

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	信託期間は2022年3月29日から無期限です。	
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	My SMT S&P500インデックス(ノーロード)	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。
	S&P500インデックスマザーファンド	米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	My SMT S&P500インデックス(ノーロード)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	S&P500インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

My SMT S&P500 インデックス(ノーロード)

運用報告書(全体版)

第1期(決算日 2023年3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1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	投資信託証券組入率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
設定日(2022年3月29日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期(2023年3月27日)	9,256	0	△7.4	9,285	△7.1	90.3	5.5	2.2	4,778

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物率	投資信託証券組入率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(設定日) 2022年 3月29日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —
3月末	9,916	△0.8	9,912	△0.9	—	—	99.4
4月末	9,498	△5.0	9,494	△5.1	—	—	99.7
5月末	9,404	△6.0	9,405	△5.9	—	—	99.0
6月末	9,218	△7.8	9,221	△7.8	—	—	99.7
7月末	9,687	△3.1	9,695	△3.1	—	—	99.2
8月末	9,779	△2.2	9,789	△2.1	—	—	103.3
9月末	9,351	△6.5	9,353	△6.5	—	7.4	94.6
10月末	10,258	2.6	10,272	2.7	—	5.8	94.1
11月末	9,767	△2.3	9,779	△2.2	—	4.9	95.5
12月末	9,082	△9.2	9,103	△9.0	87.3	10.9	2.3
2023年 1月末	9,327	△6.7	9,352	△6.5	94.8	3.4	2.5
2月末	9,671	△3.3	9,702	△3.0	95.5	2.5	2.5
(当期末) 2023年 3月27日	9,256	△7.4	9,285	△7.1	90.3	5.5	2.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

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

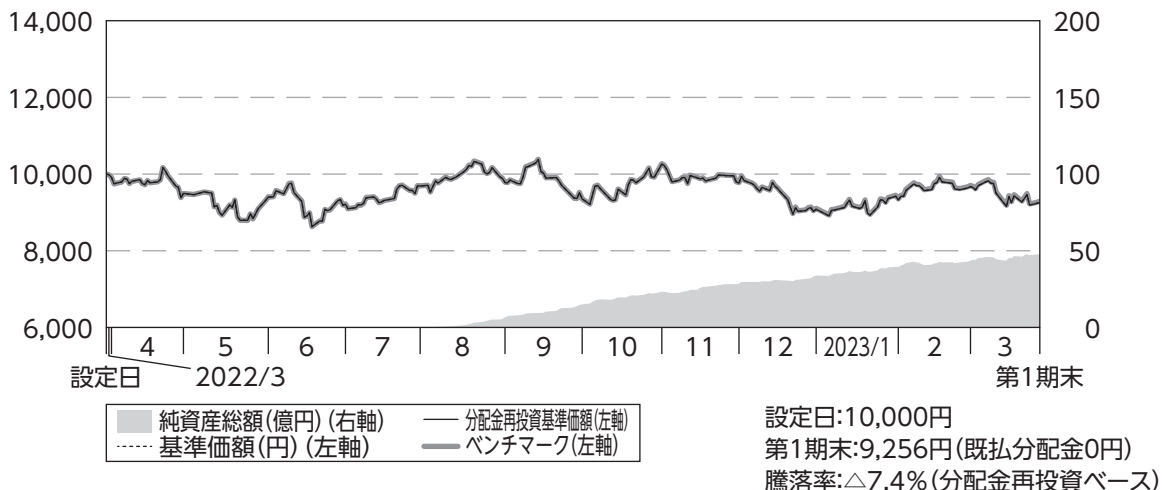
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、S&P500(配当込み、円換算ベース)です。

S&P500[®]は、S&P Dow Jones Indices LLCが公表している米国の代表的な株価指数で、米国の主要産業を代表する約500銘柄の時価総額で加重平均して算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P500[®](以下「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLC又はその関連会社(以下「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、又は中断に対しても一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注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。

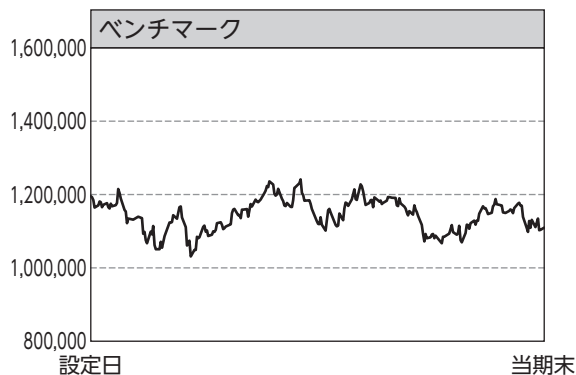
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年3月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

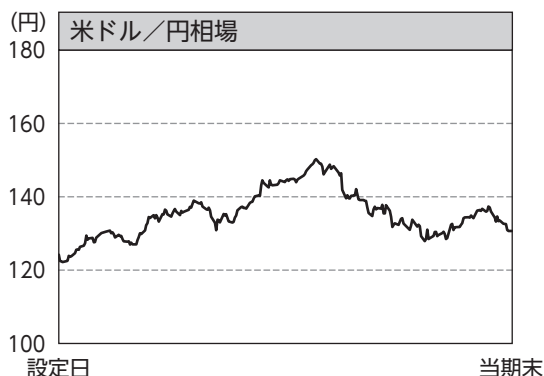
基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

投資環境



米国株式市場は、欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速懸念や、世界的なインフレ高進を受けた金融引き締め加速への警戒感から2022年6月にかけて下落しました。その後は一時反発する場面もありましたが、FRB(米連邦準備理事会)の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、9月にかけて再び下落しました。10月以降は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことなどから利上げ幅の縮小や先行きの利上げ停止が期待されて上昇しましたが、期末にかけてはFRB高官からの利上げ継続を示唆する発言などが嫌気されて軟調な展開となりました。



当ファンドのポートフォリオ

「S&P500インデックス マザーファンド」受益証券を高位に組み入れ運用しました。

【「S&P500インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。当マザーファンドは、財産規模が小さかったため運用効率の観点からETF(上場投資信託証券)に投資を行っていましたが、残高規模の拡大に伴い2022年12月に現物株式投資へと切り替えました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

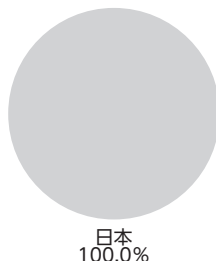
	当期末
	2023年3月27日
S&P500インデックスマザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

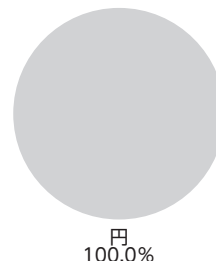
○資産別配分



○国別配分



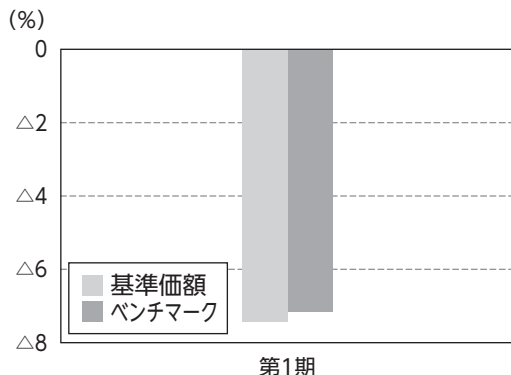
○通貨別配分



(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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因^(※)および信託報酬要因(いずれもマイナス要因)です。

※ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

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1期	
	2022年3月29日～2023年3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)	83	

(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

S&P500インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P500(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてS&P500への連動を目指す上場投資信託証券に実質投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月29日～2023年3月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	9円	0.097%	(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9,579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。
(投信会社)	(4)	(0.037)	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
(販売会社)	(4)	(0.037)	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)	(2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	11	0.116	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(株式)	(4)	(0.041)	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
(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)	(5)	(0.051)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(2)	(0.024)	
(c) 有価証券取引税	0	0.004	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(株式)	(0)	(0.000)	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
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
(d) その他費用	7	0.074	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(保管費用)	(7)	(0.068)	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)	(1)	(0.006)	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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	27	0.291	

(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。

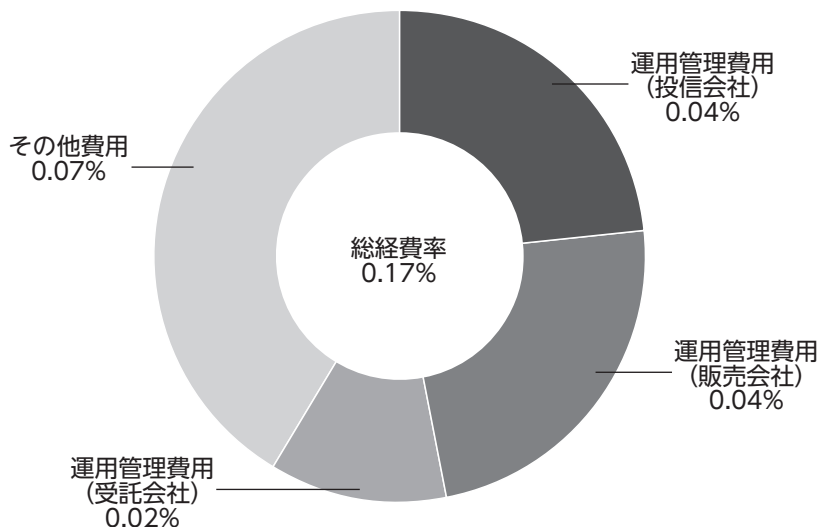
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

<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0.17%です。



(注1)各費用は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
S&P500インデックスマザーファンド	千口 3,389,525	千円 5,142,827	千口 119,225	千円 183,487

株式売買比率

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<S&P500インデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	6,347,101千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,301,720千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.19

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.003337	百万円 0.003337	% 100.0	百万円 0.003337	百万円 0.003337	% 100.0
コール・ローン	1,811	157	8.7	1,807	157	8.7

(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。

<S&P500インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 6,827	百万円 6,827	% 100.0	百万円 464	百万円 464	% 100.0
金 銭 信 託	0.001698	0.001698	100.0	0.001698	0.001698	100.0
コール・ローン	9,272	763	8.2	9,227	756	8.2

<平均保有割合 56.5%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

自社による当ファンドの設定・解約状況

当期首残高本 (元)	当期設定本 元	当期解約本 元	当期末残高本 (元)	取引の理由
千円 -	千円 500	千円 500	千円 -	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド	千口 3,270,299	千円 4,776,599

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、4,860,740千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド	千円 4,776,599	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,410	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,781,009	100.0

(注1)S&P500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(7,053,967千円)の投資信託財産総額(7,100,678千円)に対する比率は99.3%です。

(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=130.65円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年3月27日現在
(A) 資 産	4,781,009,780円
コール・ローン等	4,410,524
S&P500インデックス マザーファンド(評価額)	4,776,599,256
(B) 負 債	2,034,451
未 払 解 約 金	391,964
未 払 信 託 報 酬	1,554,234
未 払 利 息	2
そ の 他 未 払 費 用	88,251
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,778,975,329
元 本	5,163,372,652
次 期 繰 越 損 益 金	△384,397,323
(D) 受 益 権 総 口 数	5,163,372,652口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,256円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年3月29日 至 2023年3月27日
(A) 配 当 等 収 益	△3,803円
受 取 利 息	10
支 払 利 息	△3,813
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△180,044,182
売 買 損 益	12,504,667
売 買 損 益	△192,548,849
(C) 信 託 報 酬 等	△1,738,366
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△181,786,351
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△202,610,972
(配 当 等 相 当 額)	(△6,790)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△202,604,182)
(F) 計 (D+E)	△384,397,323
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△384,397,323
追 加 信 託 差 損 益 金	△202,610,972
(配 当 等 相 当 額)	(8,936,795)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△211,547,767)
分 配 準 備 積 立 金	34,205,789
繰 越 損 益 金	△215,992,140

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

(注3) (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500,000円、期中追加設定元本額は6,132,142,295円、期中一部解約元本額は969,269,643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)	34,205,789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	8,936,795円
(D) 分配準備積立金額	－円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	43,142,584円
(F) 期末残存口数	5,163,372,652口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	83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。

S&P500インデックスマザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2023年3月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2020年8月25日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	米国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
設定日(2020年8月25日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 499
第1期(2021年3月10日)	11,547	15.5	11,576	15.8	—	—	99.6	576
第2期(2022年3月10日)	13,773	19.3	13,847	19.6	—	—	99.7	787
第3期(2023年3月10日)	14,992	8.9	15,125	9.2	92.0	6.0	2.4	6,724

(注)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2022年 3月10日	13,773	—	13,847	—	—	—	99.7
3月末	15,635	13.5	15,730	13.6	—	—	99.5
4月末	14,976	8.7	15,067	8.8	—	—	99.7
5月末	14,829	7.7	14,926	7.8	—	—	99.0
6月末	14,537	5.5	14,634	5.7	—	—	99.8
7月末	15,278	10.9	15,386	11.1	—	—	99.3
8月末	15,424	12.0	15,535	12.2	—	—	103.3
9月末	14,750	7.1	14,844	7.2	—	7.4	94.7
10月末	16,182	17.5	16,302	17.7	—	5.8	94.1
11月末	15,408	11.9	15,518	12.1	—	4.9	95.5
12月末	14,329	4.0	14,447	4.3	87.4	10.9	2.3
2023年 1月末	14,716	6.8	14,841	7.2	94.8	3.4	2.5
2月末	15,261	10.8	15,397	11.2	95.5	2.5	2.5
(当期末) 2023年 3月10日	14,992	8.9	15,125	9.2	92.0	6.0	2.4

(注1)騰落率は期首比です。

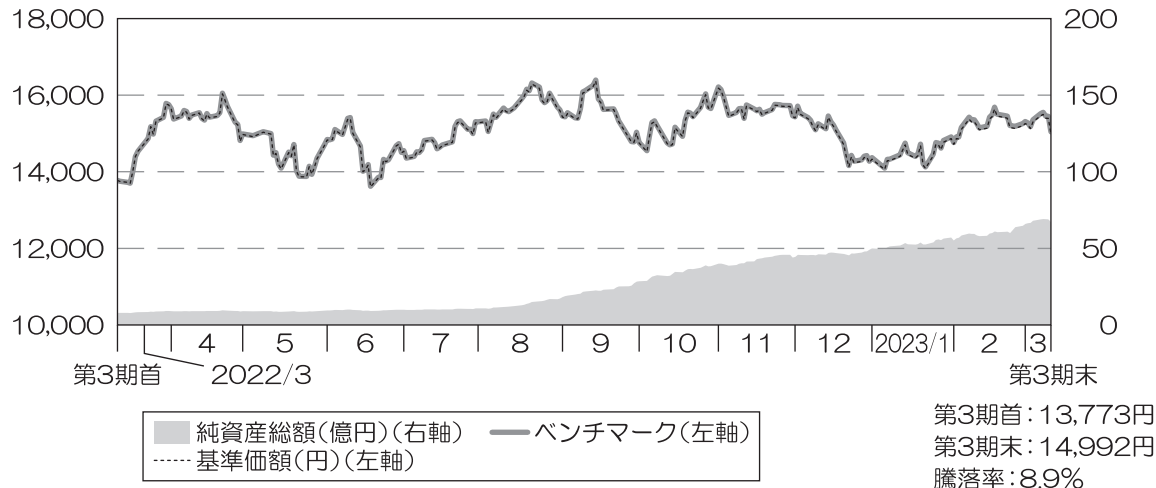
(注2)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、S&P500(配当込み、円換算ベース)です。

S&P500[®]は、S&P Dow Jones Indices LLCが公表している米国の代表的な株価指数で、米国の主要産業を代表する約500銘柄の時価総額で加重平均して算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P500[®](以下「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLC又はその関連会社(以下「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、又は中断に対しても一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

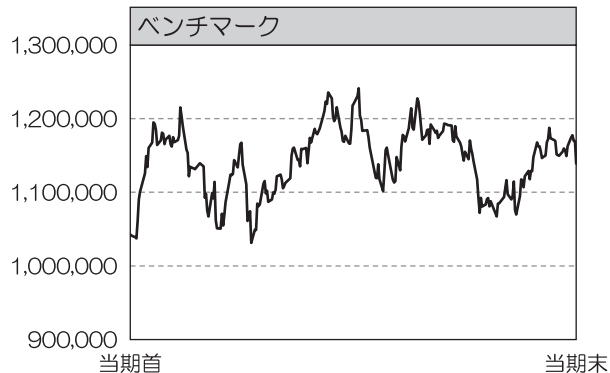


(注)ベンチマークは、2022年3月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

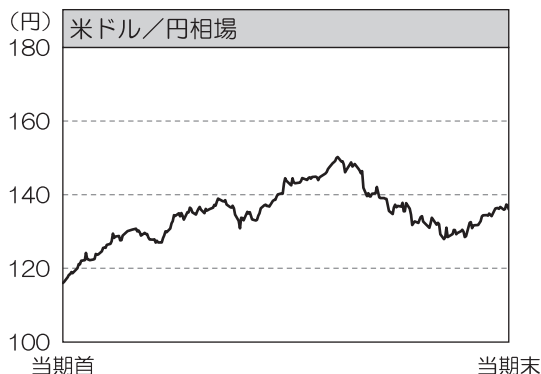
基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



米国株式市場は、欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速懸念や、世界的なインフレ高進を受けた金融引き締め加速への警戒感から2022年6月にかけて下落しました。その後は一時反発する場面もありましたが、FRB(米連邦準備理事会)の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、9月にかけて再び下落しました。しかし、10月以降は、CPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化したことなどから、利上げ幅の縮小や先行きの利上げ停止が期待されたことで下げ幅を縮小しました。外国為替市場では、日本と米国との金融政策姿勢の違いが意識され、米ドルに対して円安が進行しました。



当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるS&P500(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。当ファンドは、財産規模が小さかったため運用効率の観点からETF(上場投資信託証券)に投資を行っていましたが、残高規模の拡大に伴い2022年12月に現物株式投資へと切り替えました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

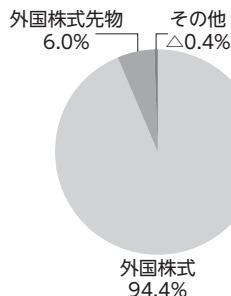
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	6.5%
2	SP500 MIC EM 2303	アメリカ	6.0%
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	5.4%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.4%
5	NVIDIA CORP	アメリカ	1.7%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%

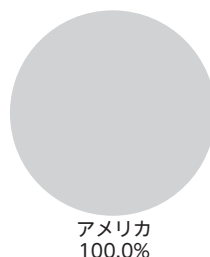
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	1.6%
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
9	TESLA INC	アメリカ	1.3%
10	EXXON MOBIL	アメリカ	1.3%
組入銘柄数			504

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

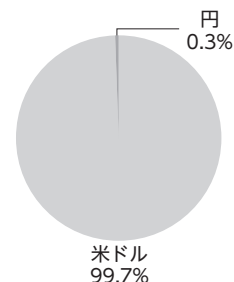
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

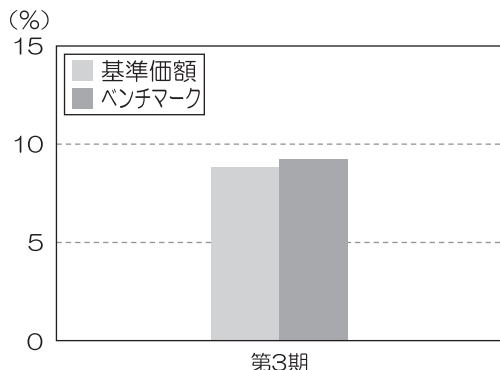


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して6.0%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因^(※)および取引コスト要因(いずれもマイナス要因)です。

※ ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

今後の運用方針

主として米国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、S&P500(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。なお、投資信託財産の規模によっては、運用効率の観点から、株式に代えてS&P500への連動を目指す上場投資信託証券に投資することがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月11日～2023年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	14円	0.095%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(5)	(0.031)	
(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)	(7)	(0.049)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(2)	(0.015)	
(b) 有価証券取引税	0	0.003	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(c) その他費用	10	0.065	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(10)	(0.065)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	24	0.163	

(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(15,110円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 4,341 (6)	千米ドル 44,902 (△0.22624)	百株 —	千米ドル —

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

			当 期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ア メ リ カ		千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.194	28	—	—	
	BOSTON PROPERTIES	0.15	10	—	—	
	PROLOGIS INC	1	149	—	—	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.181	29	—	—	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.193	21	—	—	
	CROWN CASTLE INC	0.616	83	—	—	
	ESSEX PROPERTY TRUST	0.109	23	—	—	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	0.442	26	—	—	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.077	7	—	—	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.949	23	—	—	
	WELLTOWER INC	0.729	48	—	—	
	KIMCO REALTY CORP	1	23	—	—	
	IRON MOUNTAIN INC	0.486	24	—	—	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	0.75	12	—	—	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.179	28	—	—	
	ISHARES CORE S&P 500 ETF	67	26,217	82	31,709	
	REALTY INCOME CORP	0.941	60	—	—	
	REGENCY CENTERS CORP	0.162	9	—	—	
	UDR INC	0.538	21	—	—	
	SIMON PROPERTY GROUP	0.492	58	—	—	
	PUBLIC STORAGE	0.231	66	—	—	
	VENTAS INC	0.609	28	—	—	
	VORNADO REALTY TRUST	0.169	3	0.169	3	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.2	30	—	—	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.368	37	—	—	
	AMERICAN TOWER CORPORATION	0.663	138	—	—	
	INVITATION HOMES INC	0.909	27	—	—	
	EQUINIX INC	0.129	86	—	—	
	VICI PROPERTIES INC	1	41	—	—	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.138	38	—	—	
	小 計	81	27,404	83	31,712	

(注) 金額は受渡代金です。

〈先物取引の種類別取引状況〉

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株 式 先 物 取 引	百万円 3,109	百万円 2,680	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

〈株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合〉

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,968,995千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,301,720千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	1.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,334	百万円 6,334	% 100.0	百万円 349	百万円 349	% 100.0
金 銭 信 託	0.001698	0.001698	100.0	0.001698	0.001698	100.0
コール・ローン	8,595	677	7.9	8,550	671	7.8

(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。

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

組入資産の明細

〈外国株式〉

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		評 価 額		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AMAZON.COM	—	126	1,165	158,517		小売
ABBOTT LABORATORIES	—	24	242	33,031		ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	—	12	29	4,066		公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	—	12	162	22,083		ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	—	22	192	26,229		半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	—	6	224	30,466		ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	—	5	117	15,931		保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	—	3	89	12,209		素材
ALASKA AIR GROUP INC	—	1	6	859		運輸
RALPH LAUREN CORPORATION	—	0.43	4	670		耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	—	3	40	5,505		保険
HONEYWELL INTL INC	—	9	184	25,105		資本財
AMGEN	—	7	171	23,339		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	—	4	57	7,884		エネルギー
AMERICAN EXPRESS	—	8	146	19,921		各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	—	7	66	9,102		公益事業
AFLAC	—	8	55	7,548		保険
AMERICAN INT'L GROUP	—	10	61	8,317		保険
ANALOG DEVICES	—	7	134	18,275		半導体・半導体製造装置
VALERO ENERGY CORP	—	5	73	10,003		エネルギー
COMCAST CORP-CL A	—	61	217	29,625		メディア・娯楽
ANSYS INC	—	1	37	5,063		ソフトウェア・サービス
APPLE INC	—	212	3,205	435,974		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	—	12	143	19,500		半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	—	1	35	4,830		素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	—	8	63	8,602		食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	—	1	9	1,224		公益事業
AMEREN CORPORATION	—	3	27	3,721		公益事業
AUTODESK INC	—	3	64	8,780		ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	—	5	129	17,602		ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	—	0.28	67	9,224		小売
AVERY DENNISON CORP	—	1	23	3,260		素材
BALL CORP	—	4	27	3,682		素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	—	25	781	106,341		各種金融
BANK NEW YORK CO	—	11	54	7,344		各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	—	7	29	4,078		ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	—	4	94	12,823		ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	—	2	40	5,555		資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	—	59	218	29,717		電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	—	3	22	3,103		保険
BEST BUY COMPANY INC	—	3	25	3,470		小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	0.23	11	1,524		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	—	4	57	7,834		消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	—	8	31	4,302		公益事業
BOEING CO	—	7	160	21,814		資本財
ROBERT HALF INTL INC	—	1	8	1,222		商業・専門サービス
BORGWARNER INC	—	4	21	2,904		自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	—	20	95	13,050		ヘルスケア機器・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	—	1	12	1,743		運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	2	29	3,979		メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	—	0.35	51	7,024		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	—	30	201	27,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	—	5	37	5,124	エネルギー
UNITED RENTALS INC	—	0.89	40	5,491	資本財
SEMPRA ENERGY	—	4	67	9,175	公益事業
FEDEX CORP	—	3	72	9,893	運輸
VERISIGN INC	—	1	28	3,867	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	—	8	68	9,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	—	1	11	1,626	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	—	2	33	4,563	資本財
CSX CORP	—	29	87	11,920	運輸
COTERRA ENERGY INC	—	11	30	4,088	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	—	2	11	1,501	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	—	2	53	7,279	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	—	3	28	3,849	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	—	7	178	24,284	資本財
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	9	2	391	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	—	41	544	74,012	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	3	30	4,197	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	—	4	118	16,088	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	—	2	27	3,797	保険
CINTAS CORP	—	1	56	7,737	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	—	58	285	38,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	—	1	28	3,859	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	—	55	329	44,802	食品・飲料・タバコ
COPART INC	—	5	38	5,228	商業・専門サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	—	11	84	11,536	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	—	3	66	9,033	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	—	0.94	24	3,378	ヘルスケア機器・サービス
COMERICA INC	—	1	8	1,153	銀行
NRG ENERGY INC	—	2	7	1,086	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	—	7	26	3,635	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	—	4	41	5,637	公益事業
CMS ENERGY CORP	—	4	27	3,715	公益事業
THE COOPER COS INC	—	0.81	27	3,688	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	—	9	33	4,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	—	1	7	974	素材
CUMMINS INC	—	2	54	7,463	資本財
DR HORTON INC	—	4	38	5,190	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	—	9	227	30,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	—	2	68	9,269	各種金融
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	—	6	40	5,442	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	—	6	105	14,310	小売
DEERE&CO	—	3	164	22,411	資本財
MORGAN STANLEY	—	18	173	23,537	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	—	2	34	4,642	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	—	5	35	4,889	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	—	25	249	33,932	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	—	2	37	5,127	小売
DOVER CORP	—	2	31	4,309	資本財
OMNICOM GROUP	—	3	27	3,793	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	—	2	30	4,166	公益事業
DUKE ENERGY CORP	—	10	103	14,045	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	—	1	27	3,797	消費者サービス
EBAY	—	7	30	4,100	小売
BANK OF AMERICA CORP	—	99	303	41,267	銀行
CITIGROUP	—	27	133	18,224	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	—	1	10	1,415	素材

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
EATON CORP	—	5	98	13,423	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	—	3	77	10,551	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	—	2	2	405	メディア・娯楽
ECOLAB INC	—	3	59	8,040	素材
PERKINELMER INC	—	2	25	3,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	—	3	37	5,032	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	—	14	254	34,589	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	—	8	71	9,759	資本財
ATMOS ENERGY CORP	—	2	25	3,442	公益事業
ENTERGY CORP	—	3	31	4,224	公益事業
EOG RESOURCES INC	—	8	96	13,076	エネルギー
EQUIFAX INC	—	1	31	4,237	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	—	3	12	1,641	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	—	3	80	10,895	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	—	2	28	3,825	運輸
EXXON MOBIL	—	58	639	87,008	エネルギー
FMC CORP	—	2	25	3,436	素材
NEXTERA ENERGY INC	—	28	208	28,380	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	0.62	25	3,423	各種金融
ASSURANT INC	—	0.55	6	896	保険
FASTENAL CO	—	7	38	5,229	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	—	8	28	3,844	銀行
M & T BANK CORP	—	2	29	4,053	銀行
FISERV INC	—	9	104	14,190	ソフトウェア・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	—	2	8	1,127	各種金融
PREEPOR-T-MCMORAN INC	—	20	79	10,841	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	3	58	8,020	保険
DENTSPLY SIRONA INC	—	2	8	1,135	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	—	3	72	9,821	資本財
GENERAL MILLS INC	—	8	68	9,273	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	—	2	33	4,516	小売
GILEAD SCIENCES INC	—	17	140	19,167	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	—	1	33	4,610	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	—	2	68	9,321	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	—	35	830	112,966	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	—	15	142	19,364	資本財
GRAINGER (WW) INC	—	0.58	40	5,466	資本財
HALLIBURTON CO	—	11	41	5,602	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	—	4	164	22,426	各種金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	2	58	7,978	資本財
HASBRO INC	—	1	6	947	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	—	1	10	1,491	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY FOODS CORPORATION	—	1	44	6,101	食品・飲料・タバコ
HP INC	—	11	32	4,354	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	—	0.63	8	1,210	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUNIPER NETWORKS INC	—	3	10	1,440	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	—	3	29	4,056	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	—	14	419	57,071	小売
HORMEL FOODS CORP	—	3	12	1,642	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	—	9	27	3,761	公益事業
HUMANA INC	—	1	87	11,906	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	—	1	24	3,395	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	—	21	29	3,986	銀行
BIOGEN INC	—	2	56	7,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	—	1	26	3,672	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	—	3	93	12,709	資本財
INTUIT INC	—	4	162	22,065	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
IDEXX LABORATORIES INC	—	1	59	8,029	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	—	58	155	21,127	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	—	3	28	3,851	素材
INT'L PAPER CO	—	3	13	1,836	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	—	6	22	3,116	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	0.77	12	1,705	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	—	3	23	3,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON & JOHNSON	—	37	562	76,562	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	—	4	29	4,058	保険
KLA CORP	—	2	76	10,449	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORPORATION	—	10	53	7,213	エネルギー
KELLOGG CO	—	4	26	3,566	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	—	14	24	3,267	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	—	5	61	8,371	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	—	2	139	18,956	各種金融
KROGER CO	—	8	39	5,391	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	—	1	95	12,936	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	0.71	29	4,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	0.97	13	1,788	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	—	1	12	1,653	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	—	3	32	4,425	耐久消費財・アパレル
LILLY (ELI) & CO	—	11	355	48,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATH & BODY WORKS INC	—	2	9	1,240	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	—	1	4	602	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	—	10	190	25,843	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	—	4	61	8,333	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	—	3	157	21,487	資本財
LOEWS CORP	—	2	12	1,637	保険
CARNIVAL CORPORATION	—	13	13	1,896	消費者サービス
LOWES COMPANIES	—	8	175	23,932	小売
DOMINION ENERGY INC	—	12	65	8,975	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	—	5	24	3,265	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	—	3	28	3,809	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	—	10	272	37,114	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	—	4	158	21,528	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	—	0.65	23	3,254	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	—	9	68	9,358	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	—	7	112	15,251	保険
MASCO CORP	—	2	12	1,645	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	0.91	32	4,383	素材
METLIFE INC	—	9	62	8,487	保険
MEDTRONIC PLC	—	18	147	20,071	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	—	10	79	10,861	メディア・娯楽
CVS HEALTH CORP	—	18	143	19,584	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	—	36	388	52,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	5	45	6,145	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER	—	1	29	4,024	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	—	106	2,677	364,148	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	—	15	86	11,706	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	—	8	67	9,240	半導体・半導体製造装置
3 M COMPANY	—	7	82	11,208	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	—	0.55	5	749	耐久消費財・アパレル
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	0.53	11	1,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	—	2	65	8,944	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	—	2	40	5,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	—	8	54	7,349	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	—	57	71	9,777	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
NETAPP INC	—	3	23	3,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	—	3	5	699	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	—	12	51	6,948	素材
NVR INC	—	0.05	26	3,609	耐久消費財・アパレル
NIKE B	—	17	211	28,744	耐久消費財・アパレル
NORDSON CORP	—	0.56	12	1,661	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	—	3	70	9,656	運輸
EVERSOURCE ENERGY	—	4	33	4,535	公益事業
NISOURCE INC	—	4	11	1,586	公益事業
TAPESTRY INC	—	2	10	1,431	耐久消費財・アパレル
NORTHERN TRUST CORP	—	3	27	3,782	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	—	2	94	12,861	資本財
WELLS FARGO & CO	—	54	223	30,342	銀行
NUCOR CORP	—	3	64	8,743	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	—	5	57	7,811	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	—	10	65	8,879	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	1	39	5,411	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	—	0.9	74	10,065	小売
ORACLE CORP	—	21	190	25,851	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	—	7	59	8,024	資本財
EXELON CORP	—	14	60	8,225	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	—	1	66	9,068	資本財
PAYCHEX INC	—	4	54	7,461	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	1	34	4,680	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	—	11	29	4,030	公益事業
PEPSICO INC	—	19	336	45,821	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	—	1	9	1,279	資本財
PFIZER	—	79	315	42,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	—	17	187	25,530	エネルギー
PG&E CORP	—	20	33	4,586	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	—	3	69	9,506	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	—	24	116	15,829	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	—	5	79	10,763	銀行
BROWN & BROWN INC	—	2	13	1,862	保険
GARMIN LTD	—	2	24	3,382	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	—	3	38	5,232	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	—	6	302	41,088	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	—	2	32	4,375	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS	—	1	25	3,430	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	—	33	460	62,653	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	—	8	118	16,094	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	—	6	37	5,035	公益事業
PULTE GROUP INC	—	4	22	3,080	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	—	3	36	4,965	ソフトウェア・サービス
QUALCOMM	—	15	187	25,445	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	—	2	29	3,962	各種金融
REGENERON PHARMACEUTICALS	—	1	113	15,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RESMED INC	—	1	39	5,395	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	—	18	80	10,890	銀行
ARCH CAPITAL GROUP LTD	—	5	36	4,901	保険
ROSS STORES INC	—	5	55	7,537	小売
ROLLINS INC	—	2	8	1,150	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	—	1	65	8,970	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	—	1	53	7,318	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	2	20	2,766	消費者サービス
ACCENTURE PLC-CL A	—	8	233	31,690	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	—	19	125	17,122	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	1	32	4,465	保険
TRAVELERS COS INC/THE	—	3	60	8,208	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	—	8	53	7,290	ソフトウェア・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	—	0.55	137	18,741	消費者サービス
SCHLUMBERGER	—	20	105	14,331	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	—	21	144	19,627	各種金融
POOL CORP	—	0.68	23	3,228	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	—	2	33	4,509	ヘルスケア機器・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	—	3	156	21,270	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	—	2	31	4,263	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	—	3	27	3,702	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	—	3	73	10,043	素材
CENTENE CORP	—	8	55	7,603	ヘルスケア機器・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	—	0.95	10	1,370	銀行
SMITH (A. O.) CORP	—	1	8	1,219	資本財
SNAP-ON INC	—	0.94	23	3,156	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	—	5	51	6,945	保険
ADVANCE AUTO PARTS	—	0.63	8	1,112	小売
EDISON INTL	—	4	33	4,501	公益事業
SOUTHERN CO	—	15	100	13,608	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	—	18	78	10,693	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	3	65	8,846	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	—	9	29	4,071	運輸
AT&T INC	—	101	185	25,278	電気通信サービス
CHEVRON CORP	—	25	406	55,276	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	—	2	22	2,995	資本財
STATE STREET CORP	—	4	38	5,295	各種金融
STARBUCKS CORP	—	16	163	22,290	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	2	32	4,445	素材
STRYKER CORP	—	4	128	17,482	ヘルスケア機器・サービス
NETFLIX INC	—	6	188	25,637	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	—	6	10	1,466	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	—	2	78	10,730	ソフトウェア・サービス
SYS CO CORP	—	7	57	7,772	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	—	5	114	15,637	ヘルスケア機器・サービス
TELEFLEX INC	—	0.49	11	1,525	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	—	2	26	3,570	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	—	12	224	30,477	半導体・半導体製造装置
TEXTRON	—	3	24	3,361	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	—	5	308	41,985	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	—	0.95	11	1,501	保険
DAVITA INC	—	0.58	4	590	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	—	1	32	4,413	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS	—	2	12	1,752	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	0.73	23	3,160	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	—	4	26	3,590	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORP	—	10	25	3,463	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	—	8	174	23,750	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	20	199	27,125	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	—	13	618	84,099	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	—	0.67	8	1,089	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	—	3	7	1,085	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	—	5	11	1,503	メディア・娯楽
VERTECX PHARMACEUTICALS INC	—	3	104	14,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VULCAN MATERIALS CO	—	1	30	4,095	素材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	—	9	30	4,206	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	—	20	275	37,480	食品・生活必需品小売り

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	—	5	80	10,898	商業・専門サービス
WATERS CORP	—	0.92	28	3,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	1	34	4,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	—	1	26	3,551	食品・飲料・タバコ
WESTERN DIGITAL CORP	—	3	12	1,678	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	—	2	28	3,939	資本財
WEYERHAEUSER CO	—	9	29	3,952	不動産
WHIRLPOOL CORP	—	0.57	7	1,040	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	—	2	28	3,885	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	—	1	11	1,610	消費者サービス
NASDAQ INC	—	5	28	3,856	各種金融
CME GROUP INC	—	5	90	12,358	各種金融
WILLIAMS COS	—	18	55	7,537	エネルギー
LKQ CORP	—	4	24	3,273	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	—	4	22	3,123	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	—	4	36	4,906	公益事業
CARMAX INC	—	1	11	1,498	小売
TJX COMPANIES INC	—	16	123	16,855	小売
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	0.86	25	3,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	—	1	6	883	銀行
SIGNATURE BANK	—	0.66	5	814	銀行
CBRE GROUP INC-A	—	4	33	4,533	不動産
REGIONS FINL CORP	—	13	28	3,900	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	—	0.37	11	1,555	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	0.67	33	4,489	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	—	5	28	3,943	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	—	5	28	3,865	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	0.39	13	1,874	各種金融
CELANESE CORP-SERIES A	—	1	11	1,623	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	—	1	10	1,421	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	—	5	64	8,780	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	—	2	25	3,413	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	—	3	25	3,497	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	—	1	51	6,996	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	—	7	79	10,823	各種金融
LIVE NATION ENTERTAINMENT	—	1	10	1,390	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	—	0.41	63	8,649	消費者サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	—	4	22	3,104	運輸
TRANSDIGM GROUP INC	—	0.78	57	7,866	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	—	12	428	58,234	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS	—	2	22	3,002	商業・専門サービス
FIRST SOLAR INC	—	1	34	4,654	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	—	2	28	3,935	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	—	8	32	4,360	運輸
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	—	3	36	5,028	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	—	4	61	8,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ULTA BEAUTY INC	—	0.66	34	4,667	小売
INVESCO LTD	—	4	8	1,104	各種金融
MSCI INC	—	1	63	8,659	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	—	22	218	29,705	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	—	23	511	69,632	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	—	2	31	4,324	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	—	6	85	11,646	エネルギー
KINDER MORGAN INC	—	25	43	5,879	エネルギー
XYLEM INC	—	2	28	3,840	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	—	3	30	4,091	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	—	0.42	8	1,199	資本財

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
EPAM SYSTEMS INC	—	0.91	26	3,665	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	—	3	76	10,459	ヘルスケア機器・サービス
VERISK ANALYTICS INC	—	2	36	5,007	商業・専門サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	—	1	25	3,424	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	—	2	22	3,094	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	3	68	9,294	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	—	3	27	3,712	エネルギー
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	1	22	3,032	各種金融
DOLLAR GENERAL CORP	—	3	71	9,701	小売
FORTINET INC	—	9	59	8,072	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	—	38	660	89,865	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	—	0.66	7	1,057	資本財
ENPHASE ENERGY INC	—	1	37	5,137	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	—	20	76	10,442	自動車・自動車部品
APTIV PLC	—	3	39	5,368	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	—	6	69	9,477	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A	—	32	581	79,102	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	—	2	56	7,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	2	35	4,777	エネルギー
SERVICENOW INC	—	2	123	16,784	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	—	25	370	50,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	—	8	119	16,311	電気通信サービス
PTC INC	—	1	22	3,033	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	—	6	111	15,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	—	4	6	864	消費者サービス
NEWS CORP-CLASS A	—	4	6	888	メディア・娯楽
NEWS CORP-CLASS B	—	1	2	277	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	—	1	34	4,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	—	6	10	1,473	運輸
HOWMET AEROSPACE INC	—	6	25	3,495	資本財
KEURIG DR PEPPER INC	—	10	37	5,142	食品・飲料・タバコ
BAKER HUGHES CO	—	12	38	5,257	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	2	24	3,319	食品・飲料・タバコ
BROADCOM INC	—	5	359	48,853	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	—	3	23	3,173	公益事業
ALLEGION PLC	—	0.92	10	1,395	資本財
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	1	11	1,547	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	—	1	28	3,872	ヘルスケア機器・サービス
MODERNA INC	—	4	66	9,004	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	—	4	58	7,921	消費者サービス
DOW INC	—	10	58	7,921	素材
AMCOR PLC	—	24	26	3,541	素材
FOX CORP - CLASS A	—	3	10	1,434	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	—	1	4	608	メディア・娯楽
CARRIER GLOBAL CORP	—	12	59	8,040	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	—	6	54	7,393	資本財
CORTEVA INC	—	10	63	8,614	素材
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	2	12	1,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND INC	—	5	34	4,657	資本財
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	—	4	36	4,903	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	0.83	23	3,225	ソフトウェア・サービス
ORGANON & CO	—	2	6	845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AON PLC	—	2	87	11,866	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	34	50	6,910	メディア・娯楽
CONSTELLATION ENERGY	—	4	33	4,513	公益事業
VIATRIS INC	—	12	12	1,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	2	11	1,508	消費者サービス

銘柄	当期首(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		
	百株	百株	千米ドル	千円		
ARISTA NETWORKS INC	—	3	47	6,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JACOBS SOLUTIONS INC	—	2	25	3,400	商業・専門サービス	
APA CORP	—	3	12	1,696	エネルギー	
LINDE PLC	—	6	241	32,792	素材	
CATALENT INC	—	1	13	1,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SYNCHRONY FINANCIAL	—	7	24	3,330	各種金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	7	26	3,612	銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	2	36	4,903	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QORVO INC	—	1	10	1,406	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	—	1	12	1,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	—	0.91	28	3,880	半導体・半導体製造装置	
ETSY INC	—	2	22	3,047	小売	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	—	10	64	8,790	資本財	
DUPONT DE NEMOURS INC	—	7	54	7,349	素材	
WESTROCK CO	—	2	8	1,115	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	—	10	38	5,252	食品・飲料・タバコ	
FORTIVE CORP	—	5	33	4,606	資本財	
MATCH GROUP INC	—	5	19	2,602	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	—	85	784	106,767	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	—	19	28	3,913	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	16	123	16,761	ソフトウェア・サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	—	2	6	865	ソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL C	—	75	698	94,986	メディア・娯楽	
MONSTER BEVERAGE CORP	—	5	58	8,004	食品・飲料・タバコ	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	1	55	7,511	メディア・娯楽	
合 計	株 数 ・ 金 額	—	4,347	45,497	6,188,113	
	銘柄数<比率>	—	475	—	<92.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

〈外国投資信託受益証券、投資証券〉

銘 柄	当 期 首 (前 期 末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	0.194	26	3,663	
BOSTON PROPERTIES	—	0.15	9	1,263	
PROLOGIS INC	—	1	156	21,348	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	0.181	30	4,209	
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	0.193	21	2,908	
CROWN CASTLE INC	—	0.616	78	10,712	
ESSEX PROPERTY TRUST	—	0.109	24	3,358	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	0.442	26	3,658	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	0.077	7	1,072	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	0.949	21	2,962	
WELLTOWER INC	—	0.729	52	7,183	
KIMCO REALTY CORP	—	1	21	2,948	
IRON MOUNTAIN INC	—	0.486	25	3,491	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	0.75	12	1,642	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	0.179	27	3,722	
ISHARES CORE S&P 500 ETF	15	—	—	—	
REALTY INCOME CORP	—	0.941	59	8,119	
REGENCY CENTERS CORP	—	0.162	9	1,335	
UDR INC	—	0.538	22	3,018	
SIMON PROPERTY GROUP	—	0.492	57	7,849	
PUBLIC STORAGE	—	0.231	68	9,290	
VENTAS INC	—	0.609	28	3,859	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	0.2	32	4,363	
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	0.368	38	5,224	
AMERICAN TOWER CORPORATION	—	0.663	126	17,241	
INVITATION HOMES INC	—	0.909	28	3,866	
EQUINIX INC	—	0.129	88	11,981	
VICI PROPERTIES INC	—	1	40	5,575	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	0.138	33	4,575	
合 計	口 数 ・ 金 額	15	14	1,179	160,445
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	28	—	< 2.4% >

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

〈先物取引の銘柄別期末残高〉

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
SP500 MIC EM	405	—

(注) 外貨建の評価額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 6,188,113	% 91.6
投 資 証 券	160,445	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	406,072	6.0
投 資 信 託 財 産 総 額	6,754,630	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(6,703,100千円)の投資信託財産総額(6,754,630千円)に対する比率は99.2%です。

(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=136.01円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年3月10日現在
(A) 資 産	6,817,704,080円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	297,468,090
株 式(評価額)	6,188,113,397
投 資 証 券(評価額)	160,445,783
未 収 入 金	63,073,160
未 収 配 当 金	8,710,968
差 入 委 託 証 拠 金	99,892,682
(B) 負 債	92,781,317
未 払 金	68,999,494
未 払 解 約 金	23,781,769
未 払 利 息	54
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	6,724,922,763
元 本	4,485,601,989
次 期 繰 越 損 益 金	2,239,320,774
(D) 受 益 権 総 口 数	4,485,601,989口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,992円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
(A) 配 当 等 収 益	56,242,044円
受 取 配 当 金	52,235,977
受 取 利 息	3,045,773
そ の 他 収 益 金	978,083
支 払 利 息	△17,789
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△58,533,867
売 買 益	310,473,271
売 買 損	△369,007,138
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,128,080
取 引 益	49,140,583
取 引 損	△51,268,663
(D) そ の 他 費 用	△1,914,149
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△6,334,052
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	215,760,073
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,206,033,495
(H) 解 約 差 損 益 金	△176,138,742
(I) 計 (E+F+G+H)	2,239,320,774
次 期 繰 越 損 益 金(I)	2,239,320,774

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は571,902,844円、期中追加設定元本額は4,246,606,090円、期中一部解約元本額は332,906,945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。

My SMT S&P500インデックス (ノーロード) 2,959,786,387円

DC米国株式インデックス・オープン (S&P500) 1,525,815,602円

お知らせ

該当事項はありません。