

りそなS&P500インデックス

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2024年6月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「りそなS&P500インデックス」は、2024年6月25日に第1期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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	2023年9月11日から無期限です。	
運用方針	S&P500（配当込み、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。	
主要投資対象	りそなS&P500インデックス	・RM S&P500マザーファンドの受益証券
	RM S&P500マザーファンド	・米国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式
主な投資制限	りそなS&P500インデックス	・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。
	RM S&P500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	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案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には分配を行わないことがあります。	

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

ホームページ：https://www.resona-am.co.jp/

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

フリーダイヤル：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

【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			S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期 騰落 率	(ベンチマーク)	期 騰落 率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2023年9月11日	10,000	-	-	1,411,613.45	-	-	-	-	1
1期(2024年6月25日)	13,333	0	33.3	1,895,259.94	34.3	96.5	1.7	2.0	1,123

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 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」は実質比率を記載しております。

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) S & P 5 0 0（配当込み、円換算ベース）は、S & P 5 0 0（配当込み）をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。

S&P500[®]とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S&P500[®]はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これの使用ライセンスがりそなアセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、りそなアセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、また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、または中断に対しても一切責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) (ベンチマーク)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2023年9月11日	10,000	—	1,411,613.45	—	—	—	—
9月末	9,819	△ 1.8	1,386,839.08	△ 1.8	93.0	5.0	2.1
10月末	9,514	△ 4.9	1,344,612.59	△ 4.7	93.2	5.1	2.1
11月末	10,229	2.3	1,446,995.14	2.5	91.6	6.3	2.1
12月末	10,376	3.8	1,468,875.58	4.1	92.6	5.0	2.3
2024年1月末	11,116	11.2	1,574,793.46	11.6	94.8	2.9	2.1
2月末	11,692	16.9	1,657,701.99	17.4	90.9	6.8	2.0
3月末	12,184	21.8	1,728,803.32	22.5	91.9	6.4	2.0
4月末	12,297	23.0	1,745,713.49	23.7	96.7	1.3	2.0
5月末	12,580	25.8	1,787,165.50	26.6	95.2	3.0	2.0
(期 末)							
2024年6月25日	13,333	33.3	1,895,259.94	34.3	96.5	1.7	2.0

(注) 騰落率は設定日比です。

(注) 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」は実質比率を記載しております。

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

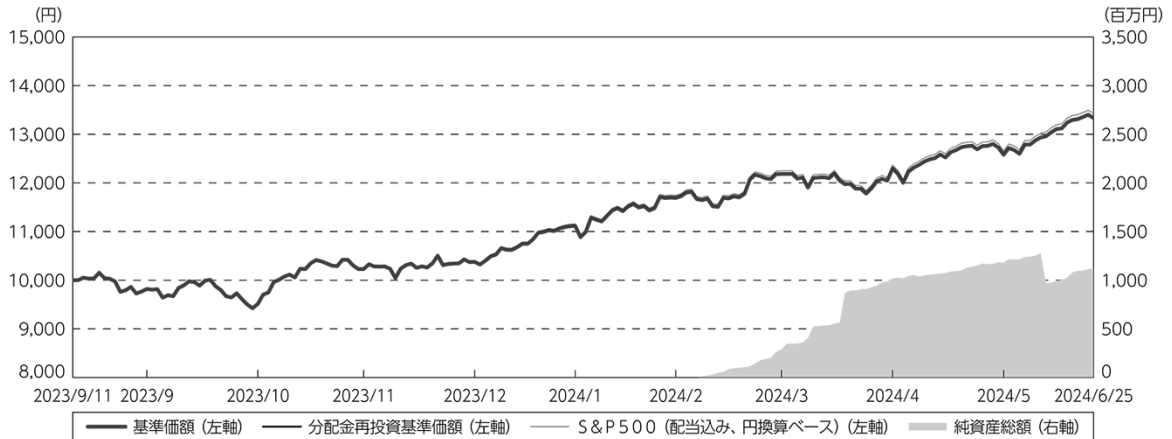
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年9月11日～2024年6月25日)

期中の基準価額等の推移



設定時：10,000円

期 末：13,333円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率： 33.3% (分配金再投資ベース)

- (注) 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) 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) S&P500(配当込み、円換算ベース)は、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) S&P500(配当込み、円換算ベース)は当ファンドのベンチマークです。
- (注) S&P500(配当込み、円換算ベース)は、S&P500(配当込み)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。S&P500[®]とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。S&P500[®]はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これの使用ライセンスがりそなアセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、りそなアセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、また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、または中断に対しても一切責任を負いません。
- (注) 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

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

米国株式市況

米国の株式市場は、設定時と比較して上昇しました。設定当初は、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めと利下げの思惑が交錯し、相場が不安定化する局面もみられましたが、その後は景気軟着陸に対する期待が高まり、米国の株式市場は上昇基調となりました。また、AI（人工知能）関連銘柄を中心に、底堅い決算内容を発表する企業が相次いだことで、S&P500などは最高値を更新しました。

為替市況

設定時と比較して、円は米ドルに対して円安となりました。

インフレ抑制を目指すFRBが金融引き締め策を継続する一方、日銀は金融緩和策を維持したことなどから、円安が進行しました。その後、日米金利差の縮小を背景に円高となりましたが、日銀がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する姿勢を示したことなどから、再度円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM S&P500マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

RM S&P500マザーファンド

S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式を主要投資対象とし、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+33.3%となり、ベンチマークの+34.3%を0.9%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

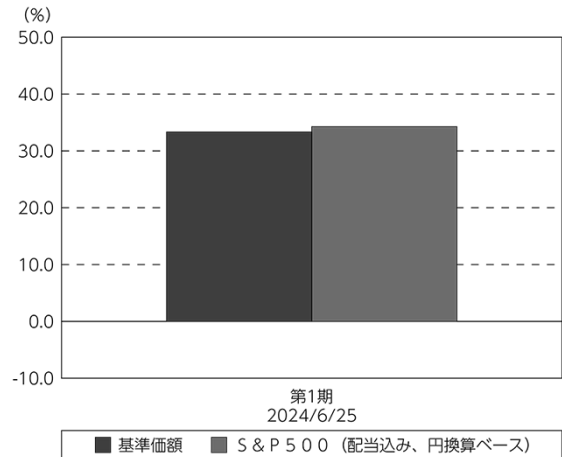
(マイナス要因)

- ・ 信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・ コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・ 配当金の課税負担が生じたこと

(その他の要因)

- ・ 株式の取引価格と評価に用いる価格が異なったこと
- ・ ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、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
	2023年9月11日～ 2024年6月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,332

(注) 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) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

当ファンド

引き続き、RM S&P500マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RM S&P500マザーファンド

引き続き、主としてS&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式に投資し、S&P500（配当込み、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。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○1万口当たりの費用明細

(2023年9月11日～2024年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	45	0.408	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(10)	(0.087)	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(34)	(0.304)	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)	(0.017)	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	1	0.011	(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 ）	(1)	(0.007)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.004)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	8	0.072	(d) 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 ）	(7)	(0.065)	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、監査法人等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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	54	0.491	
期中の平均基準価額は、11,089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。

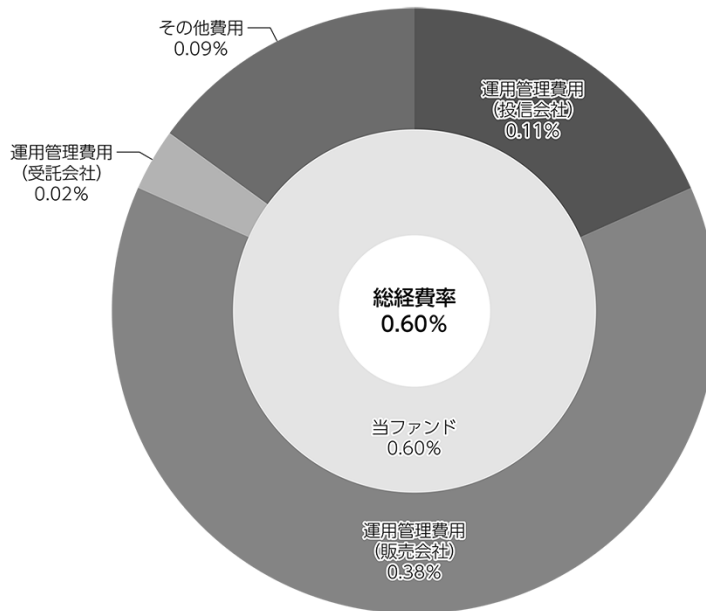
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（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0.60%です。



(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2023年9月11日～2024年6月25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
RM S&P500マザーファンド	千口 550,188	千円 1,343,462	千口 130,014	千円 335,563

○株式売買比率

(2023年9月11日～2024年6月25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
	RM S&P500マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	17,269,839千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,188,242千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.13

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、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金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月11日～2024年6月25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 (2023年9月11日～2024年6月25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

(2023年9月11日～2024年6月25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
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2024年6月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
RM S&P500マザーファンド		千口 420,173	千円 1,121,570

○投資信託財産の構成

(2024年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM S&P500マザーファンド	千円 1,121,570	% 98.7
コール・ローン等、その他	14,668	1.3
投資信託財産総額	1,136,238	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) RM S&P500マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(31,106,858千円)の投資信託財産総額(31,213,935千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 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。1米ドル=159.56円。

○特定資産の価格等の調査

(2023年9月11日～2024年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月25日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,136,238,702
コール・ローン等	14,668,296
RM S&P500マザーファンド(評価額)	1,121,570,402
未収利息	4
(B) 負債	13,097,869
未払解約金	11,883,372
未払信託報酬	1,198,982
その他未払費用	15,515
(C) 純資産総額(A-B)	1,123,140,833
元本	842,394,796
次期繰越損益金	280,746,037
(D) 受益権総口数	842,394,796口
1万円当たり基準価額(C/D)	13,333円

(注) 当ファンドの設定時元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は1,143,287,895円、期中一部解約元本額は301,893,099円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3333円です。

○損益の状況 (2023年9月11日～2024年6月25日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	20
受取利息	32
支払利息	△ 12
(B) 有価証券売買損益	90,457,859
売買益	113,458,472
売買損	△ 23,000,613
(C) 信託報酬等	△ 1,218,230
(D) 当期損益金(A+B+C)	89,239,649
(E) 追加信託差損益金	191,506,388
(配当等相当額)	(△ 1,785)
(売買損益相当額)	(191,508,173)
(F) 計(D+E)	280,746,037
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	280,746,037
追加信託差損益金	191,506,388
(配当等相当額)	(1,127,351)
(売買損益相当額)	(190,379,037)
分配準備積立金	89,239,649

(注) 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) 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) 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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,448,564円)、費用控除後の有価証券等損益額(85,791,085円)、および信託約款に規定する収益調整金(191,506,388円)より分配対象収益は280,746,037円(1万円当たり3,332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

1万円当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

- ・「受益権の申込単位および価額」、「信託契約の一部解約」の各条文について、指定販売会社における投資者からの申込形態を考慮して誤解を招くことのない文言とするため、約款に所要の変更を行いました。(2024年1月17日)

RM S&P500マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2024年6月25日）
（2023年6月27日～2024年6月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2020年7月29日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、米国の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式のうち、S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、S&P500（配当込み、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。なお、S&P500（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、米国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、米国の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>②株式（ETF、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
主要投資対象	<p>・米国の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式*のうち、S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式</p> <p>*DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。</p>
主な投資制限	<p>・株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

りそなアセットマネジメント 株式会社

【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		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株 先物比 率	投資信託 組入比 率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	(ベンチ マーク)	期 騰 落 中 率				
(設定日)	円	%		%	%	%	%	百万円
2020年7月29日	10,000	—	699,762.56	—	—	—	—	200
1期(2021年6月25日)	14,043	40.4	985,265.43	40.8	91.1	7.7	2.4	1,193
2期(2022年6月27日)	15,772	12.3	1,111,572.08	12.8	88.3	9.3	2.6	5,098
3期(2023年6月26日)	18,934	20.0	1,340,029.49	20.6	93.8	4.3	2.2	7,763
4期(2024年6月25日)	26,693	41.0	1,895,259.94	41.4	96.6	1.7	2.0	31,208

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) S & P 5 0 0（配当込み、円換算ベース）は、S & P 5 0 0（配当込み）をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。

S&P500[®]とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等の上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S&P500[®]はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これの使用ライセンスがリそなアセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P[®]、S&P 500[®]、US 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、リそなアセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、また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、または中断に対しても一切責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) (ベンチマーク)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2023年6月26日	18,934	—	1,340,029.49	—	93.8	4.3	2.2
6月末	19,345	2.2	1,369,207.93	2.2	93.0	4.9	2.2
7月末	19,615	3.6	1,388,838.49	3.6	90.1	7.8	2.1
8月末	20,070	6.0	1,421,496.12	6.1	92.1	5.1	2.2
9月末	19,575	3.4	1,386,839.08	3.5	93.1	5.0	2.1
10月末	18,976	0.2	1,344,612.59	0.3	93.3	5.1	2.1
11月末	20,413	7.8	1,446,995.14	8.0	91.7	6.3	2.1
12月末	20,714	9.4	1,468,875.58	9.6	92.8	5.0	2.3
2024年1月末	22,204	17.3	1,574,793.46	17.5	94.8	2.9	2.1
2月末	23,366	23.4	1,657,701.99	23.7	91.1	6.8	2.0
3月末	24,361	28.7	1,728,803.32	29.0	92.0	6.4	2.0
4月末	24,597	29.9	1,745,713.49	30.3	96.8	1.3	2.0
5月末	25,175	33.0	1,787,165.50	33.4	95.3	3.0	2.0
(期 末)							
2024年6月25日	26,693	41.0	1,895,259.94	41.4	96.6	1.7	2.0

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年6月27日～2024年6月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の変動要因

ベンチマークであるS & P 5 0 0（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。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

米国株式市況

米国の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期初は、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め長期化と利下げの思惑が交錯し、相場が不安定化する局面もみられましたが、その後は景気軟着陸に対する期待が高まり、米国の株式市場は上昇基調となりました。また、AI（人工知能）関連銘柄を中心に、底堅い決算内容を発表する企業が相次いだことで、S & P 5 0 0などは最高値を更新しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円安となりました。

インフレ抑制を目指すFRBが金融引き締め策を継続する一方、日銀は金融緩和策を維持したことなどから、円安が進行しました。その後、日米金利差の縮小を背景に円高となりましたが、日銀がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する姿勢を示したことなどから、再度円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式を主要投資対象とし、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っていません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+41.0%となり、ベンチマークの+41.4%を0.5%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

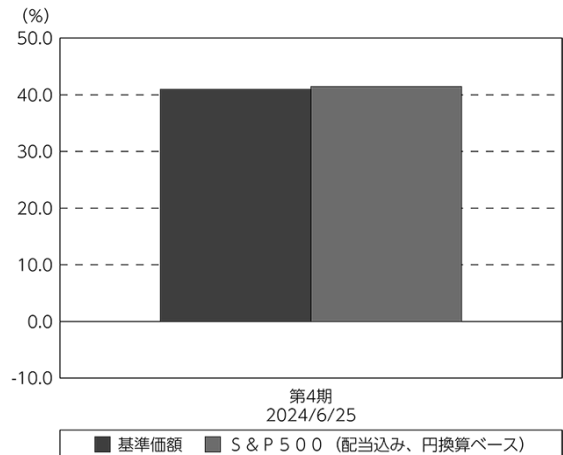
（マイナス要因）

- ・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）

- ・株式の取引価格と評価に用いる価格が異なったこと
- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてS&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式に投資し、S&P500（配当込み、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。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○1万口当たりの費用明細

(2023年6月27日～2024年6月25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) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 3 (2) (0) (1)	% 0.012 (0.008) (0.000) (0.004)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 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) (そ の 他)	10 (10) (0)	0.048 (0.048) (0.000)	(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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	13	0.060	
期中の平均基準価額は、21,534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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年6月27日～2024年6月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 8,783 (1,034)	千米ドル 115,251 (323)	百株 85 (8)	千米ドル 598 (330)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()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。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	420	50	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	1,312	250	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	384	70	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	420	26	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	245	24	—	—
	CROWN CASTLE INC	1,229	125	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	918	128	—	—
	EQUINIX INC	271	214	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	961	59	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	171	40	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	691	97	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	232	23	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,113	38	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	2,070	38	—	—
	INVITATION HOMES INC	1,694	58	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	833	61	—	—
	KIMCO REALTY CORP	2,035	38	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	334	44	—	—
	PROLOGIS INC	2,600	311	—	—
	PUBLIC STORAGE	447	123	—	—
	REALTY INCOME CORP	2,700	144	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	464	28	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	302	62	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	919	128	—	—
	UDR INC	793	30	—	—
	VENTAS INC	1,157	52	—	—
	VICI PROPERTIES INC	3,032	89	—	—
WELLTOWER INC	1,803	167	—	—	
WEYERHAEUSER CO	1,824	59	—	—	
小計	32,374	2,590	—	—	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		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 16,308	百万円 16,342	百万円 —	百万円 —

(注) 外国の取引金額は、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金額の合計です。

○株式売買比率

(2023年6月27日～2024年6月25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	17,746,377千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,318,444千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.33

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、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金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月27日～2024年6月25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 (2023年6月27日～2024年6月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年6月25日現在)

外国株式

銘柄	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AES CORP	9	30	57	9,114	公益事業
AT&T INC	101	302	564	90,086	電気通信サービス
ABBVIE INC	25	74	1,286	205,339	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADVANCE AUTO PARTS INC	0.76	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4	12	167	26,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALASKA AIR GROUP INC	1	—	—	—	運輸
ALTRIA GROUP INC	25	73	341	54,467	食品・飲料・タバコ
CENCORA INC	2	7	167	26,772	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1	4	184	29,510	金融サービス
ARISTA NETWORKS INC	3	10	352	56,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	0.6	2	36	5,778	保険
BAKER HUGHES COMPANY	15	42	144	23,065	エネルギー
BATH & BODY WORKS INC	3	8	36	5,860	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.3	0.87	24	3,940	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	2	5	471	75,213	金融サービス
BLACKSTONE INC	—	29	374	59,719	金融サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	20	62	476	75,984	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	7	22	200	31,960	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	30	85	361	57,652	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1	5	101	16,199	商業・専門サービス
BROWN & BROWN INC	2	9	93	14,878	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2	7	32	5,224	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	4	70	11,278	資本財
CBRE GROUP INC - A	4	12	114	18,215	不動産管理・開発
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2	8	64	10,301	素材
CIGNA GROUP/THE	4	12	417	66,577	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	4	12	76	12,246	公益事業
CSX CORP	29	82	273	43,568	運輸
ALBEMARLE CORP	1	4	48	7,675	素材
CVS HEALTH CORP	18	52	323	51,651	ヘルスケア機器・サービス
COTERRA ENERGY INC	10	31	86	13,804	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	3	7	34	5,453	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5	15	218	34,929	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	3	10	108	17,290	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	2	6	49	7,881	一般消費財・サービス流通・小売り
CARNIVAL CORP	12	40	66	10,635	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	12	34	226	36,082	資本財
CATALENT INC	2	7	41	6,640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	7	20	681	108,732	資本財
CELANESE CORP	1	4	56	9,052	素材
CENTENE CORP	7	22	153	24,524	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	8	27	84	13,513	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1	6	31	4,967	商業・専門サービス
CHARLES RIVER LABORATORIES	0.62	2	45	7,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEVRON CORP	24	72	1,151	183,706	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.39	1	370	59,112	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3	10	111	17,801	家庭用品・パーソナル用品
CITIGROUP INC	27	80	494	78,837	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6	18	67	10,695	銀行
ALLIANT ENERGY CORP	3	10	55	8,859	公益事業
CLOROX COMPANY	1	5	68	10,881	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	55	163	1,046	166,966	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	11	34	343	54,776	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	4	11	180	28,842	保険
COMERICA INC	1	—	—	—	銀行
CONAGRA BRANDS INC	7	20	59	9,484	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	17	49	567	90,596	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	4	14	134	21,480	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2	6	180	28,766	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	0.68	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	11	32	130	20,754	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORPAY INC	—	2	80	12,822	金融サービス
CORTEVA INC	9	29	155	24,862	素材
CUMMINS INC	2	5	164	26,279	資本財
DR HORTON INC	4	12	180	28,776	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	2	8	98	15,748	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	9	27	714	113,933	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMEREN CORPORATION	3	11	80	12,805	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	1	5	77	12,419	消費者サービス
DAVITA INC	0.55	2	31	5,073	ヘルスケア機器・サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	—	1	108	17,322	耐久消費財・アパレル
DEERE & CO	3	10	413	66,012	資本財
DELTA AIR LINES INC	9	26	133	21,234	運輸
DEVON ENERGY CORP	8	27	129	20,630	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	25	76	784	125,163	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3	10	134	21,511	金融サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	7	22	195	31,235	公益事業
EVEREST GROUP LTD	0.62	1	67	10,727	保険
DOLLAR GENERAL CORP	3	9	121	19,342	生活必需品流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	11	35	176	28,217	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	0.55	1	78	12,596	消費者サービス
AMERICAN EXPRESS CO	8	23	555	88,566	金融サービス
DOVER CORP	1	5	107	17,182	資本財
DOW INC	9	29	162	25,892	素材
DUKE ENERGY CORP	10	32	327	52,186	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	6	17	140	22,368	素材
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	10	27	212	33,946	保険
EOG RESOURCES INC	8	24	304	48,582	エネルギー
EQT CORP	4	18	71	11,407	エネルギー
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3	9	153	24,457	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	1	4	50	8,013	素材
ECOLAB INC	3	10	260	41,572	素材
BUNGE LTD	2	—	—	—	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	5	16	118	18,877	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8	25	229	36,573	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	24	73	773	123,374	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
EMERSON ELECTRIC CO	8	23	261	41,671	資本財
ENTERGY CORP	3	9	97	15,522	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	0.78	2	45	7,186	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	1	5	126	20,247	商業・専門サービス
EVERGY INC	3	9	48	7,681	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	5	15	88	14,103	公益事業
EXELON CORP	13	42	149	23,811	公益事業
EXXON MOBIL CORP	57	189	2,157	344,266	エネルギー
FMC CORP	1	4	28	4,476	素材
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.6	1	65	10,372	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	0.39	1	149	23,920	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2	8	108	17,357	公益事業
AMETEK INC	3	9	168	26,838	資本財
FEDEX CORP	3	9	245	39,209	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	9	23	178	28,521	金融サービス
AMPHENOL CORP-CL A	8	50	341	54,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FISERV INC	8	24	374	59,774	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	8	21	84	13,453	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	—	—	—	金融サービス
FORD MOTOR CO	55	165	201	32,212	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	5	14	110	17,709	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	4	11	27	4,417	金融サービス
FREEMPORT-MCMORAN INC	20	60	302	48,288	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2	9	241	38,463	保険
GARTNER INC	1	3	147	23,536	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	3	9	527	84,187	ヘルスケア機器・サービス
GE VERNOVA INC	—	11	206	32,971	資本財
GENERAC HOLDINGS INC	0.69	2	34	5,565	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	3	9	286	45,775	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	15	46	741	118,370	資本財
GENERAL MILLS INC	8	23	162	25,904	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	19	48	232	37,169	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	1	5	84	13,440	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBAL PAYMENTS INC	3	11	107	17,155	金融サービス
GLOBE LIFE INC	1	3	29	4,727	保険
GODADDY INC - CLASS A	—	5	82	13,162	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4	13	628	100,348	金融サービス
WW GRAINGER INC	0.62	1	169	27,024	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7	21	133	21,254	食品・飲料・タバコ
HCA HEALTHCARE INC	3	8	282	45,045	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	13	36	132	21,135	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	13	37	129	20,651	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4	12	132	21,176	保険
HERSHEY CO/THE	2	6	119	19,096	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	3	11	175	27,927	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	17	55	112	18,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3	10	228	36,466	消費者サービス
HOME DEPOT INC	14	41	1,467	234,135	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9	27	589	94,110	資本財
HORMEL FOODS CORP	4	11	35	5,621	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	5	16	130	20,814	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HUBBELL INC	—	2	86	13,808	資本財
HUMANA INC	1	5	182	29,135	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	0.55	1	40	6,493	資本財
IDEX CORP	1	3	67	10,800	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	3	11	275	43,933	資本財
INGERSOLL-RAND INC	6	17	158	25,352	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7	24	335	53,608	金融サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12	38	678	108,235	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3	11	107	17,222	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	4	14	69	11,106	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	6	15	46	7,439	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	2	7	164	26,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	41	121	2,409	384,448	銀行
JABIL INC	—	4	56	8,977	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACOBS SOLUTIONS INC	1	5	72	11,539	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	37	101	1,514	241,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	4	13	49	7,825	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KKR & CO INC	—	28	301	48,185	金融サービス
KELLANOVA	3	10	62	9,974	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	—	80	151	24,237	家庭用品・パーソナル用品
KEURIG DR PEPPER INC	12	44	152	24,401	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	12	40	55	8,933	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2	7	101	16,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	4	14	199	31,764	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	30	81	163	26,090	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	1	6	71	11,468	公益事業
KROGER CO	9	28	141	22,538	生活必需品流通・小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2	8	181	28,891	資本財
LABCORP HOLDINGS INC	—	3	71	11,383	ヘルスケア機器・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2	6	51	8,295	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	5	14	66	10,660	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3	9	113	18,076	家庭用品・パーソナル用品
LEIDOS HOLDINGS INC	2	5	82	13,155	商業・専門サービス
LENNAR CORP-A	3	10	155	24,856	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	11	33	2,997	478,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	0.26	0.73	217	34,774	一般消費財・サービス流通・小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	1	—	—	—	保険
EVERETT DENNISON CORP	1	3	75	11,975	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2	6	53	8,599	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	3	8	421	67,259	資本財
LOEWS CORP	2	7	59	9,451	保険
LOWE'S COS INC	8	24	552	88,080	一般消費財・サービス流通・小売り
M & T BANK CORP	2	7	105	16,898	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4	10	45	7,261	消費者サービス
MSCI INC	1	3	163	26,146	金融サービス
MARATHON OIL CORP	8	25	72	11,638	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	5	14	258	41,226	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	7	20	448	71,535	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.86	2	140	22,450	素材
MASCO CORP	3	9	65	10,440	資本財

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MASTERCARD INC-CLASS A	12	34	1,582	252,496	金融サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3	10	70	11,262	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	10	30	791	126,342	消費者サービス
MCKESSON CORP	1	5	332	53,049	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	4	13	84	13,490	素材
MERCK & CO. INC.	36	106	1,420	226,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	9	25	181	28,998	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.34	0.91	132	21,111	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	99	287	1,149	183,343	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.57	2	25	4,048	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	0.8	2	76	12,275	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2	7	37	5,970	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	2	6	279	44,552	金融サービス
MORGAN STANLEY	18	52	512	81,819	金融サービス
MOSAIC CO/THE	5	13	39	6,344	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2	7	273	43,602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	3	9	74	11,868	公益事業
NVR INC	0.05	0.13	100	16,056	耐久消費財・アパレル
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9	31	187	29,990	金融サービス
NEWELL RUBBERMAID INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	11	48	207	33,068	素材
NEXTERA ENERGY INC	29	86	640	102,139	公益事業
NIKE INC -CL B	17	51	496	79,258	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	5	18	54	8,746	公益事業
NORFOLK SOUTHERN CORP	3	9	209	33,427	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	2	5	254	40,543	資本財
NUCOR CORP	3	10	157	25,143	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10	28	177	28,258	エネルギー
OMNICOM GROUP	3	8	75	12,001	メディア・娯楽
ONEOK INC	6	24	198	31,724	エネルギー
ORACLE CORP	21	67	940	150,107	ソフトウェア・サービス
ORGANON & CO	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTIS WORLDWIDE CORP	5	17	165	26,477	資本財
P G & E CORP	24	90	159	25,502	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5	16	257	41,102	銀行
PPG INDUSTRIES INC	3	10	129	20,631	素材
PPL CORP	10	32	90	14,432	公益事業
PACKAGING CORP OF AMERICA	1	3	68	10,960	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	4	13	431	68,922	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	1	5	273	43,642	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	0.67	2	30	4,812	商業・専門サービス
PEPSICO INC	19	58	974	155,549	食品・飲料・タバコ
REVVITY INC	1	5	55	8,920	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	79	239	678	108,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	7	21	74	11,816	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	22	65	668	106,628	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	6	17	248	39,682	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	1	4	34	5,437	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3	—	—	—	エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3	9	73	11,736	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	33	99	1,677	267,676	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PROGRESSIVE CORP	8	24	520	83,031	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5	15	180	28,785	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6	21	157	25,094	公益事業
PULTEGROUP INC	3	8	96	15,390	耐久消費財・アパレル
QUANTA SERVICES INC	2	6	170	27,128	資本財
QUEST DIAGNOSTICS INC	1	4	68	10,874	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	0.51	1	28	4,520	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2	7	96	15,426	金融サービス
RTX CORP	20	56	572	91,348	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	4	12	284	45,396	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	12	38	75	12,000	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	3	8	168	26,960	商業・専門サービス
RESMED INC	2	6	113	18,140	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INC	1	—	—	—	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	1	4	129	20,659	資本財
ROLLINS INC	2	12	60	9,582	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	4	13	601	95,920	金融サービス
SALESFORCE INC	14	40	983	156,891	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	20	59	282	45,114	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	21	63	469	74,931	金融サービス
SEALED AIR CORP	1	—	—	—	素材
SEMPRA	4	26	203	32,398	公益事業
SERVICENOW INC	2	8	639	102,077	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3	9	296	47,284	素材
SMITH (A.O.) CORP	1	4	40	6,452	資本財
JM SMUCKER CO/THE	1	4	50	8,031	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	0.67	2	60	9,599	資本財
SOLVENTUM CORP	—	5	30	4,837	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHERN CO/THE	15	46	366	58,410	公益事業
WR BERKLEY CORP	3	8	71	11,454	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	8	25	72	11,646	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	25	76	3,161	504,393	金融サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	2	6	55	8,896	資本財
STATE STREET CORP	4	12	92	14,838	金融サービス
STRYKER CORP	4	14	485	77,474	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	3	8	73	11,702	一般消費財・サービス流通・小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	5	16	74	11,868	金融サービス
SYSCO CORP	7	21	156	25,001	生活必需品流通・小売り
TJX COMPANIES INC	16	47	531	84,768	一般消費財・サービス流通・小売り
TAPESTRY INC	3	9	38	6,211	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	6	19	292	46,598	生活必需品流通・小売り
TARGA RESOURCES CORP	3	9	119	19,144	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.65	2	78	12,547	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	0.58	1	38	6,149	ヘルスケア機器・サービス
TEXTRON INC	3	7	69	11,041	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5	16	911	145,387	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	7	23	238	38,026	資本財
TRANSIGM GROUP INC	0.73	2	314	50,221	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	3	9	202	32,334	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	18	56	212	33,836	銀行

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.64	1	88	14,118	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	4	11	67	10,712	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	19	65	263	42,075	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	88	622	99,362	運輸
UNION PACIFIC CORP	8	25	583	93,112	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	10	30	427	68,202	運輸
UNITED RENTALS INC	1	2	181	29,039	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	13	38	1,902	303,577	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1	2	45	7,284	ヘルスケア機器・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3	9	252	40,328	素材
VF CORP	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	5	13	207	33,117	エネルギー
VERALTO CORP	—	9	94	15,136	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	59	177	731	116,719	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	23	66	1,834	292,777	金融サービス
VISTRA CORP	—	13	118	18,977	公益事業
VULCAN MATERIALS CO	2	5	138	22,082	素材
WEC ENERGY GROUP INC	4	13	105	16,902	公益事業
WABTEC CORP	2	7	123	19,697	資本財
WALMART INC	19	180	1,241	198,073	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	5	15	325	51,930	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.81	2	72	11,585	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & CO	54	147	868	138,551	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1	2	98	15,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTROCK CO	2	10	55	8,926	素材
WHIRLPOOL CORP	0.83	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	17	50	219	35,025	エネルギー
BOEING CO/THE	7	24	436	69,671	資本財
XCEL ENERGY INC	7	23	127	20,361	公益事業
XYLEM INC	3	10	142	22,691	資本財
YUM! BRANDS INC	3	11	159	25,441	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2	8	91	14,554	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	6	19	328	52,369	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	3	9	31	5,098	自動車・自動車部品
INVESCO LTD	4	19	29	4,673	金融サービス
CHUBB LTD	5	17	455	72,737	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3	10	106	16,929	素材
ACCENTURE PLC-CL A	8	26	815	130,045	ソフトウェア・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	4	12	195	31,197	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	4	11	86	13,864	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	5	16	543	86,799	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4	17	30	4,853	消費者サービス
ALLEGION PLC	1	3	40	6,460	資本財
STERIS PLC	1	4	90	14,478	ヘルスケア機器・サービス
AMCOR PLC	20	61	61	9,782	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3	9	320	51,148	資本財
AON PLC	2	9	273	43,669	保険
PENTAIR PLC	2	7	56	9,063	資本財
LINDE PLC	7	20	898	143,394	素材
BUNGE GLOBAL SA	—	6	69	11,011	食品・飲料・タバコ
MEDTRONIC PLC	18	56	454	72,515	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9	28	196	31,393	資本財
ACTIVISION BLIZZARD INC	10	—	—	—	メディア・娯楽
ADOBE INC	6	18	990	158,073	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	22	68	1,092	174,358	半導体・半導体製造装置
AIRBNB INC-CLASS A	—	18	276	44,134	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2	6	57	9,132	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	2	68	10,856	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	72	206	3,726	594,620	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	84	247	4,440	708,531	メディア・娯楽
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10	28	31	5,062	運輸
ANSYS INC	1	3	118	18,905	ソフトウェア・サービス
APA CORP	4	15	44	7,064	エネルギー
AXON ENTERPRISE INC	1	3	88	14,104	資本財
BIOGEN INC	2	6	139	22,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	1	6	49	7,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	0.52	1	573	91,474	消費者サービス
BROADCOM INC	5	18	2,926	466,949	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1	4	76	12,165	金融サービス
CDW CORP/DE	2	5	131	20,953	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1	4	40	6,509	運輸
CME GROUP INC	5	15	296	47,312	金融サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	3	11	355	56,676	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3	8	34	5,505	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1	4	118	18,973	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2	6	76	12,280	保険
CISCO SYSTEMS INC	58	170	807	128,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	1	3	257	41,067	商業・専門サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7	21	144	23,023	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	59	165	635	101,406	メディア・娯楽
CONSTELLATION ENERGY	5	13	289	46,135	公益事業
COOPER COS INC/THE	—	8	75	12,108	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	5	36	202	32,297	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	6	18	1,586	253,206	生活必需品流通・小売り
COSTAR GROUP INC	6	17	127	20,336	不動産管理・開発
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	9	368	58,734	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	127	386	7,168	1,143,816	一般消費財・サービス流通・小売り
DENTSPLY SIRONA INC	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	5	16	185	29,674	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	2	7	148	23,729	エネルギー
DOLLAR TREE INC	2	8	93	14,970	生活必需品流通・小売り
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5	15	161	25,774	保険
EBAY INC	7	20	112	18,011	一般消費財・サービス流通・小売り
ELECTRONIC ARTS INC	3	10	144	23,030	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	2	5	58	9,376	半導体・半導体製造装置
ETSY INC	1	4	28	4,543	一般消費財・サービス流通・小売り
EXPEDIA GROUP INC	2	5	68	11,001	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	2	5	74	11,953	運輸
META PLATFORMS INC-CLASS A	31	92	4,611	735,798	メディア・娯楽
AMGEN INC	7	22	719	114,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	8	24	157	25,186	資本財
F5 INC	0.75	2	39	6,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FIFTH THIRD BANCORP	10	29	106	17,000	銀行
ANALOG DEVICES INC	7	20	478	76,296	半導体・半導体製造装置
FIRST SOLAR INC	1	4	118	18,885	半導体・半導体製造装置
FORTINET INC	9	26	156	24,912	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	4	10	34	5,509	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	1	4	15	2,538	メディア・娯楽
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	5	17	141	22,570	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	17	52	371	59,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	211	607	12,654	2,019,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	11	35	805	128,576	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	1	6	37	5,993	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1	3	51	8,205	金融サービス
HOLOGIC INC	3	9	68	10,963	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1	3	55	8,847	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	19	61	79	12,762	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	1	3	171	27,369	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	2	7	50	8,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	1	2	60	9,697	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	58	179	549	87,633	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	3	11	736	117,564	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	4	14	642	102,481	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	1	5	450	71,958	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	12	34	113	18,048	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	3	11	48	7,667	一般消費財・サービス流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	1	5	565	90,227	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	3	9	215	34,460	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5	17	431	68,788	商業・専門サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	—	4	151	24,116	耐久消費財・アパレル
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.51	1	31	5,042	金融サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3	10	252	40,295	消費者サービス
MATCH GROUP INC	4	11	35	5,587	メディア・娯楽
MICROSOFT CORP	106	313	14,033	2,239,194	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8	22	203	32,486	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	15	46	649	103,649	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	4	14	192	30,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19	56	383	61,179	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	0.68	2	164	26,234	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	10	29	146	23,421	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	4	16	96	15,439	金融サービス
NETAPP INC	3	8	110	17,684	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	6	18	1,216	194,069	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS A	3	15	41	6,601	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	0.74	5	14	2,263	メディア・娯楽
NORDSON CORP	0.68	2	53	8,598	資本財
NORTHERN TRUST CORP	2	8	68	10,979	金融サービス
GEN DIGITAL INC	7	21	52	8,337	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	35	1,037	12,254	1,955,271	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.88	2	267	42,702	一般消費財・サービス流通・小売り
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1	7	132	21,154	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	6	17	121	19,340	半導体・半導体製造装置

銘柄	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PTC INC	1	5	90	14,367	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	7	21	233	37,334	資本財
PAYCHEX INC	4	13	171	27,339	商業・専門サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	16	44	265	42,401	金融サービス
POOL CORP	0.6	1	55	8,842	一般消費財・サービス流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	3	9	112	17,925	金融サービス
QORVO INC	1	4	46	7,427	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	15	47	947	151,161	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	1	4	476	76,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROPER TECHNOLOGIES INC	—	4	254	40,571	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	4	14	211	33,816	一般消費財・サービス流通・小売り
HENRY SCHEIN INC	1	5	35	5,710	ヘルスケア機器・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2	6	71	11,388	半導体・半導体製造装置
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	0.76	—	—	—	半導体・半導体製造装置
STARBUCKS CORP	16	47	381	60,822	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	2	6	77	12,417	素材
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	2	176	28,105	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNOPSYS INC	2	6	383	61,201	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	8	21	387	61,841	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	6	107	17,099	メディア・娯楽
TERADYNE INC	2	6	96	15,348	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	38	117	2,136	340,878	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	12	38	745	118,872	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1	4	127	20,314	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE INC	3	10	56	9,063	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ULTA BEAUTY INC	0.77	1	76	12,250	一般消費財・サービス流通・小売り
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	5	13	65	10,444	運輸
VERISIGN INC	1	3	64	10,224	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	2	6	164	26,234	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3	10	517	82,527	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARAMOUNT GLOBAL	7	20	21	3,444	メディア・娯楽
VIATRIS INC	18	50	52	8,433	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	10	30	48	7,669	生活必需品流通・小売り
WARNER BROS DISCOVERY INC	33	94	68	11,009	メディア・娯楽
WESTERN DIGITAL CORP	5	13	104	16,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	1	3	33	5,345	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.81	2	63	10,179	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	1	—	—	—	銀行
GARMIN LTD	2	6	107	17,116	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	3	10	285	45,588	半導体・半導体製造装置
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1	4	114	18,323	保険
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2	8	85	13,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
合 計	株 数	金 額	188,984	30,154,383	
	銘柄 数	< 比 率 >	—	< 96.6% >	

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

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	245	665	78	12,523	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	658	1,970	386	61,731	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	216	600	123	19,760	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	182	602	37	5,973	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	174	419	46	7,427	0.0	
CROWN CASTLE INC	606	1,835	178	28,526	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	442	1,360	199	31,901	0.1	
EQUINIX INC	130	401	301	48,128	0.2	
EQUITY RESIDENTIAL	529	1,490	103	16,449	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	91	262	73	11,671	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	208	899	143	22,855	0.1	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	77	309	31	4,983	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	864	2,977	58	9,333	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	913	2,983	54	8,619	0.0	
INVITATION HOMES INC	804	2,498	89	14,289	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	405	1,238	110	17,598	0.1	
KIMCO REALTY CORP	789	2,824	54	8,624	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	160	494	70	11,296	0.0	
PROLOGIS INC	1,307	3,907	436	69,590	0.2	
PUBLIC STORAGE	221	668	195	31,156	0.1	
REALTY INCOME CORP	976	3,676	197	31,462	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	216	680	42	6,755	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	166	468	92	14,723	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	454	1,373	206	32,959	0.1	
UDR INC	489	1,282	52	8,419	0.0	
VENTAS INC	554	1,711	86	13,838	0.0	
VICI PROPERTIES INC	1,390	4,422	125	20,059	0.1	
WELLTOWER INC	721	2,524	259	41,469	0.1	
WEYERHAEUSER CO	1,135	2,959	85	13,710	0.0	
合 計	口 数 ・ 金 額	15,122	47,496	3,922	625,841	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	29	—	< 2.0% >	

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	SP500MIN2409	484	—
		SP500MIC2409	52	—
			百万円	百万円

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2024年6月25日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
株式	30,154,383	96.6%
投資証券	625,841	2.0
コール・ローン等、その他	433,711	1.4
投資信託財産総額	31,213,935	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産 (31,106,858千円) の投資信託財産総額 (31,213,935千円) に対する比率は99.7%です。

(注) 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。1米ドル=159.56円。

○特定資産の価格等の調査

(2023年6月27日～2024年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	31,425,780,546
コール・ローン等	188,620,894
株式(評価額)	30,154,383,880
投資証券(評価額)	625,841,731
未収入金	212,151,861
未収配当金	24,005,911
未収利息	27
差入委託証拠金	220,776,242
(B) 負債	217,141,322
未払金	217,141,322
(C) 純資産総額(A-B)	31,208,639,224
元本	11,691,838,125
次期繰越損益金	19,516,801,099
(D) 受益権総口数	11,691,838,125口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,693円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,100,192,802円、期中追加設定元本額は8,024,305,201円、期中一部解約元本額は432,659,878円です。

(注) 2024年6月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・Smart-i S&P500インデックス 10,406,716,586円
- ・りそなマルチアセットファンド202310 (適格機関投資家専用) 509,514,467円
- ・りそなS&P500インデックス 420,173,979円
- ・りそなマルチアセットファンド202403 (適格機関投資家専用) 355,433,093円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は2.6693円です。

○損益の状況 (2023年6月27日～2024年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	216,489,885
受取配当金	206,613,766
受取利息	5,661,443
その他収益金	4,261,343
支払利息	△ 46,667
(B) 有価証券売買損益	5,613,233,501
売買益	6,038,843,498
売買損	△ 425,609,997
(C) 先物取引等取引損益	152,561,738
取引益	214,306,831
取引損	△ 61,745,093
(D) 保管費用等	△ 6,561,096
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	5,975,724,028
(F) 前期繰越損益金	3,663,012,794
(G) 追加信託差損益金	10,434,464,899
(H) 解約差損益金	△ 556,400,622
(I) 計(E+F+G+H)	19,516,801,099
次期繰越損益金(I)	19,516,801,099

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

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。