

SOMPO123 先進国株式

第1期（決算日 2022年12月21日）

■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	
信託期間	無制限	
運用方針	<p>①先進国株式マザーファンド(以下「親投資信託」といいます。) 受益証券を通じて、主として、日本を除く先進国の金融商品取引所に上場している株式 (DR (預託証券) 等を含みます。以下同じ。) に分散投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>②親投資信託の組入比率は、原則として高位を基本とします。</p> <p>③実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p>	
主要投資対象	SOMPO123 先進国株式	先進国株式マザーファンド受益証券
	先進国株式マザーファンド	日本を除く先進国の株式
主な組入制限	SOMPO123 先進国株式	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。</p>
	先進国株式マザーファンド	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

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。さて、「SOMPO123 先進国株式」は、このたび第1期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。今後とも引続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

(受付時間 営業日の午前9時～午後5時)

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ インデックス(配当込み)		株式 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円				%	%	%	百万円
2021年12月21日	10,000	—	—	5,199.26	—	—	—	400
1期(2022年12月21日)	9,983	0	△0.2	5,147.65	△1.0	89.6	2.4	1,569

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり(以下同じ)。

(注3) 株式組入比率及び投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 参考指数はMSCIコクサイインデックス(配当込み)です。なお、各基準日の参考指数は、基準価額の算出方法に合わせて、各基準日の前営業日の参考指数を各基準日の為替レート(対顧客電信売買相場の仲値)を用いて委託会社が独自に換算したものを使用しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIコクサイ インデックス(配当込み)		株式 組入比率	投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(設定日)		%		%	%	%
2021年12月21日	10,000	—	5,199.26	—	—	—
12月末	10,373	3.7	5,516.94	6.1	95.3	2.3
2022年1月末	9,881	△1.2	5,131.83	△1.3	94.3	2.3
2月末	9,784	△2.2	5,101.70	△1.9	90.7	2.5
3月末	10,729	7.3	5,642.71	8.5	91.9	2.4
4月末	10,303	3.0	5,398.53	3.8	91.4	2.5
5月末	10,315	3.2	5,392.14	3.7	94.8	2.5
6月末	10,130	1.3	5,265.96	1.3	93.2	2.4
7月末	10,475	4.8	5,466.03	5.1	94.8	2.5
8月末	10,549	5.5	5,506.37	5.9	92.2	2.4
9月末	10,049	0.5	5,232.07	0.6	89.5	2.1
10月末	10,942	9.4	5,741.50	10.4	89.5	2.0
11月末	10,712	7.1	5,577.08	7.3	91.2	2.3
(期末)						
2022年12月21日	9,983	△0.2	5,147.65	△1.0	89.6	2.4

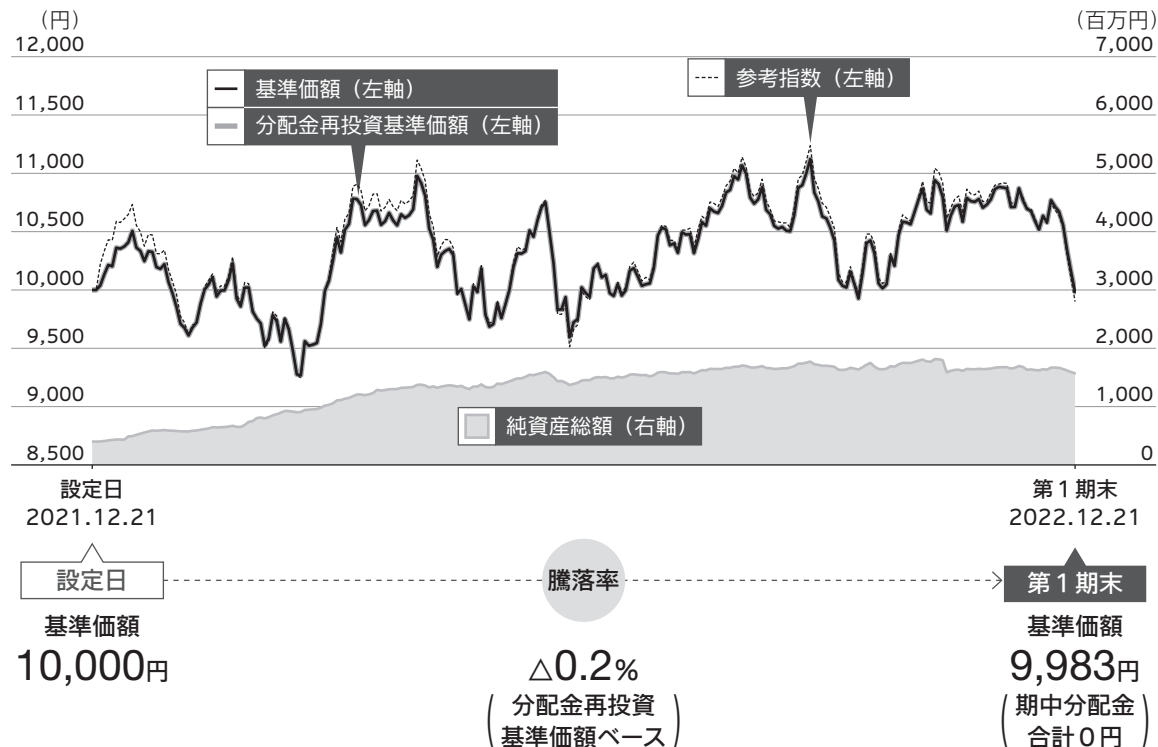
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。

(注2) 株式組入比率及び投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 参考指数はMSCIコクサイインデックス(配当込み)です。なお、各基準日の参考指数は、基準価額の算出方法に合わせて、各基準日の前営業日の参考指数を各基準日の為替レート(対顧客電信売買相場の仲値)を用いて委託会社が独自に換算したものを使用しております。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額および参考指数（MSCIコクサイ インデックス（配当込み））の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 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。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

● 基準価額の主な変動要因

SOMPO123 先進国株式

当期は、投資している先進国株式マザーファンドの基準価額が下落したことにより、当ファンドの基準価額も下落しました。

先進国株式マザーファンド

期中の騰落率は－0.2%となりました。

外国株式市場は現地通貨ベースで大きく下落したものの、為替市場は主要通貨に対して円安に進んだため、当ファンドの基準価額は小幅な下落に留まりました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

○外国株式市場

当期の外国株式市場は円建てベースで小幅に下落しました。

新型コロナウイルスのワクチン接種と治療薬の普及などを背景に世界的に経済活動の再開が進んだものの、ロシアによるウクライナ侵攻を受けた経済制裁や物流の混乱などで物価高が期を通して進行了。物価高への対応のため、欧米の中央銀行を中心に金融緩和から引き締めへと急激に舵を切ったことが嫌気され、各国の株価は現地通貨ベースで大幅に下落しました。

他方、2022年12月の会合で日本銀行も金融政策の修正を行ったものの、期を通して見ると金融引き締めを進める欧米諸国と緩和姿勢を維持する日本との方向性の違いから、日本と欧米諸国との間で金利差が拡大したことにより為替市場では円安が進み、円建てベースの株価は小幅な下落に留まりました。

○為替市場

当期の米ドル円市場は円安ドル高となりました。米国の政策金利引き上げが開始された2022年3月以降、日米間の金利差が拡大したことなどを背景に一時150円台まで円安ドル高が進みましたが、日本銀行による金融政策の修正などを背景に、期末には132円近傍となりました。

当期のユーロ円相場は、双方の通貨で対ドルでの減価が進んだ一方、ECB（欧州中央銀行）も2022年7月より政策金利の引き上げに踏み切り、金融政策の方向性に違いが見られたことなどから、円安ユーロ高が進みました。

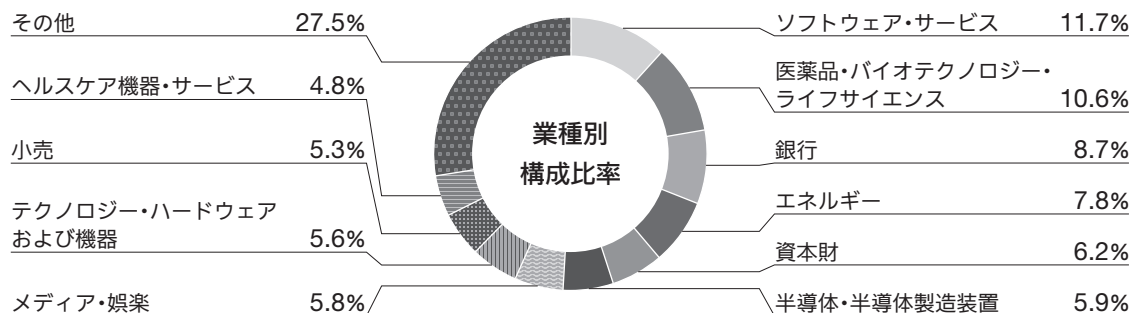
● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通して先進国株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

先進国株式マザーファンド

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。

当ファンドの運用方針に基づき、日本を除く先進国の主要企業の中から123銘柄程度に分散投資したポートフォリオを構築しました。



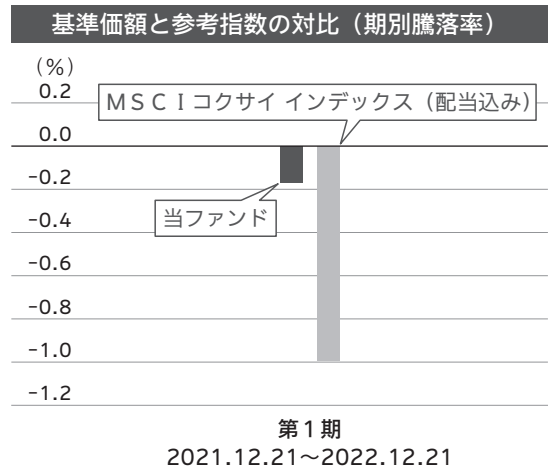
注1．業種別構成比率は、第1期末における外国株式の評価総額に対する比率。

注2．端数処理の関係上、構成比合計が100%にならない場合があります。

● 当該投資信託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。

なお、当期における参考指数との対比では、騰落率は、参考指数（MSCIコクサイインデックス（配当込み））の騰落率（-1.0%）を0.8%上回りました。



先進国株式マザーファンド

マザー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。

なお、当期における参考指数との対比では、騰落率は、参考指数（MSCIコクサイインデックス（配当込み））の騰落率（-1.0%）を0.8%上回りました。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第1期 2021.12.21~2022.12.21
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	181

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. 円未満は切り捨てており、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。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

● 今後の運用方針

SOMPO123 先進国株式

今後の運用においても、マザーファンド受益証券の組入水準を高位に維持することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。

先進国株式マザーファンド

今後の運用においても、日本を除く先進国の主要企業の株式への分散投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

項目	第1期 2021.12.21~2022.12.21		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	8円	0.077%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,353円です。
(投信会社)	(3)	(0.033)	ファンドの運用の対価
(販売会社)	(3)	(0.024)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.020)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	10	0.097	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(10)	(0.096)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	5	0.051	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(5)	(0.051)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	29	0.282	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(保管費用)	(27)	(0.265)	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
(監査費用)	(2)	(0.015)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.002)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	52	0.507	

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、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

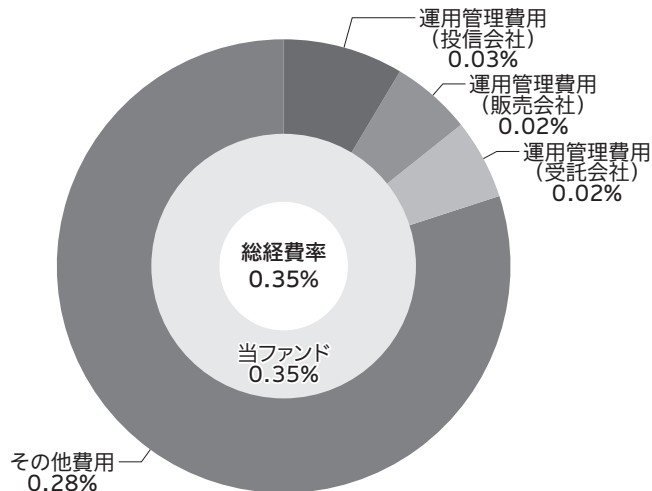
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

○総経費率

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0.35%**です。



注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 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12月21日～2022年12月21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
先進国株式マザーファンド	千口 1,865,588	千円 1,893,260	千口 309,144	千円 325,280

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2021年12月21日～2022年12月21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
	先進国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,848,607千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,212,181千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.52

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末（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により、邦貨換算したものです。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月21日～2022年12月21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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年12月21日～2022年12月21日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取 引 理 由
万円 10,000	万円 -	万円 -	万円 10,000	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2022年12月21日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
先進国株式マザーファンド		1,556,443	1,553,642

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券はありません。

○投資信託財産の構成

(2022年12月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国株式マザーファンド	1,553,642	98.7
コール・ローン等、その他	21,028	1.3
投資信託財産総額	1,574,670	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 先進国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(1,450,915千円)の投資信託財産総額(1,553,674千円)に対する比率は、93.4%です。

(注3) 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、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=131.78円、1カナダ・ドル=96.90円、1ユーロ=139.92円、1イギリス・ポンド=160.56円、1スイス・フラン=142.16円、1デンマーク・クローネ=18.81円、1オーストラリア・ドル=88.06円、1香港・ドル=16.92円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年12月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,574,670,330
コール・ローン等	21,028,057
先進国株式マザーファンド(評価額)	1,553,642,273
(B) 負債	5,058,466
未払解約金	4,298,607
未払信託報酬	637,001
未払利息	63
その他未払費用	122,795
(C) 純資産総額(A-B)	1,569,611,864
元本	1,572,270,438
次期繰越損益金	△ 2,658,574
(D) 受益権総口数	1,572,270,438口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,983円

(注1) 信託財産に係る期首元本額400,000,000円、期中追加設定元本額1,969,534,291円、期中一部解約元本額797,263,853円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 0.9983円

(注3) 期末における元本の欠損金額 2,658,574円

○損益の状況 (2021年12月21日～2022年12月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 16,301
支払利息	△ 16,301
(B) 有価証券売買損益	△41,076,506
売買益	16,575,556
売買損	△57,652,062
(C) 信託報酬等	△ 1,231,524
(D) 当期損益金(A+B+C)	△42,324,331
(E) 追加信託差損益金	39,665,757
(配当等相当額)	(△ 8,574)
(売買損益相当額)	(39,674,331)
(F) 計(D+E)	△ 2,658,574
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 2,658,574
追加信託差損益金	39,665,757
(配当等相当額)	(3,150,572)
(売買損益相当額)	(36,515,185)
分配準備積立金	25,437,830
繰越損益金	△67,762,161

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

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

(注4) 分配金の計算過程 (2021年12月21日～2022年12月21日) は以下の通りです。

項 目	2021年12月21日～ 2022年12月21日
a. 配当等収益(費用控除後)	25,437,830円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	3,150,572円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	28,588,402円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	181円
g. 分配金	0円

先進国株式マザーファンド

運用報告書

第 1 期（決算日 2022年12月21日）

< 計算期間 2021年12月21日～2022年12月21日 >

先進国株式マザーファンドの第 1 期の運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。
主要投資対象	日本を除く先進国の株式
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		M S C I コクサイ インデックス(配当込み) (参考指数)		株 組 入 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額 総
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2021年12月21日	10,000	—	5,199.26	—	—	—	396
1期(2022年12月21日)	9,982	△0.2	5,147.65	△1.0	90.5	2.4	1,553

(注1) 基準価額は1万口当たり（以下同じ）。

(注2) 参考指数はMSCIコクサイインデックス（配当込み）です。なお、各基準日の参考指数は、基準価額の算出方法に合わせて、各基準日の前営業日の参考指数を各基準日の為替レート（対顧客電信売買相場の仲値）を用いて委託会社が独自に換算したものを使用しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	M S C I コクサイ インデックス(配当込み) (参考指数)		株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 組 入 比	券 率
			(参考指数)	騰 落 率				
(設定日) 2021年12月21日	円 10,000	% —	5,199.26	% —	% —	% —	% —	% —
12月末	10,380	3.8	5,516.94	6.1	96.3		2.4	
2022年1月末	9,875	△1.3	5,131.83	△ 1.3	95.2		2.3	
2月末	9,777	△2.2	5,101.70	△ 1.9	91.6		2.5	
3月末	10,732	7.3	5,642.71	8.5	92.8		2.4	
4月末	10,298	3.0	5,398.53	3.8	92.3		2.5	
5月末	10,310	3.1	5,392.14	3.7	95.8		2.5	
6月末	10,127	1.3	5,265.96	1.3	94.3		2.4	
7月末	10,479	4.8	5,466.03	5.1	95.9		2.6	
8月末	10,554	5.5	5,506.37	5.9	93.1		2.4	
9月末	10,048	0.5	5,232.07	0.6	90.6		2.1	
10月末	10,952	9.5	5,741.50	10.4	90.3		2.0	
11月末	10,720	7.2	5,577.08	7.3	92.1		2.3	
(期 末) 2022年12月21日	9,982	△0.2	5,147.65	△ 1.0	90.5		2.4	

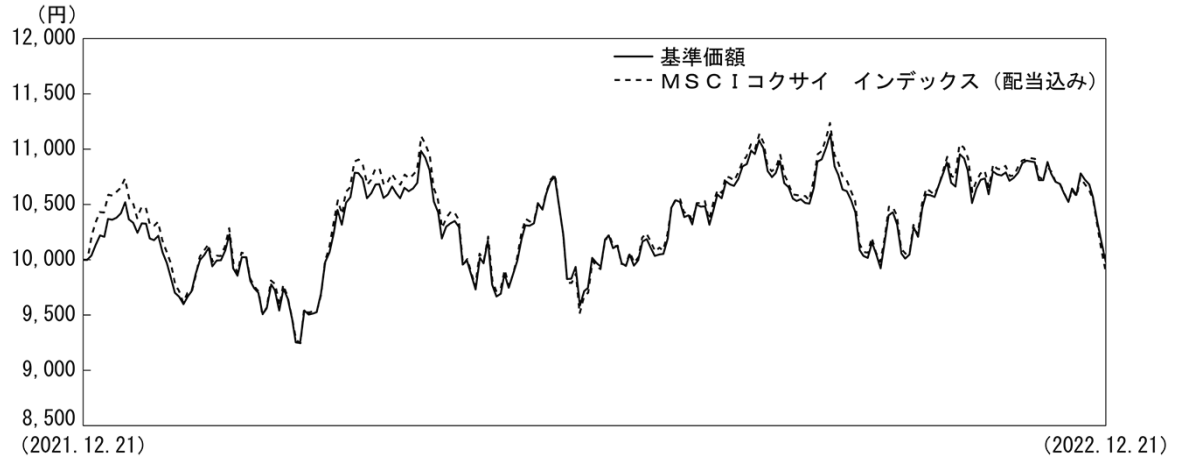
(注1) 騰落率は設定日比。

(注2) 参考指数はMSCIコクサイインデックス(配当込み)です。なお、各基準日の参考指数は、基準価額の算出方法に合わせて、各基準日の前営業日の参考指数を各基準日の為替レート(対顧客電信売買相場の仲値)を用いて委託会社が独自に換算したものを使用しております。

○運用経過

(2021年12月21日～2022年12月21日)

■基準価額の推移



設定日：10,000円

期末：9,982円

騰落率：△0.2%

・参考指数 (MSCIコクサイ インデックス (配当込み)) の推移は、2021年12月21日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しています。

P 2 ～ P 7 をご参照下さい。

○1万口当たりの費用明細

(2021年12月21日～2022年12月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 10 (10) (0)	% 0.098 (0.097) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 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) (投 資 信 託 証 券)	5 (5) (0)	0.051 (0.051) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 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) (そ の 他)	28 (28) (0)	0.269 (0.268) (0.001)	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	43	0.418	
期中の平均基準価額は10,354円です。			

(注1) 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2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2021年12月21日～2022年12月21日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外	アメリカ	百株 696 (94)	千アメリカ・ドル 10,136 (438)	百株 91 (32)	千アメリカ・ドル 976 (438)
	カナダ	71	千カナダ・ドル 500	—	千カナダ・ドル —
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	59	505	8	80
	フランス	74 (0.51)	592 (—)	26	92
	オランダ	2	158	0.55	28
	スペイン	44	48	—	—
	ベルギー	7	39	3	16
	イギリス	372 (20)	千イギリス・ポンド 507 (—)	64	千イギリス・ポンド 73
	スイス	17 (—)	千スイス・フラン 301 (△ 0.174)	2	千スイス・フラン 35
国	デンマーク	12	千デンマーク・クローネ 850	2	千デンマーク・クローネ 199
	オーストラリア	135 (6)	千オーストラリア・ドル 543 (—)	28	千オーストラリア・ドル 102
	香港	56	千香港・ドル 445	—	千香港・ドル —

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) () 内は、株式分割、株式転換、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	アメリカ		千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル
	PROLOGIS INC	1,070	154	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	460	112	50	11
国	CROWN CASTLE INC	590	101	—	—
小計		2,120	368	50	11

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2021年12月21日～2022年12月21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	1,848,607千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,212,181千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.52

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末(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により、邦貨換算したものです。

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月21日～2022年12月21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12月21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	千アメリカ・ドル	千円		
INTL BUSINESS MACHINES CO	3	45	5,957	ソフトウェア・サービス	
HONEYWELL INTERNATIONAL I	3	80	10,590	資本財	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	5	81	10,752	各種金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3	87	11,571	ソフトウェア・サービス	
BECTON DICKINSON AND COMPANY	3	84	11,167	ヘルスケア機器・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS	6	23	3,070	電気通信サービス	
BOEING COMPANY	4	82	10,917	資本財	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8	61	8,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CATERPILLAR INC	4	103	13,634	資本財	
JP MORGAN CHASE & CO	10	131	17,394	銀行	
COCA-COLA COMPANY	5	32	4,219	食品・飲料・タバコ	
TARGET CORP	4	70	9,249	小売	
DEERE & COMPANY	2	91	12,048	資本財	
MORGAN STANLEY	10	90	11,895	各種金融	
THE WALT DISNEY CO.	13	115	15,251	メディア・娯楽	
BANK OF AMERICA CORP	31	100	13,277	銀行	
CITIGROUP INC	14	61	8,082	銀行	
SALESFORCE INC	8	104	13,710	ソフトウェア・サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES INC	3	73	9,708	家庭用品・パーソナル用品	
EXXON MOBIL CORP	21	231	30,509	エネルギー	
NEXTERA ENERGY INC	11	96	12,767	公益事業	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2	96	12,711	各種金融	
HOME DEPOT INC	3	113	14,936	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	千アメリカ・ドル	千円	
JOHNSON & JOHNSON	3	59	7,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED PARCEL SERVICE-CLB	2	46	6,177	運輸
LOCKHEED MARTIN CORPORAT	0.8	38	5,125	資本財
LOWE'S COMPANIES INC	3	78	10,323	小売
DOMINION RESOURCE INC/VA	7	45	5,967	公益事業
MCDONALD'S CORPORATION	2	66	8,804	消費者サービス
MARSH&MCLENNAN COS	5	87	11,513	保険
MEDTRONIC INC	7	59	7,883	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORPORATION	5	52	6,885	ヘルスケア機器・サービス
3M CO	4	59	7,800	資本財
NIKE INC -CL B	9	102	13,465	耐久消費財・アパレル
WELLS FARGO COMPANY	17	70	9,234	銀行
PEPSICO INC	1	23	3,104	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	16	83	10,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALTRIA GROUP INC	2	9	1,285	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5	84	11,193	銀行
PROCTER & GAMBLE CO	2	43	5,750	家庭用品・パーソナル用品
US BANCORP	11	47	6,243	銀行
SOUTHERN CO/THE	6	42	5,584	公益事業
AT&T INC	24	44	5,834	電気通信サービス
CHEVRON CORP	9	160	21,161	エネルギー
STRYKER CORPORATION	5	128	16,979	ヘルスケア機器・サービス
UNION PACIFIC CORP	2	55	7,308	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	10	105	13,843	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	2	135	17,823	ヘルスケア機器・サービス
WAL-MART STORES INC	2	28	3,796	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	5	88	11,644	商業・専門サービス
TJX COMPANIES INC	10	77	10,224	小売
ALPHABET INC-CL A	34	308	40,589	メディア・娯楽
Philip Morris International	1	13	1,728	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	5	106	14,072	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	1	40	5,375	保険
ACCENTURE PLC-CL A	4	104	13,805	ソフトウェア・サービス
MERCK & CO. INC.	7	81	10,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBVIE INC	6	96	12,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	6	94	12,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANTHEM INC	1	55	7,315	ヘルスケア機器・サービス
S&P GLOBAL INC	3	102	13,567	各種金融
LINDE PUBLIC LIMITED	4	131	17,338	素材
AMAZON.COM INC	26	229	30,198	小売
ADOBE SYSTEMS INC	3	101	13,371	ソフトウェア・サービス
AMGEN INC	2	52	6,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	22	78	10,293	メディア・娯楽
APPLE INC	40	535	70,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	8	82	10,911	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	13	64	8,552	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GILEAD SCIENCES INC	7	64	8,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	10	173	22,892	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	3	123	16,323	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	16	43	5,714	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	19	459	60,542	ソフトウェア・サービス
ORACLE CORPORATION	6	52	6,933	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	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COSTCO WHOLESALE CORP	1	86	11,462	食品・生活必需品小売り
QUALCOMM INCORPORATED	4	53	7,090	半導体・半導体製造装置
BOOKING HOLDINGS INC	0.4	78	10,323	消費者サービス
STARBUCKS CORP	9	90	11,881	消費者サービス
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	3	51	6,785	半導体・半導体製造装置
CME GROUP INC	2	43	5,796	各種金融
META PLATFORMS INC-CLASS A	9	112	14,812	メディア・娯楽
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3	21	2,863	食品・飲料・タバコ
BROADCOM INC	2	108	14,338	半導体・半導体製造装置
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	667 84	7,831 —	1,032,094 <66.4%>
(カナダ)		千カナダ・ドル		
ENBRIDGE INC	56	293	28,450	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA	15	191	18,532	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	71 2	484 —	46,982 <3.0%>
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ		
SAP SE	6	61	8,565	ソフトウェア・サービス
BASF AG	16	76	10,701	素材
ALLIANZ AG-REG	1	38	5,428	保険
MERCEDES BENZ GROUP AG	18	117	16,430	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	7	92	12,926	資本財
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	51 5	386 —	54,053 <3.5%>
(ユーロ…フランス)				
LOREAL	1	41	5,864	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2	148	20,830	耐久消費財・アパレル
SANOFI	4	42	6,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BNP PARIBAS	16	87	12,236	銀行
TOTAL SA	17	99	13,910	エネルギー
AIR LIQUIDE SA	6	87	12,244	素材
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	48 6	508 —	71,099 <4.6%>
(ユーロ…オランダ)				
ASML HOLDING NV	2	113	15,943	半導体・半導体製造装置
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2 1	113 —	15,943 <1.0%>
(ユーロ…スペイン)				
IBERDROLA SA	44	47	6,686	公益事業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	44 1	47 —	6,686 <0.4%>
(ユーロ…ベルギー)				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	4	24	3,401	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	4 1	24 —	3,401 <0.2%>
ユ ー ロ 計	株数・金額 銘柄数<比率>	150 14	1,080 —	151,185 <9.7%>
(イギリス)		千イギリス・ポンド		
DIAGEO PLC	12	44	7,208	食品・飲料・タバコ
BRITISH AMERICAN TOBACCO	9	31	5,060	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	109	54	8,817	銀行
RTO TINTO PLC	13	74	11,920	素材

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	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	129	60	9,722	エネルギー
ASTRAZENECA PLC	8	93	15,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNILEVER PLC	3	12	2,028	家庭用品・パーソナル用品
RECKITT&COLMAN PLC	3	22	3,585	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC	21	31	5,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHELL PLC-NEW	16	37	6,035	エネルギー
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	327 10	463 — <4.8%>	
(スイス)		千スイス・フラン		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1	70	9,963	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	5	44	6,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2	70	10,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REGISTERED-B	5	56	8,057	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	14 4	242 — <2.2%>	
(デンマーク)		千デンマーク・クローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	9	912	17,155	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>	9 1	912 — <1.1%>	
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		
WESTPAC BANKING CORP	35	82	7,244	銀行
BHP BILLITON LTD	34	156	13,770	素材
CSL LIMITED	4	119	10,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NATIONAL AUSTRALIA BANK	39	118	10,476	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	113 4	477 — <2.7%>	
(香港)		千香港・ドル		
AIA GROUP LTD	56	474	8,020	保険
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	56 1	474 — <0.5%>	
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,410 120	— — <90.5%>	

(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) 邦貨換算金額の<>内は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

外国投資信託証券

銘柄	口数	当 期 末		比 率
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	千アメリカ・ドル	千円	%
PROLOGIS INC	1,070	120	15,817	1.0
AMERICAN TOWER CORP	410	85	11,275	0.7
CROWN CASTLE INC	590	78	10,403	0.7
合 計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,070 3	284 — <2.4%>	

(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) 比率は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年12月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,406,394	90.5
投資証券	37,497	2.4
コール・ローン等、その他	109,783	7.1
投資信託財産総額	1,553,674	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(1,450,915千円)の投資信託財産総額(1,553,674千円)に対する比率は、93.4%です。

(注3) 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、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=131.78円、1カナダ・ドル=96.90円、1ユーロ=139.92円、1イギリス・ポンド=160.56円、1スイス・フラン=142.16円、1デンマーク・クローネ=18.81円、1オーストラリア・ドル=88.06円、1香港・ドル=16.92円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年12月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,553,674,065
コール・ローン等	108,514,897
株式(評価額)	1,406,394,847
投資証券(評価額)	37,497,129
未収入金	20,782
未収配当金	1,246,410
(B) 負債	309
未払利息	309
(C) 純資産総額(A-B)	1,553,673,756
元本	1,556,443,872
次期繰越損益金	△ 2,770,116
(D) 受益権総口数	1,556,443,872口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,982円

(注1) 信託財産に係る期首元本額396,000,000円、期中追加設定元本額1,469,588,818円、期中一部解約元本額309,144,946円

(注2) 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ごとの元本の内訳

SOMPO123 先進国株式 1,556,443,872円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 0.9982円

(注4) 期末における元本の欠損金額 2,770,116円

○損益の状況 (2021年12月21日~2022年12月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	26,372,158
受取配当金	26,424,747
その他収益金	576
支払利息	△ 53,165
(B) 有価証券売買損益	△ 37,187,704
売買益	199,738,883
売買損	△236,926,587
(C) 保管費用等	△ 3,490,698
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 14,306,244
(E) 追加信託差損益金	27,671,182
(F) 解約差損益金	△ 16,135,054
(G) 計(D+E+F)	△ 2,770,116
次期繰越損益金(G)	△ 2,770,116

(注1) 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) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 解約差損益金とは、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。