

# グローバルESG株式インデックスファンド 〈愛称 ESGインサイト〉

## 運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2022年4月20日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
「グローバルESG株式インデックスファンド」は、2022年4月20日に第1期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。  
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

### 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型
信託期間	2021年7月13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。
主要投資対象	インベスコ・アセット・マネジメント株式会社が運用する「インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等のうちから、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配を行う方針です。ただし、分配対象金額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 収益分配に充てなかった留保益については、元本部分と同一の運用を行います。



ちばぎんアセットマネジメント

東京都墨田区江東橋2丁目13番7号

<照会先>

電話番号：03-5638-1451

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

ホームページ：http://www.chibagin-am.co.jp/

## 目 次

グローバルESG株式インデックスファンド…………… 1

(ご参考) 投資対象先の直近の内容

インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド (適格機関投資家限定) …… 10  
 F O F s 用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用) …… 34

### ・ 投資対象としている投資信託証券

投資信託証券
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド (適格機関投資家限定)
F O F s 用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)

※次頁以降、上記名称から「(適格機関投資家限定)」、「(適格機関投資家専用)」の表記を省略している場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額				インベスコ・グローバルESG インサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース)		投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰	中 率		
(設定日) 2021年7月13日	円 10,000		円 —		% —	2,084.81	% —	百万円 3,779
1期(2022年4月20日)	11,703		0		17.0	2,455.30	17.8	99.9

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注3) ベンチマークとして、インベスコ・グローバルESGインサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース) を使用しています。インベスコ・グローバルESGインサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース) (以下、「インデックス」といいます。) は、インベスコ・インデクシング・LLC (以下、「許諾者」といいます。) の所有物であり、委託会社にその使用が許諾されています。当ファンドは、許諾者 (その関係会社を含む。) によって、支援、推奨、販売または販売促進されていません。許諾者は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、インデックスの一般的な市場への追従能力について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行いません。許諾者はインデックスの決定、構築、計算に関し、被許諾者または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。許諾者は、当ファンドの発行や償還に関する決定や計算に責任を負わず、また関与をしません。許諾者は、当ファンドの管理、販売、取引に関して義務や責任を負いません。

許諾者は、インデックスとそれに含まれるデータの正確性、完全性を保証しません。許諾者は、ここに許諾された権利に関連するインデックスまたはそれに含まれるデータの利用により、被許諾者、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、または、その他のいかなる使用に対しても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行いません。許諾者は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつインデックスまたはそれに含まれるデータに関する、特定の目的のための市場商品性または適合性については、いかなる保証も明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、許諾者は、いかなる特別、懲罰的、間接的もしくは結果的損害 (逸失利益を含む。) について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。

(注4) インベスコ・グローバルESGインサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース) は、基準価額への反映を考慮して、前営業日の値を使用しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

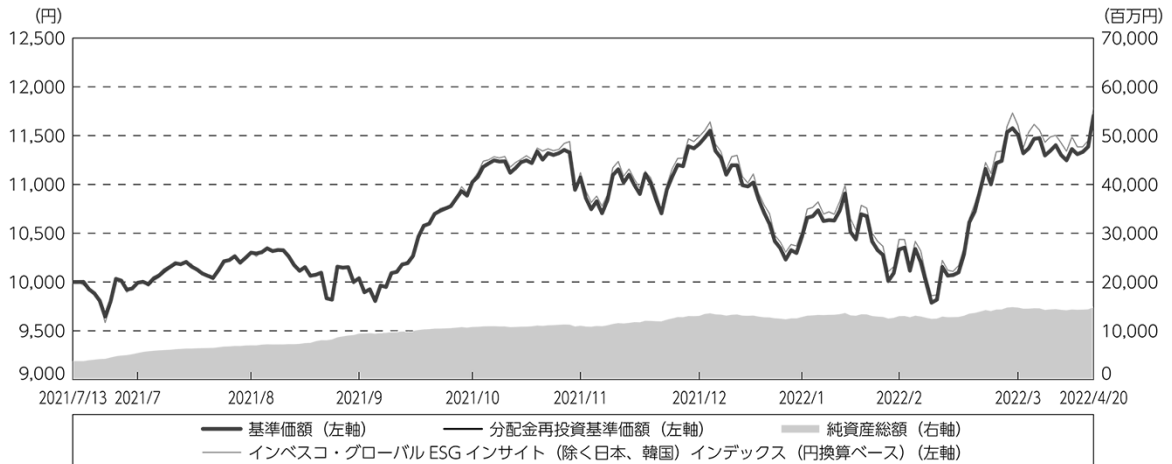
年月日	基準価額		インベスコ・グローバルESG インサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース)		投資信託 証券 組入比率
	騰 落	率	騰 落	率	
(設定日) 2021年7月13日	円 10,000	% —	2,084.81	% —	% —
7月末	9,992	△ 0.1	2,081.60	△ 0.2	95.7
8月末	10,300	3.0	2,147.51	3.0	99.9
9月末	10,038	0.4	2,094.64	0.5	97.3
10月末	11,025	10.3	2,301.61	10.4	100.1
11月末	11,071	10.7	2,318.17	11.2	99.9
12月末	11,415	14.2	2,395.84	14.9	100.2
2022年1月末	10,463	4.6	2,193.45	5.2	99.3
2月末	10,334	3.3	2,175.82	4.4	99.7
3月末	11,510	15.1	2,419.43	16.1	100.0
(期 末) 2022年4月20日	11,703	17.0	2,455.30	17.8	99.9

(注) 騰落率は設定日比です。

○運用経過

(2021年7月13日～2022年4月20日)

期中の基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）は、基準価額への反映を考慮して、前営業日の値を使用し、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注4) インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）は当ファンドのベンチマークです。
- (注5) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、当期末において11,703円となりました。なお、期中の分配は行いませんでしたので、2021年7月13日設定来では17.0%（信託報酬控除後）の上昇となりました。

(プラス要因)

- ・ 好調な企業業績
- ・ 為替市場で円安ドル高の進行

(マイナス要因)

- ・ 新型コロナウイルスのオミクロン型変異株の感染拡大
- ・ 急速なインフレ進行および欧米の金融引き締め観測を受けた金利上昇
- ・ ウクライナ情勢を巡る地政学リスクの高まり

## 投資環境

米国株式市場は、期初は新型コロナウイルス変異株の感染拡大を受けて下落して始まりましたが、好調な企業決算などを受けて上昇に転じました。インフレ加速による金融緩和の縮小観測が上値を抑えましたが、2021年末にかけてはおおむね堅調な相場展開となりました。しかしながら、2022年初に公表された米連邦公開市場委員会（FOMC）議事要旨を受けて、金融引き締めが予想以上に早く進むとの見方が広がったほか、その後発表されたCPI（消費者物価指数）が非常に高い伸び率となったことでインフレ懸念が高まり、株式市場はテクノロジー関連銘柄を中心に大きく下落しました。2月にはロシアがウクライナに軍事侵攻したことでリスク回避姿勢がさらに強まりました。3月中旬に行われたFOMCで市場予想通り0.25%の利上げとなったことで不透明感が後退したこと、ロシア・ウクライナ停戦交渉の進展期待などから、3月末にかけて株式市場は回復しましたが、4月に入り再び金利が上昇基調となったことで反落しました。

欧州主要株式市場は、2021年11月中旬にかけては好調な企業決算などを背景に上昇しましたが、新型コロナウイルスの変異株であるオミクロン株の感染拡大懸念が高まり11月末にかけて下落しました。年末にかけては世界株式の上昇やオミクロン株への過度な警戒感の後退を背景に反発しました。2022年に入りインフレ懸念の高まりや、ロシアによるウクライナ軍事侵攻により欧州地域の地政学リスクが急速に高まったことなどを背景に株式市場は急落しました。

為替市場は、米国をはじめとする各国の早期金融引き締め観測が高まるなか、日銀がイールドカーブコントロール政策を継続し金利差が拡大したことなどを背景に、円安が急速に進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

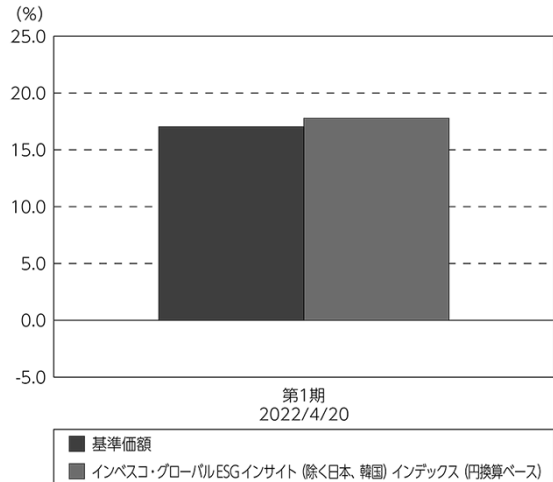
主要投資対象であるインベスコ・アセット・マネジメント株式会社が運用する「インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」と三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が運用する「F0Fs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）」に投資を行いました。

主要投資対象である「インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」への投資を通じて、先進国の株式に投資し、「インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）」に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

ベンチマークとのかい離は△0.74%程度となりました。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注1) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

(注2) インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）は当ファンドのベンチマークです。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項目	第1期
	2021年7月13日～ 2022年4月20日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,703

(注1) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ○今後の運用方針

---

ファンドの基本方針に則り、インベスコ・アセット・マネジメント株式会社が運用する「インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド（適格機関投資家限定）」受益証券を高位に組み入れることで、「インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）」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

(2021年7月13日～2022年4月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 71	% 0.667	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(36)	(0.340)	委託した資金の運用の対価
( 販 売 会 社 )	(32)	(0.297)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	( 3 )	(0.030)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.004	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	71	0.671	
期中の平均基準価額は、10,683円です。			

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

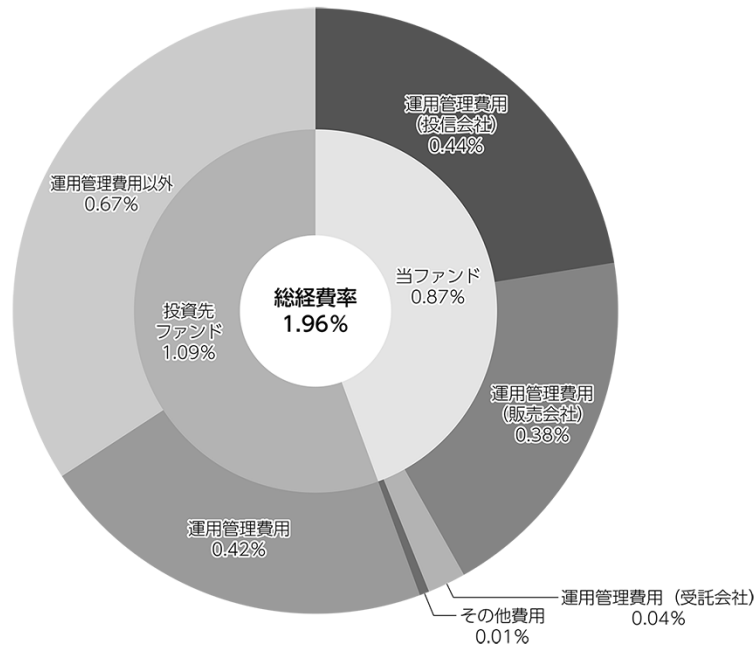
(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.96%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.96
①当ファンドの費用の比率	0.87
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.42
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.67

(注1) 当ファンドの費用は1万円当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注5) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注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) 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

(2021年7月13日～2022年4月20日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド	13,090,473,210	13,434,710	540,453,820	603,790
	F O F s 用短期金融資産ファンド	10,138	10	—	—
	合計	13,090,483,348	13,434,720	540,453,820	603,790

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月13日～2022年4月20日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年7月13日～2022年4月20日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年7月13日～2022年4月20日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年4月20日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		当期末		
		口数	評価額	比率
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド		口	千円	%
		12,550,019,390	14,778,902	99.9
	F O F s 用短期金融資産ファンド	10,138	9	0.0
合計	計	12,550,029,528	14,778,912	99.9

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

(2022年4月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	14,778,912	99.5
コール・ローン等、その他	78,540	0.5
投資信託財産総額	14,857,452	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,857,452,325
コール・ローン等	78,539,507
投資信託受益証券(評価額)	14,778,912,818
(B) 負債	62,398,003
未払解約金	31,098,741
未払信託報酬	31,100,992
未払利息	210
その他未払費用	198,060
(C) 純資産総額(A-B)	14,795,054,322
元本	12,642,003,623
次期繰越損益金	2,153,050,699
(D) 受益権総口数	12,642,003.623口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,703円

(注1) 当ファンドの設定時元本額は3,779,897,520円、期中追加設定元本額は11,409,112,686円、期中一部解約元本額は2,547,006,583円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.1703円です。

## ○損益の状況 (2021年7月13日～2022年4月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 86,381
支払利息	△ 86,381
(B) 有価証券売買損益	1,748,665,032
売買益	1,949,631,244
売買損	△ 200,966,212
(C) 信託報酬等	△ 71,207,232
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,677,371,419
(E) 追加信託差損益金	475,679,280
(配当等相当額)	(△ 78,377)
(売買損益相当額)	( 475,757,657)
(F) 計(D+E)	2,153,050,699
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	2,153,050,699
追加信託差損益金	475,679,280
(配当等相当額)	(△ 78,377)
(売買損益相当額)	( 475,757,657)
分配準備積立金	1,677,457,800
繰越損益金	△ 86,381

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

(注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し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,677,457,800円)、および信託約款に規定する収益調整金(475,671,276円)より分配対象収益は2,153,129,076円(1万口当たり1,703円)ですが、当期に分配した金額はありません。

## ○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

## ○お知らせ

2021年7月13日から2022年4月20日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

## インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド (適格機関投資家限定)

《第1期》決算日2022年4月20日

[計算期間：2021年7月14日～2022年4月20日]

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>・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を行いません。</li> </ul>	
主要運用対象	インベスコ グローバルESGインサイト・ インデックス・ファンド (適格機関投資家限定)	「インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	インベスコ グローバルESGインサイト・ インデックス マザーファンド	日本を除く世界の金融商品取引所に上場されている株式のうち、主としてインベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックスに採用されている株式に投資します。ただし、純資産総額が少額の場合、ESG関連銘柄に投資する上場投資信託証券に投資することがあります。
組入制限	インベスコ グローバルESGインサイト・ インデックス・ファンド (適格機関投資家限定)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
	インベスコ グローバルESGインサイト・ インデックス マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・上場投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
分配方針	年1回の毎決算時（原則として4月20日。同日が休業日の場合は翌営業日）に委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行います。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合があります。	

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額				インベスコ・グローバルESGインサイト (除く日本、韓国)インデックス(円換算ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配	み 金	期 騰落	中 率	期 騰落			
(設定日)	円		円		%		%	%	百万円
2021年7月14日	10,000		—		—	2,078.12	—	—	3,704
1期(2022年4月20日)	11,776		0		17.8	2,455.30	18.2	96.2	14,778

(注) 基準価額は1万円当たりです。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) ベンチマークとして、インベスコ・グローバルESGインサイト(除く日本、韓国)インデックス(円換算ベース)を使用しています。インベスコ・グローバルESGインサイト(除く日本、韓国)インデックス(円換算ベース)(以下、「インデックス」といいます。)は、Invesco Indexing LLC(以下、「許諾者」といいます。)の所有物であり、委託会社にその使用が許諾されています。

当ファンドは、許諾者によって、支援、推奨、販売または販売促進されていません。許諾者は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、インデックスの一般的な市場への追従能力について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行ないません。許諾者は、被許諾者の関連会社であり、その関係には許諾者の商標や商号の使用許諾、および被許諾者や当ファンドに関わりなく許諾者により決定、構築、計算されるインデックスの使用許諾を含みます。許諾者はインデックスの決定、構築、計算に関し、被許諾者または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。許諾者は、当ファンドの発行や償還に関する決定や計算に責任を負わず、また関与をしません。許諾者は、当ファンドの管理、販売、取引に関して義務や責任を負いません。

許諾者は、インデックスとそれに含まれるデータの正確性、完全性を保証しません。許諾者は、ここに許諾された権利に関連するインデックスまたはそれに含まれるデータの利用により、被許諾者、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、または、その他のいかなる使用に対しても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行ないません。許諾者は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつインデックスまたはそれに含まれるデータに関する、特定の目的のための市場商品性または適合性については、いかなる保証も明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、許諾者は、いかなる特別、懲罰的、間接的もしくは結果的損害(逸失利益を含む。)について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。ベンチマークの算出・取得ができない事態が生じた場合、委託会社はベンチマークの変更や廃止を含む運用方針の見直しを行うことまたはファンドを償還することがあります。以下、同じです。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れていますので、「株式組入比率」「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		インベスコ・グローバルESGインサイト (除く日本、韓国) インデックス (円換算ベース) (ベンチマーク)		株 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(設定日) 2021年7月14日	円 10,000	% —	2,078.12	% —	% —	% —
7月末	9,995	△ 0.1	2,081.60	0.2	100.4	1.6
8月末	10,315	3.2	2,147.51	3.3	96.4	1.5
9月末	10,055	0.6	2,094.64	0.8	99.0	1.6
10月末	11,049	10.5	2,301.61	10.8	96.5	1.5
11月末	11,105	11.1	2,318.17	11.6	96.7	1.5
12月末	11,454	14.5	2,395.84	15.3	96.5	1.6
2022年1月末	10,507	5.1	2,193.45	5.5	97.0	1.6
2月末	10,384	3.8	2,175.82	4.7	96.6	1.6
3月末	11,574	15.7	2,419.43	16.4	96.3	1.7
(期 末) 2022年4月20日	11,776	17.8	2,455.30	18.2	96.2	1.7

(注) 基準価額は1万円当たりです。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比です。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れていますので、「株式組入比率」「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

## ○運用経過

### ◎投資環境

インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース） +18.2%  
 米ドル／円 129円43銭（設定日110円67銭） ユーロ／円 139円73銭（同130円34銭）

※株価指数の騰落率は当期末時点（対設定日比）、米ドル／円およびユーロ／円は当期末の数値です。

当期の世界の株式市場は上昇しました。

雇用の回復や良好な企業決算などを好感し、2021年7月から8月にかけて上昇基調で推移しました。しかし、9月に入ると、米国本土における新型コロナウイルスの感染拡大を受けて米国景気の減速懸念が高まったほか、米国長期金利の上昇や中国不動産企業の債務危機も嫌気され、株式市場は調整しました。10月以降は世界的なインフレ懸念の高まりを背景とした米国長期金利の上昇が嫌気され、一時的に株式市場が調整する局面もありましたが、引き続き良好な企業業績を受けて反発し、新型コロナウイルスの変異株に対する過度な警戒感が後退したことなどからリスクセンチメントが改善し、2021年の年末にかけて堅調な推移となりました。2022年の年明け以降は米連邦準備理事会（FRB）による金融引き締めへの警戒感やウクライナ情勢緊迫化による地政学リスクの高まりを背景に下落する場面もありましたが、期末にかけて反発し、設定時比では株式市場は上昇しました。

当期の為替市場は、設定時は新型コロナウイルス感染拡大や米国景気の回復鈍化に対する懸念が高まったことなどから日本円は米ドルやユーロに対し堅調に推移し円高となりましたが、2021年10月以降のインフレ懸念の高まりを背景とした米国や欧州での長期金利の上昇や、米国での利上げに伴う日米の短期金利差拡大を受けて、期末にかけて対米ドル、対ユーロでの円安が進行しました。

### ◎当ファンドのポートフォリオ

主として、インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド（以下、マザーファンドといいます。）に投資を行い、マザーファンドを通じて、日本を除く世界の金融商品取引所に上場されている株式のうち、主としてインベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックスに採用されている株式に投資を行いました。また、実質外貨建資産の投資に当たっては、為替ヘッジを行いませんでした。

マザーファンドでは、インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指しました。

### ○分配金

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向などを勘案し、当期は見送りとさせていただきます。収益分配金に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保して元本部分と同一の運用を行います。

## ○今後の運用方針

---

主としてマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の金融商品取引所に上場されている株式のうち、主としてインベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックスに採用されている株式に投資を行います。また、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を行わない方針です。

マザーファンドでは、インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）の動き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

(2021年7月14日～2022年4月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.326	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(32)	(0.296)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等の対価
( 販 売 会 社 )	( 0 )	(0.004)	購入後の情報提供、運用報告書等各種資料の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
( 受 託 会 社 )	( 3 )	(0.025)	ファンドの財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	7	0.070	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
( 株 式 )	( 7 )	(0.069)	
( 投 資 信 託 証 券 )	( 0 )	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	55	0.517	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(55)	(0.512)	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 )	( 0 )	(0.004)	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 )	( 0 )	(0.000)	その他は、外国有価証券に係る税金・手数料等
合 計	97	0.913	
期中の平均基準価額は、10,715円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第4位を四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年7月14日～2022年4月20日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド	13,080,449	13,434,512	569,789	638,522

(注) 単位未満は切捨てています。

## ○株式売買比率

(2021年7月14日～2022年4月20日)

## 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	
	インベスコ	グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額		13,574,175千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		10,418,699千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		1.30

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末のわが国の対顧客電信売買相場仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年7月14日～2022年4月20日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2022年4月20日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	当期末	
	口数	評価額
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド	12,510,659	14,778,842

(注) 単位未満は切捨てています。

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

## ○投資信託財産の構成

(2022年4月20日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド	14,778,842	99.9
コール・ローン等、その他	15,277	0.1
投資信託財産総額	14,794,119	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てています。

(注) インベスコ グローバルESGインサイト・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(14,786,258千円)の投資信託財産総額(14,794,950千円)に対する比率は99.9%です。

(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。なお、2022年4月20日における邦貨換算レートは、1米ドル=129.43円、1カナダドル=102.65円、1ユーロ=139.73円、1英ポンド=168.49円、1スイスフラン=135.86円、1スウェーデンクローナ=13.57円、1ノルウェークローネ=14.65円、1デンマーククローネ=18.78円、1オーストラリアドル=95.73円、1ニュージーランドドル=87.37円、1香港ドル=16.50円、1シンガポールドル=94.58円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月20日現在)

## ○損益の状況 (2021年7月14日～2022年4月20日)

項目	当 期 末
(A) 資産	14,794,119,349
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド(円換)	14,778,842,496
未収入金	15,276,853
(B) 負債	15,276,853
未払信託報酬	15,078,853
その他未払費用	198,000
(C) 純資産総額(A-B)	14,778,842,496
元本	12,550,019,390
次期繰越損益金	2,228,823,106
(D) 受益権総口数	12,550,019,390口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,776円

&lt;注記事項&gt; (当運用報告書作成時点では監査未了です。)

(貸借対照表関係)

設定時元本額	3,704,290,000円
期中追加設定元本額	9,386,183,210円
期中一部解約元本額	540,453,820円

項目	当 期
(A) 有価証券売買損益	1,929,144,285
売買益	1,985,160,811
売買損	△ 56,016,526
(B) 信託報酬等	△ 34,930,832
(C) 当期損益金(A+B)	1,894,213,453
(D) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	334,609,653 ( 334,609,653)
(E) 計(C+D)	2,228,823,106
(F) 収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	2,228,823,106
追加信託差損益金 (配当等相当額)	334,609,653 ( 8,316,958)
(売買損益相当額)	( 326,292,695)
分配準備積立金	1,894,213,453

(注) (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) (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) (D)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) 運用の指図に係る権限を委託するための費用として、委託者が受ける報酬の40%の金額を、(B)信託報酬等のうちの委託者報酬の中から支払っています。

(注) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(109,619,827円)、費用控除後の有価証券売買等損益(1,784,593,626円)、および信託約款に規定する収益調整金(334,609,653円)より分配対象収益は2,228,823,106円(1万口当たり1,775円)となりましたが、基準価額水準、市況動向等を勘案し、当期の分配を見合わせました。

## インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス マザーファンド

《第1期》決算日2022年4月20日

〔計算期間：2021年7月14日～2022年4月20日〕

## ○運用経過

## ◎投資環境

インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース） +18.2%  
 米ドル／円 129円43銭（設定日110円67銭） ユーロ／円 139円73銭（同130円34銭）

※株価指数の騰落率は当期末時点（対設定日比）、米ドル／円およびユーロ／円は当期末の数値です。

当期の世界の株式市場は上昇しました。

雇用の回復や良好な企業決算などを好感し、2021年7月から8月にかけて上昇基調で推移しました。しかし、9月に入ると、米国本土における新型コロナウイルスの感染拡大を受けて米国景気の減速懸念が高まったほか、米国長期金利の上昇や中国不動産企業の債務危機も嫌気され、株式市場は調整しました。10月以降は世界的なインフレ懸念の高まりを背景とした米国長期金利の上昇が嫌気され、一時的に株式市場が調整する局面もありましたが、引き続き良好な企業業績を受けて反発し、新型コロナウイルスの変異株に対する過度な警戒感が後退したことなどからリスクセンチメントが改善し、2021年の年末にかけて堅調な推移となりました。2022年の年明け以降は米連邦準備理事会（FRB）による金融引き締めへの警戒感やウクライナ情勢緊迫化による地政学リスクの高まりを背景に下落する場面もありましたが、期末にかけて反発し、設定時比では株式市場は上昇しました。

当期の為替市場は、設定時は新型コロナウイルス感染拡大や米国景気の回復鈍化に対する懸念が高まったことなどから日本円は米ドルやユーロに対し堅調に推移し円高となりましたが、2021年10月以降のインフレ懸念の高まりを背景とした米国や欧州での長期金利の上昇や、米国での利上げに伴う日米の短期金利差拡大を受けて、期末にかけて対米ドル、対ユーロでの円安が進行しました。

## ◎当ファンドのポートフォリオ

日本を除く世界の金融商品取引所に上場されている株式のうち、主としてインベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックスに採用されている株式に投資を行いました。また、外貨建資産の投資に当たっては、為替ヘッジを行いませんでした。

当ファンドは、インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指しました。

## ○今後の運用方針

日本を除く世界の金融商品取引所に上場されている株式のうち、主としてインベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックスに採用されている株式に投資を行います。また、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わない方針です。

当ファンドは、インベスコ・グローバルESGインサイト（除く日本、韓国）インデックス（円換算ベース）の動き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

(2021年7月14日～2022年4月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 8	% 0.070	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(7)	(0.069)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(b) そ の 他 費 用	55	0.513	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  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  その他は、外国有価証券に係る税金・手数料等
(保 管 費 用)	(55)	(0.512)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	63	0.583	
期中の平均基準価額は、10,732円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第4位を四捨五入してあります。



## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	アメリカ		口 千米ドル		口 千米ドル
	AVALONBAY COMMUNITIES	655	150	20	4
	KIMCO REALTY	1,959	43	70	1
	KILROY REALTY	528	36	18	1
	HOST HOTELS & RESORTS	3,322	55	126	2
	SIMON PROPERTY GROUP	1,554	209	59	8
	VENTAS	1,778	100	65	3
	DIGITAL REALTY TRUST	1,341	210	52	7
	PROLOGIS	3,498	474	130	20
	HEALTHPEAK PROPERTIES	2,559	89	94	3
	SL GREEN REALTY	308 ( 7)	22 (0.63279)	6 ( 309)	0.45386 ( 23)
	SL GREEN REALTY	16 ( 299)	1 ( 23)	7 ( 2)	0.54359 ( -)
WELLTOWER	1,985	171	73	6	
小計	19,503 ( 306)	1,565 ( 23)	720 ( 311)	61 ( 23)	
国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	ICADE	209	14	8	0.49649
	KLEPIERRE	1,030	21	38	0.85083
	GECINA	349	44	11	1
	COVIVIO	325	24	11	0.80169
	小計	1,913	105	68	3
	ユーロ計	1,913	105	68	3
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	3,959	20	148	0.76324
	DERWENT LONDON PLC	493	17	15	0.49608
	LAND SECURITIES GROUP	3,457	24	131	0.97424
小計	7,909	62	294	2	
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル	
DEXUS	5,114	54	194	2	
SCENTRE GROUP	22,291	62	856	2	
VICINITY CENTRES	18,332	29	698	1	
小計	45,737	146	1,748	6	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 単位未満は切捨てています。ただし、単位未満の場合は、小数で記載しています。

(注) ( ) 内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ○株式売買比率

(2021年7月14日～2022年4月20日)

## 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	13,574,175千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,418,699千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.30

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末のわが国の対顧客電信売買相場仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注) 金額の単位未満は切捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年7月14日～2022年4月20日)

該当事項はございません。

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



## ○組入資産の明細

(2022年4月20日現在)

## 外国株式

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	80	969	125,427	ヘルスケア機器・サービス
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10	252	32,689	素材
ALLSTATE	13	193	25,078	保険
AMERICAN EXPRESS	36	688	89,173	各種金融
JONES LANG LASALLE	2	54	6,989	不動産
APTARGROUP	3	35	4,551	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	25	244	31,624	食品・飲料・タバコ
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25	592	76,670	ソフトウェア・サービス
AVERY DENNISON	3	64	8,291	素材
BAXTER INTERNATIONAL	23	176	22,795	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON	13	350	45,391	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY	9	90	11,751	小売
YUM! BRANDS	12	156	20,294	消費者サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1	186	24,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB	102	781	101,208	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1	26	3,389	各種金融
UNITED RENTALS	2	80	10,463	資本財
CSX	72	254	32,977	運輸
CONSTELLATION BRANDS-A	7	185	24,052	食品・飲料・タバコ
CHURCH & DWIGHT	11	114	14,863	家庭用品・パーソナル用品
CLOROX COMPANY	5	82	10,701	家庭用品・パーソナル用品
COLGATE-PALMOLIVE	38	311	40,366	家庭用品・パーソナル用品
CONAGRA BRANDS	21	79	10,283	食品・飲料・タバコ
MOODY'S	5	198	25,643	各種金融
MORGAN STANLEY	67	598	77,411	各種金融
REPUBLIC SERVICES	6	89	11,561	商業・専門サービス
WALT DISNEY	76	1,011	130,923	メディア・娯楽
BANK OF AMERICA	391	1,550	200,672	銀行
SALESFORCE	54	1,036	134,187	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC	260	2,488	322,063	資本財
ESTEE LAUDER COMPANIES-A	10	290	37,597	家庭用品・パーソナル用品
FMC	5	81	10,603	素材
ASSURANT	2	52	6,745	保険
GENERAL MILLS	27	200	25,898	食品・飲料・タバコ
WW GRAINGER	1	75	9,791	資本財
GOLDMAN SACHS GROUP	15	508	65,831	各種金融
CROWN HOLDINGS	6	73	9,477	素材
HOME DEPOT	44	1,382	178,994	小売
LENNOX INTERNATIONAL	14	364	47,212	資本財
HUMANA	5	270	35,027	ヘルスケア機器・サービス
INTERPUBLIC GROUP OF COS	16	58	7,601	メディア・娯楽
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	16	119	15,519	保険
KELLOGG	15	106	13,719	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	44	94	12,281	銀行
KIMBERLY-CLARK	15	196	25,386	家庭用品・パーソナル用品
KOHL'S	6	40	5,246	小売

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4	70	9,124	素材
ELI LILLY & CO	41	1,232	159,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL	8	55	7,166	保険
UNITED PARCEL SERVICE-B	23	438	56,815	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	13	176	22,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOWE'S COMPANIES	30	615	79,653	小売
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16	71	9,316	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG	11	115	14,954	食品・飲料・タバコ
MANPOWERGROUP	1	16	2,128	商業・専門サービス
EDWARDS LIFESCIENCES	28	351	45,545	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE	40	288	37,295	保険
CVS HEALTH	60	625	80,897	ヘルスケア機器・サービス
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	4	120	15,651	ヘルスケア機器・サービス
MICRON TECHNOLOGY	68	494	64,030	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES	2	65	8,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR	165	267	34,575	自動車・自動車部品
NEWMONT	36	304	39,348	素材
NIKE-B	52	714	92,505	耐久消費財・アパレル
NORDSTROM	4	13	1,722	小売
NORFOLK SOUTHERN	7	210	27,287	運輸
ORACLE	105	842	109,060	ソフトウェア・サービス
EXELON	44	221	28,619	公益事業
PEPSICO	63	1,091	141,275	食品・飲料・タバコ
PFIZER	256	1,287	166,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PROCTER & GAMBLE	112	1,787	231,413	家庭用品・パーソナル用品
MERCK	116	995	128,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER	64	277	35,980	エネルギー
ZIMMER BIOMET HOLDINGS	9	124	16,159	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN	6	110	14,311	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12	93	12,083	保険
SMITH (A. O.)	58	380	49,191	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL	18	215	27,899	保険
SONOCO PRODUCTS	4	29	3,828	素材
ADVANCE AUTO PARTS	2	61	7,962	小売
SOUTHWEST AIRLINES	4	22	2,886	運輸
STATE STREET	15	118	15,357	各種金融
SYSCO	23	205	26,659	食品・生活必需品小売り
THERMO FISHER SCIENTIFIC	17	1,032	133,687	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAVITA INC	4	57	7,392	ヘルスケア機器・サービス
UNION PACIFIC	21	518	67,046	運輸
UNITEDHEALTH GROUP	43	2,314	299,534	ヘルスケア機器・サービス
VF	15	88	11,487	耐久消費財・アパレル
WASTE MANAGEMENT	12	205	26,540	商業・専門サービス
WATSCO	14	407	52,701	資本財
WILLIAMS-SONOMA	3	46	6,076	小売
TJX COMPANIES	50	333	43,113	小売
LAS VEGAS SANDS	32	123	15,976	消費者サービス
MOLSON COORS BEVERAGE-B	9	50	6,580	食品・飲料・タバコ
HANESBRANDS	14	21	2,749	耐久消費財・アパレル
DELTA AIR LINES	5	21	2,835	運輸
BANK OF NEW YORK MELLON	40	186	24,150	各種金融

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
GENPACT	5	23	3,034	ソフトウェア・サービス
VMWARE-A	4	52	6,850	ソフトウェア・サービス
MSCI	2	125	16,189	各種金融
VISA-A	102	2,219	287,248	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS	8	136	17,680	公益事業
CHUBB LIMITED	20	430	55,671	保険
MOSAIC	15	123	15,946	素材
XYLEM	78	667	86,387	資本財
STANLEY BLACK & DECKER	5	74	9,598	資本財
PVH	3	24	3,108	耐久消費財・アパレル
RALPH LAUREN	2	22	2,934	耐久消費財・アパレル
CBRE GROUP	15	131	17,065	不動産
APTIV	11	125	16,242	自動車・自動車部品
BERRY GLOBAL	6	35	4,621	素材
ABBVIE	80	1,264	163,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUBBELL	23	444	57,566	資本財
BAKER HUGHES	35	130	16,847	エネルギー
IQVIA HOLDINGS	8	207	26,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVENT ELECTRIC	72	257	33,313	資本財
WYNDHAM HOTELS & RESORTS	3	34	4,527	消費者サービス
CIGNA CORP	15	409	53,042	ヘルスケア機器・サービス
DOW	34	229	29,679	素材
XEROX	11	21	2,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CARRIER GLOBAL	379	1,612	208,721	資本財
TRANE TECHNOLOGIES	104	1,558	201,741	資本財
LUMEN TECHNOLOGIES	66	77	9,982	電気通信サービス
CITIZENS FINANCIAL	19	85	11,075	銀行
MEDTRONIC	61	680	88,062	ヘルスケア機器・サービス
EVERSOURCE ENERGY	15	145	18,796	公益事業
AVANGRID INC	3	17	2,229	公益事業
JANUS HENDERSON GROUP	7	26	3,488	各種金融
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	9	45	5,903	食品・飲料・タバコ
S&P GLOBAL	7	302	39,196	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS	11	188	24,409	消費者サービス
HP	76	294	38,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LINDE	23	756	97,921	素材
ADVANCED MICRO DEVICES	73	713	92,398	半導体・半導体製造装置
AMGEN	26	666	86,247	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE	427	7,153	925,899	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	55	651	84,285	半導体・半導体製造装置
AUTODESK	13	272	35,240	ソフトウェア・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL-A	11	220	28,538	消費者サービス
AMDOCS	7	64	8,307	ソフトウェア・サービス
EBAY	39	220	28,512	小売
GILEAD SCIENCES	57	360	46,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA	145	3,228	417,833	半導体・半導体製造装置
JUNIPER NETWORKS	19	70	9,129	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUNT (JB) TRANSPRT SERVICES	2	46	6,031	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES	46	64	8,395	銀行
BIOGEN	6	153	19,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LAM RESEARCH	8	414	53,648	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AKAMAI TECHNOLOGIES	9	118	15,359	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER	321	901	116,742	資本財
MICROSOFT	218	6,237	807,358	ソフトウェア・サービス
NORTHERN TRUST	9	104	13,530	各種金融
PACCAR	10	93	12,074	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	4	333	43,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES	14	158	20,509	小売
FIRST SOLAR	58	462	59,886	半導体・半導体製造装置
LULULEMON ATHLETICA	4	195	25,244	耐久消費財・アパレル
VERISK ANALYTICS-A	9	211	27,312	商業・専門サービス
UNITED AIRLINES	2	11	1,534	運輸
TESLA	55	5,693	736,960	自動車・自動車部品
ENPHASE ENERGY	79	1,555	201,367	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL	64	419	54,286	食品・飲料・タバコ
AMERICAN AIRLINES GROUP	5	10	1,295	運輸
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRASTRUCTURE	2	8	1,128	公益事業
EMBECTA	2	8	1,068	ヘルスケア機器・サービス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	32	149	19,364	食品・生活必需品小売り
ETSY	5	61	7,983	小売
KRAFT HEINZ	45	192	24,900	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,718 168	80,600 -	10,432,105 <70.6%>
(カナダ)		千カナダドル		
BANK OF MONTREAL	29	428	43,991	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	55	477	48,968	銀行
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	20	299	30,765	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY	19	310	31,902	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR	8	37	3,893	耐久消費財・アパレル
TELUS	38	130	13,374	電気通信サービス
IGM FINANCIAL	3	16	1,651	各種金融
MANULIFE FINANCIAL	88	239	24,554	保険
LOBLAW COMPANIES	7	86	8,922	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL	12	101	10,414	自動車・自動車部品
POWER CORP OF CANADA	27	105	10,835	保険
ROYAL BANK OF CANADA	65	905	92,970	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	21	207	21,326	運輸
LUNDIN MINING	33	46	4,811	素材
TORONTO-DOMINION BANK	83	786	80,732	銀行
BCE	25	189	19,482	電気通信サービス
ALTAGAS	12	39	4,054	公益事業
NUTRIEN	26	373	38,366	素材
THOMSON REUTERS	5	70	7,194	商業・専門サービス
WSP GLOBAL	3	61	6,297	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	589 20	4,914 -	504,512 <3.4%>
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ		
ADIDAS	7	150	20,977	耐久消費財・アパレル
GEA GROUP	5	19	2,774	資本財
DEUTSCHE POST-REG	19	79	11,177	運輸
MERCK	5	106	14,885	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAP	63	617	86,298	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
HENKEL-VORZUG	18	106	14,836	家庭用品・パーソナル用品
BASF	42	219	30,716	素材
BEIERSDORF	4	41	5,831	家庭用品・パーソナル用品
FRESENIUS MEDICAL CARE	9	56	7,915	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ-REG	18	411	57,554	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	13	9	1,315	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-REG	6	153	21,395	保険
SUEDZUCKER	38	48	6,837	食品・飲料・タバコ
LANXESS	3	14	1,975	素材
EVONIK INDUSTRIES AG	21	52	7,337	素材
HUGO BOSS-ORD	2	12	1,732	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK	45	29	4,154	銀行
KION GROUP AG	2	12	1,759	資本財
VONOVIA	28	110	15,385	不動産
METRO	5	4	644	食品・生活必需品小売り
ZALANDO	7	32	4,588	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	368 21	2,290 —	320,095 <2.2%>
(ユーロ…イタリア)				
ASSICURAZIONI GENERALI	50	94	13,178	保険
INTESA SANPAOLO	883	174	24,358	銀行
TELECOM ITALIA	811	24	3,469	電気通信サービス
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	63	51	7,135	公益事業
ITALGAS SPA	20	12	1,784	公益事業
UNICREDIT	100	92	12,985	銀行
POSTE ITALIANE SPA	14	14	1,982	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,943 7	464 —	64,895 <0.4%>
(ユーロ…フランス)				
L'OREAL	11	394	55,168	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	11	709	99,146	耐久消費財・アパレル
CASINO GUICHARD PERRACHON	1	3	436	食品・生活必需品小売り
FAURECIA	5	12	1,712	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD	9	179	25,026	食品・飲料・タバコ
SEB	1	14	2,011	耐久消費財・アパレル
AIR FRANCE-KLM	5	2	328	運輸
ORANGE	108	121	16,950	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	1	141	19,704	耐久消費財・アパレル
KERING	3	164	22,953	耐久消費財・アパレル
CARREFOUR	28	58	8,194	食品・生活必需品小売り
ACCOR	8	26	3,640	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	38	90	12,600	銀行
EURAZEO	1	13	1,873	各種金融
SODEXO	3	24	3,470	消費者サービス
JC DECAUX	2	5	739	メディア・娯楽
BNP PARIBAS	52	259	36,304	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	20	105	14,695	資本財
IPSEN	1	18	2,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGRAND	8	68	9,597	資本財
REXEL	9	18	2,546	資本財
VINCI	17	154	21,534	資本財

銘柄	当 期 末			業 種 等
	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	千ユーロ	千円	
DANONE	29	155	21,672	食品・飲料・タバコ
BUREAU VERITAS	9	23	3,220	商業・専門サービス
EDENRED	7	36	5,109	ソフトウェア・サービス
VALEO	119	203	28,429	自動車・自動車部品
ALD	2	3	455	運輸
WORLDLINE	13	48	6,752	ソフトウェア・サービス
AMUNDI	2	16	2,367	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	537 29	3,072 —	429,267 <2.9%>
(ユーロ…オランダ)				
KPN	204	68	9,554	電気通信サービス
HEINEKEN	10	97	13,582	食品・飲料・タバコ
DSM	7	116	16,232	素材
SBM OFFSHORE	6	9	1,280	エネルギー
NN GROUP	12	58	8,156	保険
SIGNIFY NV	72	279	39,105	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	314 6	629 —	87,911 <0.6%>
(ユーロ…スペイン)				
BANKINTER	29	15	2,152	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	304	154	21,649	銀行
ACCIONA	0.77	15	2,114	公益事業
BANCO SANTANDER	791	250	34,957	銀行
TELEFONICA	292	144	20,226	電気通信サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	140	215	30,164	資本財
ACERINOX	6	6	932	素材
MAPPRE	41	7	1,100	保険
ALMIRALL	3	3	547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMADEUS IT GROUP -A	27	155	21,761	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA	19	37	5,288	公益事業
INDITEX	46	97	13,590	小売
AENA SME	2	35	4,930	運輸
CELLNEX TELECOM	34	157	22,011	電気通信サービス
GRIFOLS	18	30	4,224	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 銘柄 数 < 比 率 >	1,760 15	1,328 —	185,653 <1.3%>
(ユーロ…ベルギー)				
KBC GROEP NV	11	76	10,722	銀行
UCB	5	63	8,925	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 銘柄 数 < 比 率 >	17 2	140 —	19,647 <0.1%>
(ユーロ…オーストリア)				
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	6	7	983	銀行
OESTERREICHISCHE POST	1	3	465	運輸
ANDRITZ	31	120	16,873	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	38 3	131 —	18,323 <0.1%>
(ユーロ…フィンランド)				
ELISA	8	47	6,692	電気通信サービス
NESTE OYJ	265	1,158	161,908	エネルギー
NOKIAN RENKAAT	5	6	966	自動車・自動車部品

銘柄	株数	当期末		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フィンランド)	百株	千ユーロ	千円		
ORION-B	3	13	1,955	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 銘柄数<比率>	282 4	1,227 —	171,522 <1.2%>	
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP-A	7	70	9,897	食品・飲料・タバコ	
ATB GROUP	35	6	967	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	43 2	77 —	10,865 <0.1%>	
(ユーロ…ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS	12	26	3,681	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12 1	26 —	3,681 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,318 90	9,388 —	1,311,863 <8.9%>	
(イギリス)		千英ポンド			
BARRATT DEVELOPMENTS	42	21	3,694	耐久消費財・アパレル	
BALFOUR BEATTY	20	5	919	資本財	
DIAGEO	104	403	68,037	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS	6	20	3,444	各種金融	
ELECTROCOMPONENTS	28	29	4,990	資本財	
HALMA	12	29	5,046	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HSBC HOLDINGS	921	484	81,579	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP	269	73	12,334	保険	
PEARSON	31	24	4,082	メディア・娯楽	
ST JAMES' S PLACE	23	32	5,411	各種金融	
DS SMITH	59	18	3,160	素材	
LLOYDS BANKING GROUP	3,216	145	24,589	銀行	
TAYLOR WIMPEY	151	19	3,369	耐久消費財・アパレル	
GLAXOSMITHKLINE	228	402	67,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP	8	12	2,165	資本財	
ASTRAZENECA	56	595	100,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BARCLAYS	713	103	17,513	銀行	
BURBERRY GROUP	16	27	4,568	耐久消費財・アパレル	
KINGFISHER	87	22	3,835	小売	
ITV	153	11	1,914	メディア・娯楽	
CENTRICA	265	20	3,508	公益事業	
BUNZL	10	32	5,493	資本財	
UNILEVER	119	407	68,717	家庭用品・パーソナル用品	
MONDI	22	31	5,380	素材	
SEVERN TRENT	10	32	5,491	公益事業	
WHITBREAD	8	24	4,147	消費者サービス	
3I GROUP	43	58	9,846	各種金融	
RELX	60	145	24,470	商業・専門サービス	
UNITED UTILITIES GROUP	30	34	5,756	公益事業	
NATWEST GROUP	211	46	7,847	銀行	
SAGE GROUP-NEW	64	46	7,885	ソフトウェア・サービス	
WPP	50	49	8,387	メディア・娯楽	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8	13	2,343	食品・飲料・タバコ	
CONVATEC GROUP	92	20	3,397	ヘルスケア機器・サービス	
COMPASS GROUP	73	122	20,708	消費者サービス	
ROYAL MAIL	26	9	1,523	運輸	

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	千英ポンド	千円	
ABRDN	98	19	3,207	各種金融
VODAFONE GROUP	1,647	214	36,189	電気通信サービス
MAN GROUP	65	15	2,621	各種金融
FERGUSON NEWCO	9	96	16,303	資本財
TESCO	341	92	15,552	食品・生活必需品小売り
INFORMA	63	37	6,387	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING	31	398	67,081	資本財
DIRECT LINE INSURANCE	61	15	2,649	保険
INTERMEDIATE CAPITAL	13	21	3,555	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP	31	189	31,950	家庭用品・パーソナル用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,617 46	4,684 —	789,240 <5.3%>
(スイス)		千スイスフラン		
SGS	0.2	50	6,828	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT	0.16	35	4,851	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN	0.42	159	21,717	素材
ZURICH INSURANCE GROUP	6	305	41,541	保険
ADECCO GROUP	4	18	2,536	商業・専門サービス
HOLCIM	23	104	14,192	素材
CLARIANT	9	14	2,010	素材
NESTLE	128	1,557	211,599	食品・飲料・タバコ
SONOVA HOLDING	2	93	12,669	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING-REG	0.47	59	8,128	ヘルスケア機器・サービス
LOGITECH INTERNATIONAL	10	68	9,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SWISS RE	13	108	14,803	保険
UBS GROUP	165	278	37,810	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	365 13	2,855 —	387,954 <2.6%>
(スウェーデン)		千スウェーデンクローナ		
TELIA AB	143	565	7,671	電気通信サービス
SKANSKA-B	11	225	3,061	資本財
ALFA LAVAL	9	293	3,983	資本財
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6	157	2,134	電気通信サービス
HUSQVARNA-B	21	198	2,695	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	28	1,318	17,895	資本財
ESSITY ARTIEBOLAG-B	28	662	8,993	家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-A	28	556	7,548	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	700	7,197	97,670	資本財
KINNEVIK AB - B	11	265	3,601	各種金融
ELECTROLUX AB-B	10	157	2,138	耐久消費財・アパレル
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77	719	9,758	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,075 12	12,317 —	167,151 <1.1%>
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ		
TELENOR	39	512	7,503	電気通信サービス
SCHIBSTED	8	173	2,545	メディア・娯楽
STOREBRAND	19	164	2,405	保険
YARA INTERNATIONAL	7	364	5,341	素材
MOWI ASA	19	485	7,108	食品・飲料・タバコ
ORKLA	34	266	3,906	食品・飲料・タバコ



銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)	百株	千ノルウェークローネ	千円	
DNB BANK	45	883	12,947	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	173 7	2,850 —	41,758 <0.3%>
(デンマーク)		千デンマーククローネ		
CARLSBERG-B	5	434	8,159	食品・飲料・タバコ
H LUNDBECK	9	155	2,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHR HANSEN HOLDING	4	251	4,728	素材
NOVOZYMES-B	9	436	8,191	素材
NOVO NORDISK-B	73	5,817	109,261	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS	5	66	1,245	商業・専門サービス
VESTAS WIND SYSTEMS	631	12,834	241,024	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	739 7	19,996 —	375,536 <2.5%>
(オーストラリア)		千オーストラリアドル		
AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP	26	72	6,930	銀行
TELSTRA	721	290	27,825	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP	87	120	11,560	運輸
ORICA	18	30	2,900	素材
WOOLWORTHS GROUP	58	224	21,467	食品・生活必需品小売り
BRAMBLES	66	65	6,313	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP	3	68	6,552	各種金融
MEDIBANK PRIVATE	18	6	574	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,000 8	878 —	84,125 <0.6%>
(ニュージーランド)		千ニュージーランドドル		
MERIDIAN ENERGY	117	56	4,975	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	117 1	56 —	4,975 <0.0%>
(香港)		千香港ドル		
SWIRE PACIFIC-A	27	125	2,067	不動産
AIA GROUP	554	4,345	71,693	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	582 2	4,470 —	73,761 <0.5%>
(シンガポール)		千シンガポールドル		
DBS GROUP HOLDINGS	83	276	26,108	銀行
CITY DEVELOPMENTS	21	17	1,701	不動産
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	461	118	11,254	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL	86	39	3,724	食品・飲料・タバコ
KEPPEL	65	43	4,102	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	719 5	495 —	46,890 <0.3%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,016 379	— —	14,219,876 <96.2%>

(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仲値により邦貨換算したものです。

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 株数および評価額の単位未満は切捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載しています。

(注) 業種はG I C S (世界産業分類基準) に準じています。

(注) 期中に銘柄コード等の変更があった場合は、当該銘柄は期首とは別銘柄として記載しています。

(注) 一印は組み入れはありません。

## 外国投資信託証券

銘	柄	当 期 末			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	千米ドル	千円	%
AVALONBAY COMMUNITIES		635	156	20,293	0.1
KIMCO REALTY		1,889	48	6,307	0.0
KILROY REALTY		510	38	4,944	0.0
HOST HOTELS & RESORTS		3,196	65	8,451	0.1
SIMON PROPERTY GROUP		1,495	196	25,410	0.2
VENTAS		1,713	103	13,426	0.1
DIGITAL REALTY TRUST		1,289	193	25,083	0.2
PROLOGIS		3,368	571	73,914	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES		2,465	85	11,125	0.1
SL GREEN REALTY		306	22	2,961	0.0
WELLTOWER		1,912	185	23,950	0.2
小 計		口 数 ・ 金 額	18,778	1,667	215,869
		銘 柄 数 < 比 率 >	11	—	<1.5%>
(ユーロ…フランス)			千ユーロ		
ICADE		201	11	1,673	0.0
KLEPIERRE		992	22	3,204	0.0
GECINA		338	37	5,180	0.0
COVIVIO		314	22	3,174	0.0
ユ ー ロ 計		口 数 ・ 金 額	1,845	94	13,233
		銘 柄 数 < 比 率 >	4	—	<0.1%>
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND		3,811	19	3,290	0.0
DERWENT LONDON PLC		478	15	2,545	0.0
LAND SECURITIES GROUP		3,326	25	4,243	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	7,615	59	10,078
		銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
DEXUS		4,920	53	5,091	0.0
SCENTRE GROUP		21,435	63	6,114	0.0
VICINITY CENTRES		17,634	33	3,165	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	43,989	150	14,371
		銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<0.1%>
合 計		口 数 ・ 金 額	72,227	—	253,553
		銘 柄 数 < 比 率 >	21	—	<1.7%>

(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。

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 口数および評価額の単位未満は切捨てています。

## ○投資信託財産の構成

(2022年4月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	14,219,876	96.1
投資証券	253,553	1.7
コール・ローン等、その他	321,521	2.2
投資信託財産総額	14,794,950	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てています。

(注) 当期末における外貨建純資産 (14,786,258千円) の投資信託財産総額 (14,794,950千円) に対する比率は99.9%です。

(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。なお、2022年4月20日における邦貨換算レートは、1米ドル=129.43円、1カナダドル=102.65円、1ユーロ=139.73円、1英ポンド=168.49円、1スイスフラン=135.86円、1スウェーデンクローナ=13.57円、1ノルウェークローネ=14.65円、1デンマーククローネ=18.78円、1オーストラリアドル=95.73円、1ニュージーランドドル=87.37円、1香港ドル=16.50円、1シンガポールドル=94.58円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,817,400,334
コール・ローン等	291,652,291
株式(評価額)	14,219,876,418
投資証券(評価額)	253,553,609
未収入金	38,912,032
未収配当金	13,405,984
(B) 負債	38,136,026
未払金	22,859,150
未払解約金	15,276,853
未払利息	23
(C) 純資産総額(A-B)	14,779,264,308
元本	12,510,659,863
次期繰越損益金	2,268,604,445
(D) 受益権総口数	12,510,659,863口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,813円

&lt;注記事項&gt;

(貸借対照表関係)

1. 設定時元本額	3,704,290,000円
期中追加設定元本額	9,376,159,603円
期中一部解約元本額	569,789,740円
2. 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額	
インベスコ グローバルESGインサイト・インデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	12,510,659,863円
合計	12,510,659,863円

## ○損益の状況 (2021年7月14日~2022年4月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	121,469,302
受取配当金	121,515,041
支払利息	△ 45,739
(B) 有価証券売買損益	1,923,119,508
売買益	2,867,001,006
売買損	△ 943,881,498
(C) 保管費用等	△ 61,313,691
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,983,275,119
(E) 追加信託差損益金	354,062,401
(F) 解約差損益金	△ 68,733,075
(G) 計(D+E+F)	2,268,604,445
次期繰越損益金(G)	2,268,604,445

(注) (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) (C) 保管費用等は、外貨建資産の保管に係る費用等です。

(注) (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) (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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	信託期間は2010年6月14日から無期限です。	
運用方針	主として、「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	短期金融資産 マザーファンド	わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)	外貨建資産への投資は行いません。
	短期金融資産 マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。</p> <p>(1) 分配対象額の範囲 経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>(2) 分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。</p>	

## FOFs用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)

### 運用報告書(全体版)

第11期(決算日 2021年9月27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			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 配 分	期 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
第 7 期 (2017年9月25日)	9,941	0	△0.2	3.9	—	6
第 8 期 (2018年9月25日)	9,920	0	△0.2	3.7	—	9
第 9 期 (2019年9月25日)	9,897	0	△0.2	—	—	115
第10期 (2020年9月25日)	9,879	0	△0.2	—	—	15
第11期 (2021年9月27日)	9,860	0	△0.2	—	—	13

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 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) 2020年 9月25日	円	%	%	%
9月末	9,879	—	—	—
10月末	9,877	0.0	—	—
11月末	9,875	△0.0	—	—
12月末	9,874	△0.1	—	—
2021年 1月末	9,873	△0.1	—	—
2月末	9,872	△0.1	—	—
3月末	9,869	△0.1	—	—
4月末	9,868	△0.1	—	—
5月末	9,867	△0.1	—	—
6月末	9,865	△0.1	—	—
7月末	9,864	△0.2	—	—
8月末	9,861	△0.2	—	—
(当 期 末) 2021年 9月27日	9,860	△0.2	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

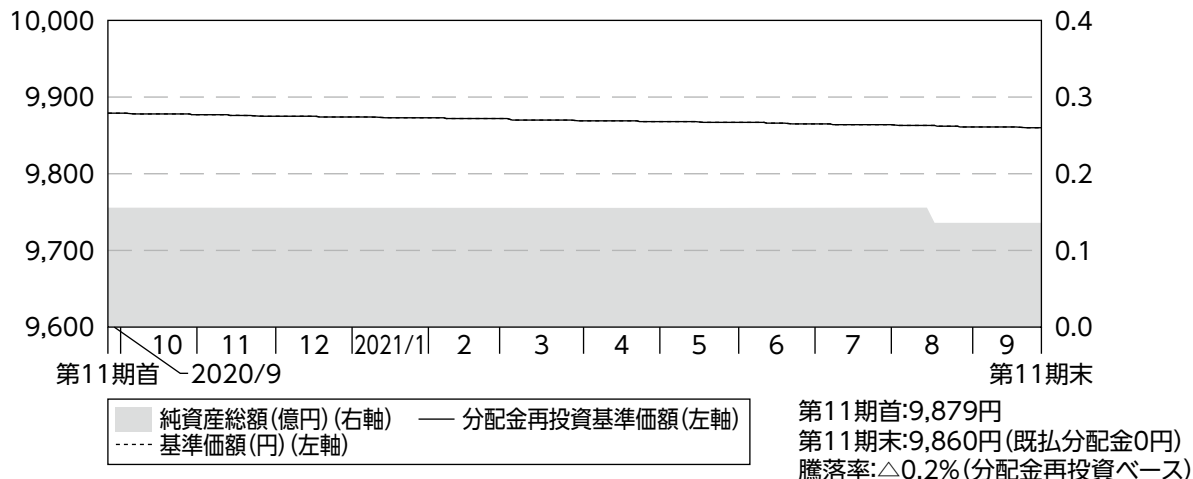
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 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。

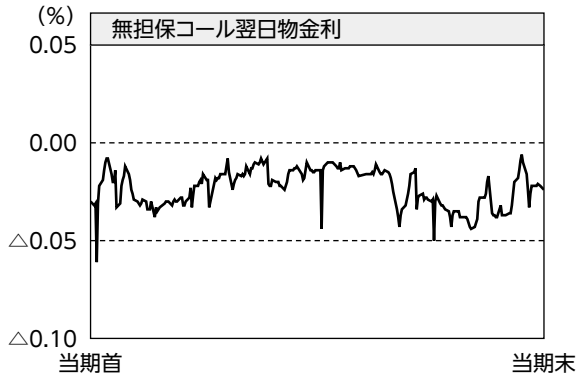
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2020年9月25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

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.06~0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行いました。マイナス利回りや信託報酬などの要因により、基準価額(分配金再投資ベース)は小幅に下落しました。

## 投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に $\Delta 0.1\%$ のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.06\sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象である「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れ、これを維持しました。

### 【「短期金融資産 マザーファンド」の運用経過】

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。



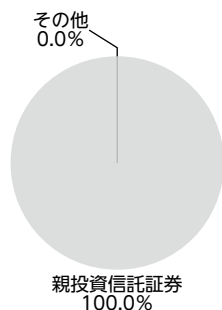
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

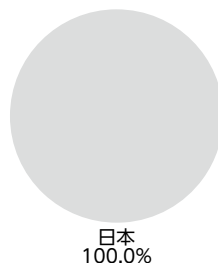
	当期末
	2021年9月27日
短期金融資産 マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

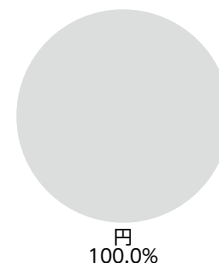
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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11期	
	2020年9月26日～2021年9月27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)	483

(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、短期金融資産 マザーファンドの受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年9月26日~2021年9月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.144%	(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9,870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)	(11)	(0.111)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(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)	(—)	(—)	
(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)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(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)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(公社債)	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(d) その他費用	1	0.005	(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)	(—)	(—)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.149	

(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。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 39	千円 39	千口 1,988	千円 2,012

## 利害関係人<sup>\*</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3	0.023493	0.8	3	0.023493	0.8

(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。

### <短期金融資産 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 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0	百万円 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,302,445	22,548	0.7	3,301,709	22,548	0.7

<平均保有割合 0.1%>

(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。

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

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 15,377	千口 13,428	千円 13,589

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,965,821千口です。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
短期金融資産 マザーファンド	千円 13,589	% 99.9
コール・ローン等、その他	19	0.1
投資信託財産総額	13,608	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 2021年9月27日現在
(A)資 産	13,608,104円
コール・ローン等	18,240
短期金融資産 マザーファンド(評価額)	13,589,758
未 収 入 金	106
(B)負 債	11,718
未 払 信 託 報 酬	10,936
そ の 他 未 払 費 用	782
(C)純 資 産 総 額(A-B)	13,596,386
元 本	13,789,186
次 期 繰 越 損 益 金	△192,800
(D)受 益 権 総 口 数	13,789,186口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,860円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年9月26日 至 2021年9月27日
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	△2,946円
売 買 益	197
売 買 損	△3,143
(B)信 託 報 酬 等	△22,679
(C)当 期 損 益 金(A+B)	△25,625
(D)前 期 繰 越 損 益 金	△49,277
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
(F) 計 (C+D+E)	△192,800
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△192,800
追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
分 配 準 備 積 立 金	11,111
繰 越 損 益 金	△86,013

(注1) (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) (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) (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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は15,767,297円、期中追加設定元本額は40,550円、期中一部解約元本額は2,018,661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)	－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)	－円
(C) 収益調整金額	654,973円
(D) 分配準備積立金額	11,111円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	666,084円
(F) 期末残存口数	13,789,186口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	483円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 短期金融資産 マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日 2021年9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2007年9月26日から無期限です。
運用方針	わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の短期金融資産等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		参考指数		債券先物率 債組入比率	純資産額
	円 騰落率	% 騰落率	10,000 騰落率	% 騰落率		
第10期(2017年9月25日)	10,146	△0.1	10,111	△0.0	3.9	7,717
第11期(2018年9月25日)	10,138	△0.1	10,106	△0.1	3.7	8,170
第12期(2019年9月25日)	10,129	△0.1	10,100	△0.1	—	8,839
第13期(2020年9月25日)	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	9,348
第14期(2021年9月27日)	10,120	△0.0	10,093	△0.0	—	10,085

(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。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券先物率 債組入比率
	円 騰落率	% 騰落率	10,000 騰落率	% 騰落率	
(当期首) 2020年 9月25日	10,124	—	10,096	—	—
9月末	10,124	0.0	10,096	△0.0	—
10月末	10,124	0.0	10,096	△0.0	—
11月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—
12月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—
2021年 1月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—
2月末	10,123	△0.0	10,095	△0.0	—
3月末	10,122	△0.0	10,095	△0.0	—
4月末	10,122	△0.0	10,095	△0.0	—
5月末	10,122	△0.0	10,094	△0.0	—
6月末	10,121	△0.0	10,094	△0.0	—
7月末	10,121	△0.0	10,094	△0.0	—
8月末	10,120	△0.0	10,094	△0.0	—
(当期末) 2021年 9月27日	10,120	△0.0	10,093	△0.0	—

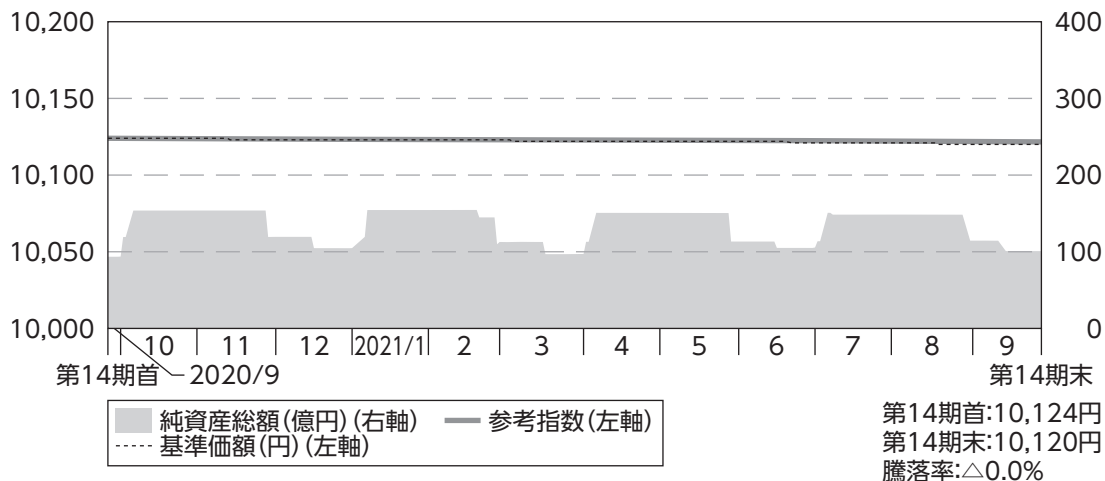
(注1)騰落率は期首比です。

(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。

参考指数は、無担保コール翌日物金利の累積投資収益率で、設定日を10,000として指数化しております。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

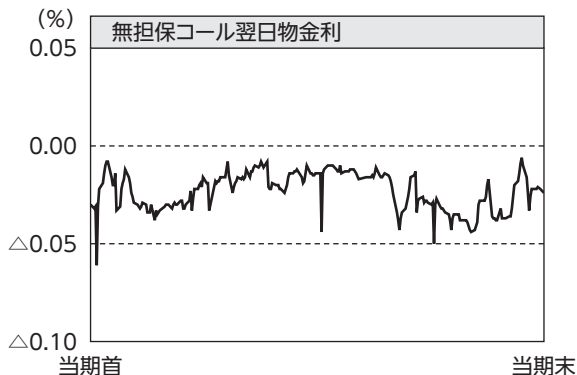


(注)参考指数は、2020年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.06~0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、基準価額は横ばい推移となりました。

## 投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に $\Delta 0.1\%$ のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.06\sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。

## 当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

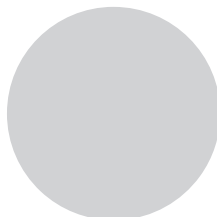
当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



短期金融資産等  
100.0%

○国別配分



日本  
100.0%

○通貨別配分



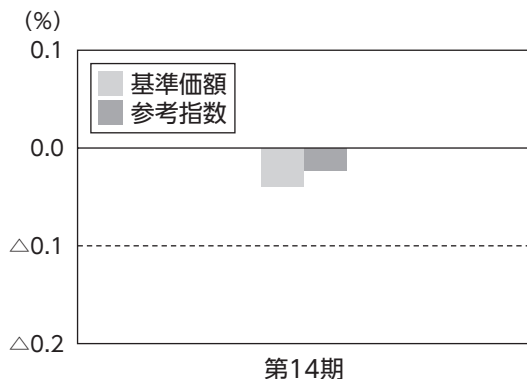
円  
100.0%

(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

わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年9月26日~2021年9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)	-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)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (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	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(10,122円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

## 利害関係人<sup>\*</sup>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 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0	百万円 0.790290	百万円 0.790290	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	3,302,445	22,548	0.7	3,301,709	22,548	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。

## 組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 10,085,508	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,085,508	100.0

\* 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。

## 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 2021年9月27日現在
(A)資 産	10,085,508,259円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,085,508,259
(B)負 債	12,402
未 払 解 約 金	106
未 払 利 息	12,296
(C)純 資 産 総 額(A-B)	10,085,495,857
元 本	9,965,821,749
次 期 繰 越 損 益 金	119,674,108
(D)受 益 権 総 口 数	9,965,821,749口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,120円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年9月26日 至 2021年9月27日
(A)配 当 等 収 益	△4,960,031円
受 取 利 息	66,389
支 払 利 息	△5,026,420
(B)そ の 他 費 用	△2
(C)当 期 損 益 金(A+B)	△4,960,033
(D)前 期 繰 越 損 益 金	114,414,146
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	263,706,182
(F)解 約 差 損 益 金	△253,486,187
(G)計 (C+D+E+F)	119,674,108
次 期 繰 越 損 益 金(G)	119,674,108

(注1) (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2) (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。

## &lt;注記事項&gt;

※当ファンドの期首元本額は9,234,430,779円、期中追加設定元本額は21,516,767,055円、期中一部解約元本額は20,785,376,085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。

バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	6,760,615,573円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,021,200,271円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	105,165,876円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,015,983円
FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,428,615円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,616,084円
米国成長株式ファンド	493,486円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
北米株配当戦略投信2018-08(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,882円

## お知らせ

---

該当事項はありません。