP	129	128	347	46,178	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	—	52	670	88,997	エネルギー
MARRIOTT VACATIONS WORLD	32	—	—	—	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS	147	187	3,130	415,643	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	4	162	21,568	素材
MASTEC INC	166	—	—	—	資本財
MASTERCARD INC - A	—	57	2,132	283,118	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	—	168	1,831	243,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	180	44	322	42,872	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	31	1	258	34,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOLINA HEALTHCARE INC	146	1	35	4,668	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	—	10	337	44,817	各種金融
MOSAIC CO/THE	—	73	367	48,757	素材
NCR CORPORATION	207	275	738	98,117	ソフトウェア・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	162	—	—	—	運輸
NUCOR CORP	—	19	335	44,596	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	—	69	460	61,215	エネルギー
OMNICOM GROUP	7	—	—	—	メディア・娯楽
ORACLE CORP	359	—	—	—	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	204	31	261	34,781	資本財
PPG INDUSTRIES INC	—	15	201	26,780	素材
PAYCOM SOFTWARE INC	37	3	127	16,987	ソフトウェア・サービス
PFIZER INC	326	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	—	102	1,042	138,423	食品・飲料・タバコ
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	—	129	3,032	402,687	エネルギー
PROGRESSIVE CORP	—	38	541	71,884	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	—	27	279	37,176	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	—	36	226	30,041	公益事業
PULTEGROUP INC	21	—	—	—	耐久消費財・アパレル
RPM INTERNATIONAL INC	—	9	84	11,275	素材
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	105	—	—	—	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	99	1,008	133,922	資本財
REGIONS FINANCIAL CORP	77	—	—	—	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	125	—	—	—	保険
REPUBLIC SERVICES INC	21	16	203	26,975	商業・専門サービス

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
RIO TINTO PLC-SPON ADR	43	—	—	—	素材
RYDER SYSTEM INC	—	49	476	63,261	運輸
S&P GLOBAL INC	111	8	312	41,521	各種金融
SALESFORCE INC	77	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	—	103	586	77,918	エネルギー
SERVICENOW INC	82	62	2,892	384,055	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	—	16	387	51,467	素材
SITEONE LANDSCAPE SUPPLY INC	4	—	—	—	資本財
SNAP-ON INC	—	3	90	11,955	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	127	2,178	289,254	ソフトウェア・サービス
STATE STREET CORP	—	26	250	33,327	各種金融
STIFEL FINANCIAL CORP	—	237	1,594	211,742	各種金融
SYNCHRONY FINANCIAL	1,012	931	3,384	449,439	各種金融
SYSCO CORP	—	33	260	34,620	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	—	77	627	83,370	小売
TARGA RESOURCES CORP	37	—	—	—	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	6	301	39,978	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	7	3	84	11,235	ヘルスケア機器・サービス
TENET HEALTHCARE CORP	—	110	682	90,565	ヘルスケア機器・サービス
TEXTRON INC	272	15	117	15,560	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	110	15	293	38,925	保険
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	2	88	11,694	ソフトウェア・サービス
UNION PACIFIC CORP	—	8	181	24,167	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	53	—	—	—	運輸
UNITED RENTALS INC	—	5	238	31,712	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	43	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	—	81	1,205	160,046	ヘルスケア機器・サービス
VALERO ENERGY CORP	—	29	416	55,258	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	6	119	15,867	ヘルスケア機器・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	267	108	2,484	329,889	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	429	14	166	22,058	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	313	—	—	—	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	—	9	181	24,051	素材
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	35	193	25,739	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN UNION CO	1,227	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WHIRLPOOL CORP	—	3	55	7,317	耐久消費財・アパレル

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
WILLIAMS COS INC	—	855	2,730	362,612	エネルギー
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	325	—	—	—	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	—	15	196	26,130	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	24	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
ACCENTURE PLC-CL A	81	41	1,187	157,724	ソフトウェア・サービス
NVENT ELECTRIC PLC	55	115	526	69,934	資本財
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	17	317	42,137	資本財
AON PLC-CLASS A	—	14	441	58,623	保険
LINDE PLC	—	33	1,106	146,937	素材
INVESCO LTD	962	—	—	—	各種金融
(アメリカ・・・アメリカン市場)					
CHENIERE ENERGY INC	—	16	248	33,015	エネルギー
(アメリカ・・・米国店頭市場)					
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	19	366	48,615	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	—	107	4,049	537,693	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	37	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AIRBNB INC-CLASS A	—	25	303	40,318	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	—	11	103	13,732	ソフトウェア・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	—	4	69	9,164	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	46	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	36	520	4,945	656,658	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	39	245	2,323	308,492	メディア・娯楽
AMAZON.COM INC	36	623	6,213	825,064	小売
AMERICAN ELECTRIC POWER	190	34	312	41,475	公益事業
AMGEN INC	16	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
ANALOG DEVICES INC	—	38	699	92,934	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	—	6	175	23,273	ソフトウェア・サービス
APA CORP	—	21	92	12,299	エネルギー
APPLE INC	1,009	834	12,782	1,697,353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	110	56	671	89,222	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	—	16	365	48,480	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	—	72	235	31,275	エネルギー
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	—	12	134	17,804	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
BIOGEN INC	124	11	323	42,954	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	—	13	3,414	453,476	消費者サービス

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・米国店頭市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
BROADCOM INC	16	26	1,616	214,668	半導体・半導体製造装置
BRUKER CORP	44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CME GROUP INC	—	135	2,530	335,966	各種金融
CSX CORP	1,406	143	451	59,951	運輸
CADENCE DESIGN SYS INC	—	18	361	47,957	ソフトウェア・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	88	7	301	40,062	メディア・娯楽
CISCO SYSTEMS INC	—	589	2,812	373,520	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	—	12	537	71,426	商業・専門サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	544	38	256	34,086	ソフトウェア・サービス
COPART INC	—	26	181	24,093	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	—	81	4,120	547,143	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	—	26	201	26,743	商業・専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	13	160	21,282	ソフトウェア・サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	246	1,920	255,067	銀行
EBAY INC	18	—	—	—	小売
ENPHASE ENERGY INC	—	7	159	21,192	半導体・半導体製造装置
EXELON CORP	—	72	302	40,184	公益事業
META PLATFORMS INC-CLASS A	378	100	1,800	239,094	メディア・娯楽
FASTENAL CO	—	42	221	29,449	資本財
FORTINET INC	163	359	2,201	292,368	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	—	169	604	80,307	メディア・娯楽
GILEAD SCIENCES INC	812	415	3,558	472,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLOGIC INC	—	17	143	19,112	ヘルスケア機器・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	787	—	—	—	保険
IDEXX LABORATORIES INC	—	5	277	36,783	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	—	266	2,116	281,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	111	18	773	102,653	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	—	23	568	75,553	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	—	9	377	50,166	半導体・半導体製造装置
LKQ CORP	773	17	99	13,168	小売
LAM RESEARCH CORP	14	10	526	69,849	半導体・半導体製造装置
LULULEMON ATHLETICA INC	—	7	252	33,556	耐久消費財・アパレル
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	2	97	13,003	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	306	20	370	49,200	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	—	3	345	45,859	小売
MICROSOFT CORP	531	346	9,428	1,252,012	ソフトウェア・サービス

銘柄	前期末		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・米国店頭市場)	百株	百株	千米ドル	千円	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	—	309	2,625	348,663	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	481	82	513	68,237	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	160	22	397	52,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	—	562	3,691	490,234	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	—	5	114	15,222	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	16	835	110,945	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	234	28	299	39,758	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	—	15	566	75,235	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	7	72	9,594	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	566	917	1,727	229,388	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	238	—	—	—	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	72	—	—	—	小売
ON SEMICONDUCTOR CORP	192	94	824	109,438	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	—	38	278	37,034	資本財
PALO ALTO NETWORKS INC	44	208	3,550	471,423	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	189	409	3,162	419,966	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	18	101	1,775	235,785	食品・飲料・タバコ
REGENERON PHARMACEUTICALS	—	7	544	72,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	—	17	204	27,204	小売
SEAGEN INC	—	6	93	12,434	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	—	4	60	7,984	銀行
SPLUNK INC	—	10	116	15,511	ソフトウェア・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	13	174	23,164	素材
SYNOPSIS INC	33	10	380	50,470	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	80	69	1,455	193,309	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	219	—	—	—	半導体・半導体製造装置
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	393	1,962	260,654	メディア・娯楽
TRIPADVISOR INC	—	162	409	54,349	メディア・娯楽
ULTA BEAUTY INC	—	3	198	26,404	小売
VERISIGN INC	210	77	1,651	219,280	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	98	118	3,544	470,707	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	19	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	—	36	247	32,822	公益事業
ZSCALER INC	—	5	77	10,235	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	71	559	74,282	ソフトウェア・サービス



銘柄	株数	金額	前期末	当	期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・米国店頭市場) LIBERTY GLOBAL PLC- C ROYALTY PHARMA PLC- CL A	百株 — —	— — —	百株 33 25	百株 — —	千米ドル 73 96	千円 9,735 12,837	電気通信サービス 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
(アメリカ・・・シンガポール市場) JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	—	—	116	596	79,251	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	34,410 127	26,923 229	230,473 —	30,604,618 < 68.5% >		
(カナダ・・・トロント市場) GILDAN ACTIVEWEAR INC IMPERIAL OIL LTD MAGNA INTERNATIONAL INC ROYAL BANK OF CANADA SHOPIFY INC - CLASS A SUNCOR ENERGY INC TOURMALINE OIL CORP	929 494 153 — — 231 —	— — — — — — —	— — — 13 227 — 260	— — — 180 1,516 — 1,632	— — — 17,963 150,953 — 162,470	— — — — — — —	耐久消費財・アパレル エネルギー 自動車・自動車部品 銀行 ソフトウェア・サービス エネルギー エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,807 4	500 3	3,329 —	331,387 < 0.7% >		
(ユーロ・・・ドイツ) BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF BEIERSDORF AG DEUTSCHE POST AG-REG COVESTRO AG INFINEON TECHNOLOGIES AG MERCK KGAA VOLKSWAGEN AG-PREF MTU AERO ENGINES AG BRENNTAG SE HUGO BOSS AG -ORD E.ON SE HAPAG-LLOYD AG KNORR-BREMSE AG SILTRONIC AG	176 — 854 9 — 216 100 — 180 — — 5 — —	— — — — — — — — — — — — — —	— 21 — — 221 — — 37 — 324 — — 7 38	— — — — 792 — — 814 — 2,005 — — 45 295	— — — — 112,964 — — 116,187 — 285,971 — — 6,499 42,156	— — — — — — — — — — — — — —	自動車・自動車部品 家庭用品・パーソナル用品 運輸 素材 半導体・半導体製造装置 医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス 自動車・自動車部品 資本財 資本財 耐久消費財・アパレル 公益事業 運輸 資本財 半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,430 8	649 6	4,194 —	598,285 < 1.3% >		
(ユーロ・・・イタリア) BANCO BPM SPA	—	—	6,733	—	2,784	397,096	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— —	6,733 1	2,784 —	397,096 < 0.9% >		

銘 柄	前期末		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ・・・フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HERMES INTERNATIONAL	—	17	2,971	423,750	耐久消費財・アパレル	
SANOFI	—	349	3,076	438,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PERNOD RICARD SA	99	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	—	60	764	109,061	資本財	
KERING	66	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	298	—	—	—	資本財	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	517	—	—	—	資本財	
CHRISTIAN DIOR SE	—	0.52	41	5,929	耐久消費財・アパレル	
EIFFAGE	—	112	1,156	164,989	資本財	
PUBLICIS GROUPE	40	—	—	—	メディア・娯楽	
SOCIETE GENERALE SA	—	833	2,208	315,020	銀行	
ENGIE	—	933	1,235	176,216	公益事業	
SCOR SE	—	25	58	8,294	保険	
EDENRED	—	556	2,851	406,732	ソフトウェア・サービス	
DASSAULT SYSTEMES SE	118	454	1,719	245,265	ソフトウェア・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	—	162	2,593	369,888	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,159 7	3,504 11	18,678 —	2,663,876 < 6.0%>	
(ユーロ・・・オランダ)						
HEINEKEN HOLDING NV	73	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
AIRBUS SE	—	185	2,152	307,051	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	116	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
WOLTERS KLUWER	—	23	240	34,361	商業・専門サービス	
ASML HOLDING NV	104	67	4,186	597,037	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	231	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ING GROEP NV	—	860	1,123	160,201	銀行	
STELLANTIS NV	1,751	—	—	—	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	2,276 5	1,136 4	7,703 —	1,098,652 < 2.5%>	
(ユーロ・・・スペイン)						
BANKINTER SA	—	1,771	1,169	166,740	銀行	
IBERDROLA SA	—	250	269	38,378	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	—	966	2,734	389,959	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	— —	2,988 3	4,172 —	595,078 < 1.3%>	

銘柄		前期末		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・・・オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		—	389	654	93,274	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	—	389	654	93,274	
	銘 柄 数 比 率	—	1	—	< 0.2% >	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		430	—	—	—	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	430	—	—	—	
	銘 柄 数 比 率	1	—	—	< —% >	
(ユーロ・・・その他)						
SHELL PLC-NEW		1,741	—	—	—	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	1,741	—	—	—	
	銘 柄 数 比 率	1	—	—	< —% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	11,038	15,402	38,187	5,446,262	
	銘 柄 数 比 率	22	26	—	< 12.2% >	
(イギリス・・・英国市場)				千英ポンド		
BHP GROUP LTD		104	—	—	—	素材
DIAGEO PLC		322	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,156	906	2,820	456,197	食品・飲料・タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC		964	1,304	2,637	426,680	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA HBC AG-DI		357	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ANGLO AMERICAN PLC		797	—	—	—	素材
GLENCORE PLC		1,907	1,482	764	123,685	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	5,610	3,693	6,222	1,006,564	
	銘 柄 数 比 率	7	3	—	< 2.3% >	
(スイス・・・スイス電子市場)				千スイスフラン		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		—	250	3,563	513,357	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		—	51	1,443	207,911	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
TECAN GROUP AG-REG		19	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
ABB LTD-REG		832	—	—	—	資本財
LONZA GROUP AG-REG		72	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		160	—	—	—	運輸
UBS GROUP AG-REG		—	1,187	2,404	346,430	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	1,085	1,489	7,411	1,067,699	
	銘 柄 数 比 率	4	3	—	< 2.4% >	
(スウェーデン・・・ストックホルム市場)				千スウェーデンクローナ		
ERICSSON LM-B SHS		1,456	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	前期末	当	期 末		業 種 等		
				株 数	株 数		評 価 額	
							外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スウェーデン・・・ストックホルム市場)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円				
SAAB AB-B	—	214	10,956	140,572	資本財			
VOLVO AB-B SHS	241	1,393	28,607	367,039	資本財			
SSAB AB - B SHARES	1,388	812	5,696	73,090	素材			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	—	607	7,594	97,432	銀行			
SSAB AB-A SHARES	—	2,004	14,903	191,210	素材			
SWEDBANK AB - A SHARES	—	1,750	35,630	457,140	銀行			
NORDEA BANK ABP	754	114	1,440	18,485	銀行			
SWEDISH MATCH AB	1,120	—	—	—	食品・飲料・タバコ			
ORRON ENERGY AB	84	—	—	—	公益事業			
EVOLUTION AB	—	266	35,452	454,852	消費者サービス			
BOLIDEN AB	41	—	—	—	素材			
INVESTOR AB-B SHS	964	—	—	—	各種金融			
INTERNATIONAL PETROLEUM CORP	—	72	705	9,056	エネルギー			
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	6,052 8	7,236 9	140,988 —	1,808,880 < 4.0%>			
(ノルウェー・・・オスロ市場)			千ノルウェークローネ					
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	131	5,449	71,442	資本財			
NORSK HYDRO ASA	2,863	—	—	—	素材			
EQUINOR ASA	—	472	15,490	203,086	エネルギー			
DNB BANK ASA	—	77	1,506	19,751	銀行			
AKER BP ASA	981	—	—	—	エネルギー			
WALLENIUS WILHELMSEN ASA	271	—	—	—	運輸			
GOLDEN OCEAN GROUP LTD	139	—	—	—	運輸			
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	4,255 4	681 3	22,447 —	294,281 < 0.7%>			
(デンマーク・・・コペンハーゲン市場)			千デンマーククローネ					
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	6	—	—	—	運輸			
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	9	—	—	—	運輸			
GENMAB A/S	—	21	5,885	112,641	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス			
JYSKE BANK-REG	—	92	5,074	97,119	銀行			
PANDORA A/S	17	—	—	—	耐久消費財・アパレル			
NOVO NORDISK A/S-B	—	102	10,234	195,883	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス			
SCANDINAVIAN TOBACCO GROUP A	149	—	—	—	食品・飲料・タバコ			
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	182 4	217 3	21,193 —	405,644 < 0.9%>			
(オーストラリア・・・オーストラリア市場)			千オーストラリアドル					
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,621	937	2,414	223,835	銀行			

銘	柄	前期末		当 期		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア・・・オーストラリア市場)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
	AURIZON HOLDINGS LTD	—	4,240	1,416	131,294	運輸
	BHP GROUP LTD	—	788	3,764	348,886	素材
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	296	244	2,670	247,549	銀行
	COCHLEAR LTD	—	20	438	40,658	ヘルスケア機器・サービス
	COMPUTERSHARE LTD	—	85	211	19,574	ソフトウェア・サービス
	GSL LTD	85	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	MINERAL RESOURCES LTD	555	—	—	—	素材
	MACQUARIE GROUP LTD	271	—	—	—	各種金融
	QANTAS AIRWAYS LTD	—	1,803	1,163	107,817	運輸
	TELSTRA CORP LTD	15,942	—	—	—	電気通信サービス
	TREASURY WINE ESTATES LTD	5,808	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	25,580 7	8,122 7	12,079 —	1,119,616 < 2.5% >	
(香港・・・香港市場)				千香港ドル		
	AIA GROUP LTD	4,298	—	—	—	保険
	PRADA S. P. A.	696	—	—	—	耐久消費財・アパレル
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,994 2	— —	— —	— < —% >	
(シンガポール・・・シンガポール市場)				千シンガポールドル		
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,407	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,407 1	— —	— —	— < —% >	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	98,425 190	64,266 286	— —	42,084,954 < 94.2% >	

(注1) 邦貨換算金額は、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。

(注3) —印は組入れなし。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	前 期 末		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ・・・ニューヨーク市場)	百口	百口	千米ドル	千円	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1,025	23	78	10,468	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	10	184	24,558	
CAMDEN PROPERTY TRUST	132	128	1,575	209,153	
CROWN CASTLE INC	—	28	400	53,136	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	417	—	—	—	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	2	38	5,055	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	631	—	—	—	
INVITATION HOMES INC	1,061	40	133	17,713	
IRON MOUNTAIN INC	—	19	103	13,765	
LIFE STORAGE INC	—	19	235	31,279	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	42	63	1,077	143,104	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	—	334	1,371	182,138	
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	944	1,375	182,700	
PROLOGIS INC	—	109	1,392	184,962	
PUBLIC STORAGE	—	47	1,416	188,142	
SIMON PROPERTY GROUP INC	—	22	276	36,736	
(アメリカ・・・米国店頭市場)					
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	1,500	2,780	369,173	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	75	2,160	286,888	
合 計	金 額	3,310	3,368	14,601	1,938,979
	銘 柄 数<比 率>	6	16	—	<4.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、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。

(注3) 一印は組入れなし。

■投資信託財産の構成

2023年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 42,084,954	% 91.3
投 資 証 券	1,938,979	4.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,074,641	4.5
投 資 信 託 財 産 総 額	46,098,575	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(45,006,336千円)の投資信託財産総額(46,098,575千円)に対する比率は97.6%です。

(注2) 外貨建資産は、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。なお決算日における邦貨換算レートは1米ドル=132.79円、1カナダドル=99.52円、1ユーロ=142.62円、1英ポンド=161.76円、1スイスフラン=144.06円、1スウェーデンクローナ=12.83円、1ノルウェークローネ=13.11円、1デンマーククローネ=19.14円、1オーストラリアドル=92.69円、1ニュージーランドドル=84.06円、1香港ドル=16.92円、1シンガポールドル=99.99円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2023年2月15日
(A) 資 産	46,897,750,073円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	329,593,750
株 式 (評価額)	42,084,954,741
投 資 証 券 (評価額)	1,938,979,312
未 収 入 金	2,518,159,737
未 収 配 当 金	26,062,533
(B) 負 債	2,233,442,617
前 受 金	20,997
未 払 金	1,872,714,313
未 払 解 約 金	360,707,272
未 払 利 息	35
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	44,664,307,456
元 本	24,986,143,036
次 期 繰 越 損 益 金	19,678,164,420
(D) 受 益 権 総 口 数	24,986,143,036口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,876円

■損益の状況

項 目	当 期
	自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
(A) 配 当 等 収 益	1,120,124,748円
受 取 配 当 金	1,118,477,063
受 取 利 息	1,561,593
そ の 他 収 益 金	267,078
支 払 利 息	△ 180,986
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,638,069,911
売 買 益	16,924,224,513
売 買 損	△12,286,154,602
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 47,411,798
取 引 益	92,709,683
取 引 損	△ 140,121,481
(D) 信 託 報 酬 等	△ 13,381,750
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	5,697,401,111
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	24,521,905,136
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,859,647,830
(H) 解 約 差 損 益 金	△12,400,789,657
(I) 計 (E + F + G + H)	19,678,164,420
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	19,678,164,420

(注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(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引いた差額分をいいます。

(注4) 期首元本額は38,024,724,234円、当作成期間中において、追加設定元本額は2,719,380,070円、同解約元本額は15,757,961,268円です。

(注5) 元本の内訳 コクサイ計量株式ファンド(適格機関投資家専用) 24,138,672,079円  
G Sビッグデータ・ストラテジー(外国株式) 847,470,957円