

運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2021年2月15日>

世界株配当収益追求ファンド (価格変動抑制型)

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/内外/株式/特殊型 (絶対収益追求型)
信託期間	2016年10月24日から2027年8月16日までです。
運用方針	安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	<p>世界株配当収益追求ファンド (価格変動抑制型) グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型) マザーファンド受託証券を主要投資対象とします。</p> <p>グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型) マザーファンド 日本を含む先進国の株式、株価指数先物を主要投資対象とします。</p>
運用方法	<p>主として、日本を含む先進国の株式、株価指数先物へマザーファンドへの投資を通じて実質的に投資します。</p> <p>現物株式の実質的な組入比率は、純資産総額の90%程度を基本とします。</p> <p>現金等^{※1}を活用し、基準価額の変動リスクを年率3%程度^{※2}に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>※1 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAマナーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。</p> <p>※2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれも約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率3%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる場合があります。</p> <p>マザーファンドの運用においては、独自の定量モデルを活用し、地域、業種、銘柄分散等によって、リスク対比インカム収益が高いポートフォリオを構築します。株価指数先物^{※3}を活用して株式市場全体の価格変動による影響を極力排除し、安定的にインカム収益 (配当金) を獲得することをめざします。</p> <p>※3 株価指数先物は、ヘッジ目的で利用することとし、当該先物の投資合計額は、原則として信託財産の純資産総額の範囲内となるようにします。ただし、市場環境、運用環境等により純資産総額の範囲を超える場合があります。</p> <p>実質的な組入外貨建て資産については、対円での為替ヘッジを行うことを基本とします。</p>
組入制限	マザーファンド受託証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	決算日 (原則として2月、8月の各15日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、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は分配を行わない場合があります。

愛称：はいとろドリ

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「世界株配当収益追求ファンド (価格変動抑制型)」は、2021年2月15日に第9期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

世界株配当収益追求ファンド（価格変動抑制型）

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配 金	騰落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
5期（2019年2月15日）	9,532	10	△1.0	81.3	△69.5	—	1,523
6期（2019年8月15日）	9,165	10	△3.7	77.4	△68.1	—	990
7期（2020年2月17日）	9,080	10	△0.8	79.0	△71.5	—	642
8期（2020年8月17日）	8,802	10	△3.0	71.7	△68.0	—	557
9期（2021年2月15日）	8,627	10	△1.9	83.1	△81.9	—	463

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」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。

(注4) 当ファンドの運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
	騰落率				
(期首) 2020年8月17日	円	%	%	%	%
8月末	8,802	—	71.7	△68.0	—
9月末	8,716	△1.0	72.8	△69.9	—
10月末	8,742	△0.7	70.9	△67.6	—
11月末	8,734	△0.8	70.8	△67.5	—
12月末	8,684	△1.3	81.7	△80.2	—
2021年1月末	8,679	△1.4	73.4	△71.8	—
(期末) 2021年2月15日	8,687	△1.3	76.3	△74.6	—
	8,637	△1.9	83.1	△81.9	—

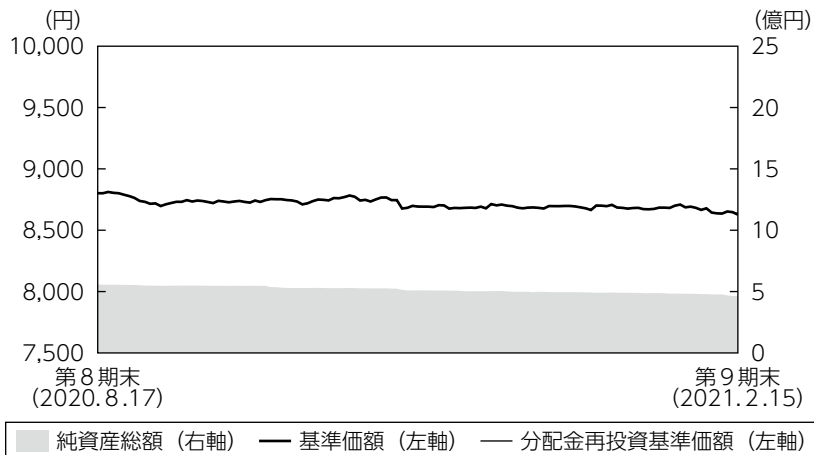
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」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。

■当期の運用経過（2020年8月18日から2021年2月15日まで）

基準価額等の推移



第9期首： 8,802円
第9期末： 8,627円
(既払分配金10円)
騰落率： $\Delta 1.9\%$
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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、ファンドの購入価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。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当ファンドが選好する配当利回りの高い（安定的に配当を得られる蓋然性が高い）銘柄群に加えて、リスク対比配当利回りを高める観点から銘柄選択時に考慮している相対的にリスクが低い銘柄群も市場平均に対して軟調に推移したため、基準価額は下落しました。

投資環境

先進国株式市場は、新型コロナウイルスの感染拡大が収束し経済活動が再開する中、上昇基調となりました。2020年9月以降は高値警戒感や11月の米国大統領選挙の不透明感から調整局面を迎えたものの、米国大統領選挙後はバイデン新政権の経済対策期待や新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などが好感され高値を更新する動きとなりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドの主要投資対象はグローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンド

銘柄選択については、当ファンドが着目するリスク対比配当利回りが高いと考えられる銘柄を選別する基本方針のもと株式ポートフォリオを構築しました。あわせて、先物の売り建てを行うことで、ポートフォリオ全体のリスクの抑制を図りました。

【グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○組入上位10銘柄（現物）

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	T ROWE PRICE GROUP INC	アメリカ・ドル	1.3%
2	PACCAR INC	アメリカ・ドル	1.2
3	INVESTOR AB-B SHS	スウェーデン・クローナ	1.2
4	SANOFI	ユーロ	1.2
5	N T T ドコモ	日本・円	1.2
6	本田技研工業	日本・円	1.2
7	SYNOPSIS INC	アメリカ・ドル	1.2
8	SIEMENS AG-REG	ユーロ	1.1
9	RIO TINTO PLC	イギリス・ポンド	1.1
10	AT&T INC	アメリカ・ドル	0.9
組入銘柄数		278銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	SYNOPSIS INC	アメリカ・ドル	1.5%
2	RIO TINTO PLC	イギリス・ポンド	1.4
3	本田技研工業	日本・円	1.3
4	INVESTOR AB-B SHS	スウェーデン・クローナ	1.3
5	SANOFI	ユーロ	1.2
6	PACCAR INC	アメリカ・ドル	1.2
7	富士通	日本・円	1.1
8	IBERDROLA SA	ユーロ	1.1
9	T ROWE PRICE GROUP INC	アメリカ・ドル	1.1
10	CUMMINS INC	アメリカ・ドル	1.1
組入銘柄数		268銘柄	

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年8月18日 ～2021年2月15日
当期分配金（税引前）	10円
対基準価額比率	0.12%
当期の収益	10円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	468円

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が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、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続きグローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンド

株式市場全体の価格変動による影響をできるだけ排除し、安定的に配当収益を獲得することをめざします。具体的には、当ファンドが着目するリスク対比配当利回りが高いと考えられる銘柄を選別する基本方針を堅持することで、安定的なリターンの獲得に努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2020年8月18日 ～2021年2月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	40円	0.455%	(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8,713円です。
(投信会社)	(19)	(0.219)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(19)	(0.219)	販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価
(受託会社)	(1)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.039	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(2)	(0.018)	
(先物・オプション)	(2)	(0.021)	
(c) 有価証券取引税	3	0.033	(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)	(3)	(0.033)	
(d) その他費用	26	0.295	(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)	(25)	(0.292)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	72	0.822	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によ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。

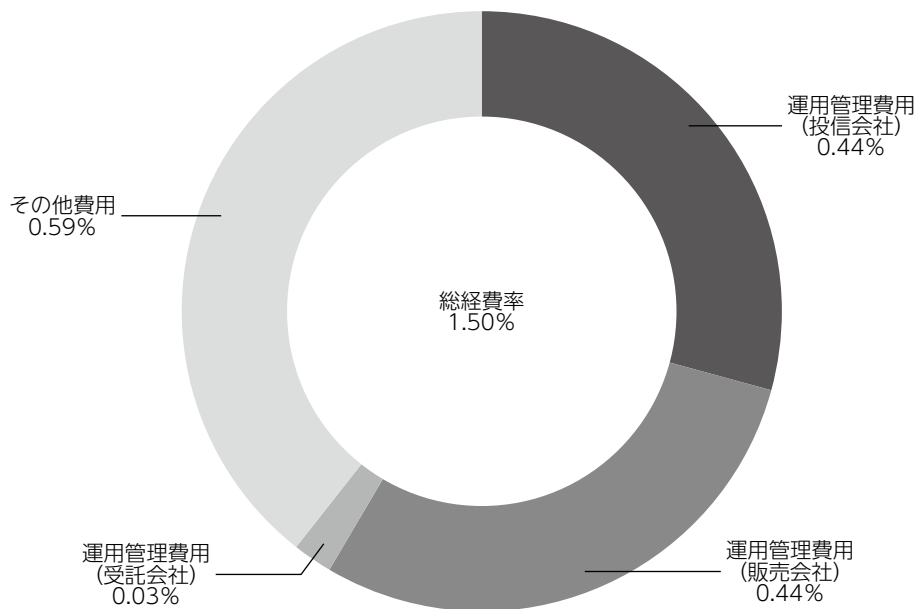
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.50%です。



(注1) 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) 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異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年8月18日から2021年2月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
グローバル株式スマートインカムプラス戦略 （リスク抑制型）マザーファンド	10,996	10,000	38,533	35,000

■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	グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	527,508千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	383,581千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年8月18日から2021年2月15日まで）

【世界株配当収益追求ファンド（価格変動抑制型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	201千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	15千円
(B)／(A)	7.7%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 230	百万円 23	% 10.1	百万円 296	百万円 28	% 9.7
株 式 先 物 取 引	970	186	19.2	909	167	18.4

平均保有割合 100.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当	期	末
	□ 数	□ 数	評 価	額
グローバル株式スマートインカムプラス戦略 （リスク抑制型）マザーファンド	千口 509,883	千口 482,346		千円 435,365

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型) マザーファンド	千円 435,365	% 92.6
コール・ローン等、その他	34,983	7.4
投資信託財産総額	470,349	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年2月15日現在、グローバル株式スマートインカムプラス戦略(リスク抑制型)マザーファンドは342,711千円、73.3%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、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.12円、1カナダ・ドル=82.84円、1オーストラリア・ドル=81.60円、1香港・ドル=13.56円、1イギリス・ポンド=145.85円、1スイス・フラン=117.85円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1ユーロ=127.44円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	470,349,948円
コール・ローン等	34,983,980
グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型)マザーファンド(評価額)	435,365,968
(B) 負 債	7,277,713
未払収益分配金	536,781
未払解約金	4,384,175
未払信託報酬	2,347,759
その他未払費用	8,998
(C) 純資産総額(A-B)	463,072,235
元 本	536,781,906
次期繰越損益金	△73,709,671
(D) 受益権総口数	536,781,906口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,627円

(注) 期首における元本額は633,609,486円、当期中における追加設定元本額は15,045,863円、同解約元本額は111,873,443円です。

■損益の状況

当期 自2020年8月18日 至2021年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△8,923円
受 取 利 息	1,472
支 払 利 息	△10,395
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,365,717
売 買 損 益	815,784
売 買 損 益	△7,181,501
(C) 信 託 報 酬	△2,356,757
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△8,731,397
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△56,002,498
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△8,438,995
(配 当 等 相 当 額)	(2,665,820)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,104,815)
(G) 合 計(D+E+F)	△73,712,890
(H) 次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△536,781
追 加 信 託 差 損 益 金	△73,709,671
(配 当 等 相 当 額)	△8,438,995
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,682,130)
(分 配 準 備 積 立 金)	(△11,121,125)
繰 越 損 益 金	22,455,132
繰 越 損 益 金	△87,725,808

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,518,126円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,682,130
(d) 分配準備積立金	21,473,787
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	25,674,043
(f) 1万口当たり当期分配対象額	478.30
(g) 分配金	536,781
(h) 1万口当たり分配金	10

■分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金

10円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンド 運用報告書

第5期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日）

グローバル株式スマートインカムプラス戦略（リスク抑制型）マザーファンドの第5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	2016年10月24日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	日本を含む先進国の株式、株価指数先物を主要投資対象とします。なお、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）に投資する場合があります。
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		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	期騰落	中率				
（設定日） 2016年10月24日	円 10,000	% -	% -	% -	% -	百万円 1,495
1期(2017年2月15日)	9,833	△1.7	79.7	△68.3	5.3	2,895
2期(2018年2月15日)	9,837	0.0	82.2	△70.2	-	2,560
3期(2019年2月15日)	9,780	△0.6	81.5	△69.7	-	1,519
4期(2020年2月17日)	9,421	△3.7	82.0	△74.2	-	618
5期(2021年2月15日)	9,026	△4.2	88.3	△87.1	-	435

（注1）設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

（注2）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注3）当ファンドの運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

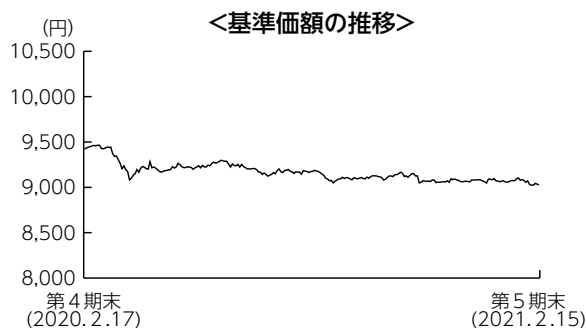
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 資 信 託 受 益 証 券、 組 入 証 券 率
	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2020 年 2 月 17 日	9,421	—	82.0	△74.2	—
2 月 末	9,464	0.5	74.3	△66.2	—
3 月 末	9,167	△2.7	66.0	△60.5	—
4 月 末	9,265	△1.7	82.0	△74.9	—
5 月 末	9,263	△1.7	85.5	△78.5	—
6 月 末	9,207	△2.3	80.4	△75.8	—
7 月 末	9,173	△2.6	81.5	△77.1	—
8 月 末	9,073	△3.7	86.2	△82.8	—
9 月 末	9,113	△3.3	81.9	△78.1	—
10 月 末	9,111	△3.3	78.4	△74.8	—
11 月 末	9,062	△3.8	87.0	△85.4	—
12 月 末	9,062	△3.8	83.0	△81.2	—
2021 年 1 月 末	9,079	△3.6	84.0	△82.2	—
(期 末) 2021 年 2 月 15 日	9,026	△4.2	88.3	△87.1	—

(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。

■当期の運用経過（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は9,026円となり、前期末比で4.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドが選好する配当利回りの高い（安定的に配当を得られる蓋然性が高い）銘柄群に加えて、リスク対比配当利回りを高める観点から銘柄選択時に考慮している相対的にリスクが低い銘柄群も市場平均に対して軟調に推移したため、基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、国内外の株式市場は急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

銘柄選択については、当ファンドが着目するリスク対比配当利回りが高いと考えられる銘柄を選別する基本方針のもと株式ポートフォリオを構築しました。あわせて、先物の売り建てを行うことで、ポートフォリオ全体のリスクの抑制を図りました。

【運用状況】

○組入上位10銘柄（現物）

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	IBERDROLA SA	ユーロ	1.5%
2	T ROWE PRICE GROUP INC	アメリカ・ドル	1.3
3	SANOFI	ユーロ	1.3
4	CONSOLIDATED EDISON INC	アメリカ・ドル	1.2
5	日本電信電話	日本・円	1.2
6	N T T ドコモ	日本・円	1.1
7	キャノン	日本・円	1.0
8	SYNOPSIS INC	アメリカ・ドル	1.0
9	ENI SPA	ユーロ	0.9
10	AT&T INC	アメリカ・ドル	0.9
組入銘柄数		292銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	SYNOPSIS INC	アメリカ・ドル	1.5%
2	RIO TINTO PLC	イギリス・ポンド	1.4
3	本田技研工業	日本・円	1.3
4	INVESTOR AB-B SHS	スウェーデン・クローナ	1.3
5	SANOFI	ユーロ	1.2
6	PACCAR INC	アメリカ・ドル	1.2
7	富士通	日本・円	1.1
8	IBERDROLA SA	ユーロ	1.1
9	T ROWE PRICE GROUP INC	アメリカ・ドル	1.1
10	CUMMINS INC	アメリカ・ドル	1.1
組入銘柄数		268銘柄	

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

今後の運用方針

株式市場全体の価格変動による影響をできるだけ排除し、安定的に配当収益を獲得することをめざします。具体的には、当ファンドが着目するリスク対比配当利回りが高いと考えられる銘柄を選別する基本方針を堅持することで、安定的なリターンの獲得に努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	8円 (4) (4)	0.089% (0.047) (0.042)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	7 (7)	0.076 (0.076)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	49 (48) (0)	0.531 (0.529) (0.002)
合 計	64	0.696

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(9,164円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については5ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)
株 式

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円	
		53 (0.4)	110,962 (-)	72.9	152,280	
外 国	ア メ リ カ	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル	
		223.05 (△2.25)	1,433 (△8)	301.92	1,765	
	カ ナ ダ	百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル	
		223.69 (-)	583 (-)	301.37	776	
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株	千オーストラリア・ドル	百株	千オーストラリア・ドル	
		341.31 (7.3)	343 (-)	553.83	606	
	香 港	百株	千香港・ドル	百株	千香港・ドル	
		443 (10.8)	879 (-)	494.8	1,360	
	イ ギ リ ス	百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド	
		537.57 (-)	293 (-)	541.75	284	
	ス イ ス	百株	千スイス・フラン	百株	千スイス・フラン	
		26.47 (-)	152 (△0.3066)	17.01	183	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株	千スウェーデン・クローナ	百株	千スウェーデン・クローナ	
		115.72 (5.11)	1,877 (-)	186.41	2,138	
ユ ー ロ	オ ラ ン ダ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
		44.12 (11.47)	100 (-)	39.98	144	
	ベ ル ギ ー	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
		3.88 (-)	33 (-)	6.95	34	
	フ ラ ン ス	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
		96.9 (△5.66)	340 (-)	99.23	329	
	ド イ ツ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
		75.02 (1.79)	272 (-)	34.84	196	
	ポ ル ト ガ ル	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
11.36 (-)		10 (-)	11.36	12		
ス ペ イ ン	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ		
	29.09 (58.44)	37 (-)	120.32	75		
イ タ リ ア	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ		
	167.11 (-)	68 (-)	265.99	83		
	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ		
フ ィ ン ラ ン ド	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ		
	69.03 (-)	55 (-)	48.95	75		
オ ー ス ト リ ア	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ		
	4.37 (-)	13 (-)	-	-		

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、増資割当および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。

■派生商品取引状況等

先物取引の銘柄別取引・残高状況

銘柄別			買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
			新 買 付 額	規 額	決 済 額	新 売 付 額	規 額	決 済 額	買 建 額
国内	株式	T O P I X	百万円 -	百万円 -	百万円 377	百万円 429	百万円 -	百万円 78	百万円 △8
外国	株	S&P500 EMINI FUT	-	-	427	464	-	103	△7
		S&P/TSE 60 IX FUT	-	-	141	156	-	36	△2
		SPI 200 FUTURES	-	-	78	81	-	13	△0
		HANG SENG IDX FUT	-	-	207	207	-	20	△0
		FTSE 100 INDEX FUTURE	-	-	96	97	-	28	△0
国内	式	SWISS MKT IX FUTURE	-	-	44	45	-	12	△0
		OMXS30 IND FUTURE	-	-	163	163	-	15	△0
		DJ EURO STOXX 50	-	-	241	243	-	70	△3

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,205,485千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	395,630千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	3.04

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月18日から2021年2月15日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 539	百万円 23	% 4.3	百万円 665	百万円 28	% 4.3
株 式 先 物 取 引	1,889	429	22.7	1,777	377	21.3

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	438千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	25千円
(B) / (A)	5.8%

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株		千円
鉱業 (2.1%)				
国際石油開発帝石	2.2	2.2	1,691	
建設業 (-%)				
清水建設	1.7	-	-	
積水ハウス	1	-	-	
食料品 (4.0%)				
明治ホールディングス	-	0.2	1,428	
味の素	0.8	0.6	1,359	
東洋水産	-	0.1	465	
繊維製品 (-%)				
帯人	0.6	-	-	
化学 (12.2%)				
東ソー	0.5	0.5	964	
信越化学工業	-	0.1	1,874	
三菱瓦斯化学	-	0.2	513	
三井化学	-	0.3	1,002	
J S R	0.5	0.1	329	
日立化成	0.3	-	-	
富士フイルムホールディングス	0.8	0.5	3,186	
日東電工	-	0.2	2,004	
医薬品 (8.5%)				
協和キリン	-	0.5	1,620	
大日本住友製薬	0.5	0.5	875	
中外製薬	0.2	0.2	1,029	
小野薬品工業	-	0.6	1,887	
参天製薬	0.4	-	-	
第一三共	0.3	0.3	1,010	
大塚ホールディングス	-	0.1	453	
ペプチドリーム	0.1	-	-	
ゴム製品 (1.6%)				
横浜ゴム	0.2	-	-	
ブリヂストン	0.6	0.3	1,318	
住友ゴム工業	0.4	-	-	
ガラス・土石製品 (1.4%)				
A G C	0.2	0.3	1,111	
非鉄金属 (2.2%)				
三菱マテリアル	0.3	-	-	
住友金属鉱山	0.5	-	-	
住友電気工業	1.6	1.1	1,761	
金属製品 (1.5%)				
東洋製罐グループホールディングス	0.1	-	-	
リンナイ	-	0.1	1,195	
機械 (7.1%)				
アマダ	0.7	-	-	
住友重機械工業	0.2	-	-	
クボタ	-	0.7	1,808	
ダイキン工業	-	0.1	2,340	
S A N K Y O	0.1	-	-	
セガサミーホールディングス	0.4	0.2	372	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株		千円
THK	0.2	-	-	
マキタ	-	0.2	964	
三菱重工業	0.1	0.1	304	
電気機器 (14.5%)				
コニカミノルタ	1	-	-	
ブラザー工業	0.7	-	-	
日立製作所	1.2	-	-	
オムロン	0.1	-	-	
日本電気	0.5	0.4	2,516	
富士通	0.1	0.3	4,822	
ルネサスエレクトロニクス	0.9	-	-	
パナソニック	-	1.6	2,396	
T D K	0.1	-	-	
アズビル	-	0.2	1,000	
スタンレー電気	0.3	-	-	
ローム	0.2	-	-	
村田製作所	-	0.1	993	
キャノン	2.2	-	-	
リコー	1.2	-	-	
輸送用機器 (16.4%)				
豊田自動織機	0.4	0.2	1,968	
デンソー	1	0.4	2,773	
いすゞ自動車	0.4	-	-	
トヨタ自動車	0.2	-	-	
マツダ	1.7	1	874	
本田技研工業	0.6	1.8	5,493	
スズキ	-	0.2	992	
ヤマハ発動機	0.5	0.5	1,225	
精密機器 (-%)				
オリンパス	0.4	-	-	
HOYA	0.1	-	-	
その他製品 (2.2%)				
バンダイナムコホールディングス	0.2	0.2	1,811	
凸版印刷	0.8	-	-	
大日本印刷	0.7	-	-	
電気・ガス業 (2.8%)				
東京電力ホールディングス	3.3	-	-	
中部電力	0.3	-	-	
中国電力	-	0.5	650	
大阪瓦斯	0.8	0.5	1,002	
東邦瓦斯	-	0.1	658	
陸運業 (2.1%)				
東海旅客鉄道	0.2	0.1	1,738	
海運業 (-%)				
商船三井	0.2	-	-	
倉庫・運輸関連業 (-%)				
上組	0.4	-	-	
情報・通信業 (12.8%)				
ネクソン	0.4	0.5	1,727	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村総合研究所	—	0.5	1,812
日本電信電話	2.6	1.6	4,560
KDDI	1.2	—	—
NTTドコモ	2.2	—	—
東宝	0.2	0.2	875
カプコン	—	0.1	685
コナミホールディングス	0.3	0.1	731
卸売業 (-%)			
日立ハイテック	0.2	—	—
小売業 (1.3%)			
エービーシー・マート	0.1	—	—
MonotaRO	—	0.1	641
セブン&アイ・ホールディングス	—	0.1	422
ヤマダホールディングス	1.4	—	—
ニトリホールディングス	0.1	—	—
銀行業 (3.7%)			
ゆうちょ銀行	—	0.9	933
新生銀行	0.6	0.2	281
千葉銀行	—	0.6	389

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡銀行	—	0.9	725
京都銀行	—	0.1	635
証券・商品先物取引業 (1.4%)			
野村ホールディングス	—	1.8	1,166
保険業 (1.6%)			
第一生命ホールディングス	—	0.7	1,312
不動産業 (0.6%)			
飯田グループホールディングス	0.4	0.2	483
サービス業 (-%)			
カカコム	0.2	—	—
エムスリー	0.4	—	—
	千株	千株	千円
合 計	株 数・金 額	株 数	金 額
	72銘柄	27	81,168
	銘柄数<比率>	58銘柄	<18.6%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 外国株式

銘柄	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	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC		—	0.03	9	1,033	インターネット販売・通信販売ソフトウェア
ANSYS INC		1.14	—	—	—	—
PINNACLE WEST CAPITAL CORP		—	1.26	9	1,009	電力
VERIZON COMM INC		—	0.85	4	484	各種電気通信サービス
YUM! BRANDS INC		0.19	0.19	2	210	ホテル・レストラン・レジャー
ROBERT HALF INTL INC		—	0.61	4	473	専門サービス
BORGWARNER INC		0.22	—	—	—	自動車部品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC		—	1.03	9	988	航空貨物・物流サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		1.47	—	—	—	医薬品
CABOT OIL & GAS CORP		—	6.03	10	1,155	石油・ガス・消耗燃料
SEAGATE TECHNOLOGY		0.9	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED		0.37	2.83	5	612	ホテル・レストラン・レジャー
CERNER CORP		3.6	—	—	—	ヘルスケア・テクノロジー
COPART INC		0.97	—	—	—	商業サービス・用品
COMCAST CORP-CL A		—	5.86	31	3,278	メディア
CONAGRA BRANDS INC		0.1	—	—	—	食品
CONSOLIDATED EDISON INC		7.11	—	—	—	総合公益事業
HEICO CORP-CL A		—	1.09	12	1,330	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC		0.71	1.8	43	4,616	機械
DR HORTON INC		4.53	5.15	42	4,448	家庭用耐久財
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS		—	2.06	15	1,666	情報技術サービス
COSTAR GROUP INC		—	0.06	5	592	専門サービス
DUKE ENERGY CORP		1.53	0.65	5	613	電力
EBAY INC		2.02	—	—	—	インターネット販売・通信販売
EASTMAN CHEMICAL CO		—	0.36	3	413	化学

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	千アメリカ・ドル	千円	
EATON CORP PLC	1.21	1.26	15	1,642	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	1.11	—	—	—	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	0.58	0.38	9	1,039	保険
FLIR SYSTEMS INC	3.04	—	—	—	電子装置・機器・部品
GAP INC/THE	6.37	—	—	—	専門小売り
GENERAL MILLS INC	—	4.42	25	2,653	食品
GILEAD SCIENCES INC	2.21	2.25	15	1,582	バイオテクノロジー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	0.86	15	1,680	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	1.44	—	—	—	食品
F5 NETWORKS INC	0.07	0.07	1	154	通信機器
JUNIPER NETWORKS INC	7.43	5.67	14	1,504	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	2.79	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HORMEL FOODS CORP	—	4.48	21	2,271	食品
BIOGEN INC	0.34	—	—	—	バイオテクノロジー
INTUIT INC	0.66	0.43	17	1,871	ソフトウェア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	0.95	14	1,507	建設関連製品
INTEL CORP	3.04	—	—	—	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	1.8	—	—	—	複合小売り
LAM RESEARCH CORP	—	0.15	8	924	半導体・半導体製造装置
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	1.4	18	1,959	容器・包装
LENNAR CORP	—	1.73	16	1,683	家庭用耐久財
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	0.66	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	—	0.6	5	606	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1.8	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
MERCK & CO.INC.	4.08	—	—	—	医薬品
MICROSOFT CORP	—	1.62	39	4,172	ソフトウェア
MICRON TECH INC	4.41	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	—	0.81	4	458	半導体・半導体製造装置
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.6	—	—	—	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	—	1.14	6	706	金属・鉱業
NVR INC	0.02	—	—	—	家庭用耐久財
EVERSOURCE ENERGY	1.77	—	—	—	電力
NUCOR CORP	7.1	—	—	—	金属・鉱業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	5.34	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1.35	—	—	—	陸運・鉄道
PACCAR INC	—	4.93	48	5,078	機械
PFIZER INC	2.12	—	—	—	医薬品
GARMIN LTD	3.05	2.07	27	2,844	家庭用耐久財
T ROWE PRICE GROUP INC	5.37	2.75	44	4,717	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	1.49	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	0.15	0.15	1	201	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	—	3.41	29	3,092	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	2.54	—	—	—	総合公益事業
PULTE GROUP INC	6.02	—	—	—	家庭用耐久財
QUALCOMM INC	—	0.88	13	1,368	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	0.23	0.35	16	1,786	バイオテクノロジー
SEAGEN INC	—	0.03	0.49752	52	バイオテクノロジー
ROSS STORES INC	3.01	—	—	—	専門小売り
THE TRAVELERS COMPANIES INC	—	0.41	5	629	保険
SNAP-ON INC	0.86	0.75	14	1,497	機械
AT&T INC	12.88	—	—	—	各種電気通信サービス
STEEL DYNAMICS INC	4.04	—	—	—	金属・鉱業

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	千アメリカ・ドル	千円	
SYNOPSYS INC	3.37	2.18	63	6,693	ソフトウェア
TERADYNE INC	-	0.35	4	523	半導体・半導体製造装置
TYSON FOODS INC	2.93	2.4	15	1,654	食品
UGI CORP	1.28	-	-	-	ガス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	0.45	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VIACOMCBS INC	4.41	-	-	-	メディア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	0.06	0.06	0.30228	31	食品・生活必需品小売り
JM SMUCKER CO/THE-NEW	0.94	1.9	21	2,298	食品
WESTERN DIGITAL CORP	3.19	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	0.4	-	-	-	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	2.65	-	-	-	専門小売り
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	-	3	16	1,709	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	2	1	2	265	コングロマリット
T-MOBILE US INC	-	1.44	17	1,872	無線通信サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.64	-	-	-	資本市場
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	0.05	-	-	-	旅客航空輸送業
MASTERCARD INC	0.51	-	-	-	情報技術サービス
OWENS CORNING	1.37	-	-	-	建設関連製品
TE CONNECTIVITY LTD	2.57	-	-	-	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	-	0.25	6	724	ヘルスケア機器・用品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	8.59	1.88	2	293	石油・ガス・消耗燃料
DOLLAR GENERAL CORP	0.91	-	-	-	複合小売り
TRIPADVISOR INC	0.03	-	-	-	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FACEBOOK INC	1.27	0.65	17	1,848	インタラクティブ・メディアおよびサービス
WORKDAY INC	-	0.27	7	798	ソフトウェア
NEWS CORP/NEW-CL A	-	5.83	13	1,453	メディア
SPRINT CORP	3.28	-	-	-	無線通信サービス
VEEVA SYSTEMS INC	0.25	-	-	-	ヘルスケア・テクノロジー
EVERGY INC	0.25	0.25	1	143	電力
STERIS PLC	-	0.35	6	673	ヘルスケア機器・用品
XEROX HOLDINGS CORP	4.19	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
MATCH GROUP INC	-	0.91	15	1,621	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PAYCOM SOFTWARE INC	-	0.02	0.82596	86	ソフトウェア
IAC/INTERACTIVECORP	-	0.92	24	2,537	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	-	0.33	0.60192	63	医薬品
FNF GROUP	1.56	-	-	-	保険
ALPHABET INC-CL A	0.03	0.17	35	3,743	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	6.88	0.71	1	107	コンピュータ・周辺機器
ALPHABET INC-CL C	0.04	0.14	29	3,096	インタラクティブ・メディアおよびサービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	179.94 78銘柄	98.82 65銘柄	978 102,858	<23.6%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BARRICK GOLD CORP	-	9.27	26	2,159	金属・鉱業
ATCO LTD	2.82	-	-	-	総合公益事業
BCE INC	3.29	-	-	-	各種電気通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	-	2.85	32	2,678	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	4.57	7.04	24	1,991	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	-	0.97	16	1,399	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	1.51	-	-	-	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	-	1.59	22	1,850	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	-	5.91	3	298	金属・鉱業
OPEN TEXT CORP	4.57	-	-	-	ソフトウェア

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
KINROSS GOLD CORP	28.78	18.3	17	1,417	金属・鉱業
FORTIS INC	9.59	6.46	33	2,756	電力
IMPERIAL OIL LTD	5.46	2.43	6	518	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1.17	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	2.5	—	—	—	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	6.67	—	—	—	保険
LOBLAW CO LTD	2.65	—	—	—	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	4.16	4.69	46	3,841	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	1.38	—	—	—	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	—	0.26	13	1,104	保険
METRO INC	4.17	3.79	20	1,719	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	10.45	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	5.35	3.31	17	1,425	電力
POWER CORP OF CANADA	6.4	—	—	—	保険
SUNCOR ENERGY INC	—	6.98	15	1,323	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	14.43	—	—	—	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	11.91	—	—	—	金属・鉱業
TC ENERGY CORP	5.04	0.51	2	239	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1.44	—	—	—	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	—	0.45	4	361	食品・生活必需品小売り
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.07	—	—	—	ソフトウェア
B2GOLD CORP	—	18.53	11	980	金属・鉱業
ALTAGAS LTD	6.08	—	—	—	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	5.73	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
INTER PIPELINE LTD	8.95	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	1.48	—	—	—	化学
IA FINANCIAL CORP INC	2.3	—	—	—	保険
OVINTIV INC	2.41	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AIR CANADA	2.96	—	—	—	旅客航空輸送業
HYDRO ONE LTD	7.02	4.29	12	1,024	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	175.31 31銘柄	97.63 18銘柄	327 —	27,088 <6.2%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	—	5.81	14	1,176	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	31	14.89	35	2,895	金属・鉱業
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	11.78	—	—	—	銀行
BHP GROUP LTD	4.24	1.88	8	686	金属・鉱業
ORIGIN ENERGY LTD	20.22	22.71	9	807	石油・ガス・消耗燃料
BORAL LIMITED	26.5	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LIMITED	3.09	0.45	5	430	金属・鉱業
TPG TELECOM LTD	—	7.35	5	444	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	—	0.87	3	288	建設資材
BLUESCOPE STEEL LTD	6.79	6.79	11	941	金属・鉱業
SUNCORP GROUP LTD	28.35	—	—	—	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6.94	—	—	—	銀行
NEWCREST MINING LTD	17.6	8.68	22	1,838	金属・鉱業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	—	4.84	4	342	保険
SANTOS LTD	11.03	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	10.13	4.53	15	1,267	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	—	1.43	4	337	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	47.01	39.95	17	1,447	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	5.38	—	—	—	複合小売り

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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	14.86	3.13	7	638	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	7.13	—	—	—	食品・生活必需品小売り
AUSNET SERVICES	—	34.91	5	487	電力
AGL ENERGY LTD	14.88	—	—	—	総合公益事業
CROWN RESORTS LTD	8.6	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	—	24.65	11	929	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	45.9	—	—	—	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	5.63	—	—	—	飲料
MEDIBANK PVT LTD	63.15	—	—	—	保険
WISETECH GLOBAL LTD	—	2.12	6	568	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	390.21 21銘柄	184.99 17銘柄	190 —	15,527 <3.6%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	9	1	12	163	半導体・半導体製造装置
PCCW LTD	—	100	45	621	各種電気通信サービス
MTR CORP	35	10	44	608	陸運・鉄道
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	30	—	—	—	電力
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	—	20	137	1,869	ホテル・レストラン・レジャー
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	20	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	20	—	—	—	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	20	44	604	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	60	40	39	535	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	8	—	—	—	保険
HKT TRUST / HKT LTD	70	50	52	713	各種電気通信サービス
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	—	65	49	668	電力
WH GROUP LTD	190	115	73	1,002	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	20	—	—	—	コンプロマリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	462 10銘柄	421 9銘柄	500 —	6,788 <1.6%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BHP GROUP PLC	—	5.19	10	1,602	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	23.15	—	—	—	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	32.03	80.47	9	1,455	各種電気通信サービス
EASYJET PLC	3.61	—	—	—	旅客航空輸送業
CRODA INTERNATIONAL	—	1.71	11	1,646	化学
NATIONAL GRID PLC	17.94	18.24	15	2,278	総合公益事業
KINGFISHER PLC	—	36.93	10	1,459	専門小売り
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	8.84	7.2	19	2,850	タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	—	1.36	3	528	金属・鉱業
HSBC HOLDINGS PLC	—	48.21	19	2,825	銀行
UNILEVER PLC	1.98	1.29	5	745	パーソナル用品
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	0.96	35.15	6	876	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	—	9.99	7	1,112	メディア
PERSIMMON PLC	7.27	5.55	15	2,203	家庭用耐久財
RIO TINTO PLC	—	6.9	40	5,971	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	125.61	—	—	—	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	—	1.48	9	1,361	家庭用品
BP PLC	—	14.61	3	557	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	—	11.22	6	965	ソフトウェア
TAYLOR WIMPLEY PLC	93.39	58.35	9	1,371	家庭用耐久財
3I GROUP PLC	21.87	—	—	—	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	20.73	1.19	1	272	ヘルスケア機器・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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SAINSBURY (J) PLC	0.53	27.18	6	908	食品・生活必需品小売り
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	2.86	0.37	1	232	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	12.92	5.16	7	1,022	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	7.44	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	2.69	6	925	医薬品
MONDI PLC	—	6.75	12	1,811	紙製品・林産品
INFORMA PLC	—	15.32	7	1,135	メディア
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	30.32	17.44	5	779	保険
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	5.72	—	—	—	ソフトウェア
AUTO TRADER GROUP PLC	6.96	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	424.13 19銘柄	419.95 25銘柄	252 —	36,897 <8.5%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
LOGITECH INTL-REG	—	1.39	14	1,716	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	0.22	1.04	10	1,234	食品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.04	0.7	21	2,583	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	4.72	2.65	21	2,560	医薬品
SWISSCOM AG-REG	—	0.07	3	383	各種電気通信サービス
ADECCO GROUP AG-REG	0.97	—	—	—	専門サービス
SONOVA HOLDING AG	1	0.28	6	788	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	0.08	0.28	7	874	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	1.56	0.51	2	308	繊維・アパレル・贅沢品
SWISS LIFE HOLDING AG	0.42	—	—	—	保険
BANQUE CANTONALE VAUD	—	0.36	3	421	銀行
PARGESA HOLDING PORTEUR	0.36	—	—	—	各種金融サービス
UBS GROUP AG	—	12.55	17	2,026	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10.37 9銘柄	19.83 10銘柄	109 —	12,898 <3.0%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ERICSSON LM-B SHS	21.64	5.28	59	759	通信機器
LUNDBERGS B	1.69	—	—	—	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	10.83	—	—	—	機械
SWEDISH MATCH AB	0.74	0.96	59	748	タバコ
TELE2 AB-B SHS	0.5	0.5	5	69	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	1.2	35	444	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	—	2.63	73	929	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	—	2.87	60	767	家庭用耐久財
INVESTOR AB-B SHS	—	6.66	433	5,487	各種金融サービス
ASSA ABLOY AB-B	—	3.23	72	921	建設関連製品
TELIA CO AB	66.26	15.62	55	698	各種電気通信サービス
BOLIDEN AB	6.08	4.22	131	1,659	金属・鉱業
KINNEVIK AB-B	—	3.66	160	2,038	各種金融サービス
ICA GRUPPEN AB	2.73	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	7.56	5.62	57	731	家庭用耐久財
HEXAGON AB	0.13	0.13	9	120	電子装置・機器・部品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	118.16 10銘柄	52.58 13銘柄	1,214 —	15,377 <3.5%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE DSM NV	3.16	—	—	—	化学
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	7.96	2.82	6	844	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3.12	1.75	8	1,069	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	0.44	—	—	—	専門サービス

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	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOPAK (KON.)	-	1.56	6	868	石油・ガス・消耗燃料
STELLANTIS NV	-	11.47	15	1,937	自動車
NN GROUP NV	-	4.88	17	2,216	保険
STELLANTIS NV	0.89	11.19	14	1,891	自動車
EXOR NV	2.49	-	-	-	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18.06 6銘柄	33.67 6銘柄	69 -	8,829 <2.0%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SOFINA	-	0.27	7	1,013	各種金融サービス
UCB SA	2.58	1.85	16	2,068	医薬品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	-	0.48	4	519	各種金融サービス
PROXIMUS	3.42	-	-	-	各種電気通信サービス
ELIA GROUP	-	0.33	3	412	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6 2銘柄	2.93 4銘柄	31 -	4,014 <0.9%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SES FDR	1.26	1.26	0.87318	111	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1.26 1銘柄	1.26 1銘柄	0.87318 -	111 <0.0%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DANONE	1.34	-	-	-	食品
CAPGEMINI SA	-	2.13	28	3,672	情報技術サービス
L'OREAL	0.04	0.56	17	2,271	パーソナル用品
MICHELIN(CGDE)-B	2.67	2.35	27	3,494	自動車部品
PEUGEOT SA	13.36	-	-	-	自動車
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11.01	5.22	22	2,806	建設関連製品
SEB SA	-	0.37	6	790	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2.87	0.89	11	1,463	電気設備
TOTAL SE	-	5.93	20	2,643	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	2.34	0.96	3	395	自動車部品
ORANGE	-	4.65	4	577	各種電気通信サービス
HERMES INTL	-	0.17	15	2,002	繊維・アパレル・贅沢品
CARREFOUR SA	-	9.12	13	1,678	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	-	1.04	6	874	情報技術サービス
SANOFI	7.26	5.2	40	5,179	医薬品
ILIAD SA	0.03	0.03	0.45915	58	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	-	0.41	5	656	ヘルスケア機器・用品
ENGIE	5.54	-	-	-	総合公益事業
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3.94	-	-	-	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	-	4.17	4	564	電力
LEGRAND SA	0.79	-	-	-	電気設備
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	51.19 12銘柄	43.2 16銘柄	228 -	29,130 <6.7%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	-	4.27	29	3,822	自動車
UNITED INTERNET	-	1.55	5	748	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	-	0.21	1	129	化学
CONTINENTAL AG	0.06	1.63	19	2,547	自動車部品
MERCK KGAA	-	0.77	11	1,403	医薬品
SAP SE	0.87	-	-	-	ソフトウェア
HENKEL AG & CO KGAA	-	1.84	14	1,814	家庭用品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	-	2.43	21	2,706	家庭用品

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	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BEIERSDORF AG	—	1.21	11	1,419	パーソナル用品
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	—	2.35	14	1,838	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	0.04	—	—	—	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.26	—	—	—	保険
VOLKSWAGEN AG	0.64	0.37	6	853	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	0.54	—	—	—	自動車
DEUTSCHE BANK AG-REG	—	29.48	26	3,373	資本市場
BMW VORZUG	—	1.01	5	705	自動車
CARL ZEISS MEDITEC AG	0.93	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
COVESTRO AG	1.81	—	—	—	化学
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5.15 8銘柄	47.12 12銘柄	167 —	21,364 <4.9%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	70.6	35.01	37	4,820	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA	—	4.18	8	1,118	ガス
AENA SME SA	1.38	—	—	—	運送インフラ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	71.98 2銘柄	39.19 2銘柄	46 —	5,938 <1.4%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	11.54	—	—	—	保険
UNICREDIT SPA	1.97	1.97	1	210	銀行
ENI SPA	35.65	18.22	16	2,061	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	14.32	—	—	—	銀行
ENEL SPA	—	32.06	27	3,459	電力
TELECOM ITALIA SPA	131.04	90.98	3	440	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	171.41	120.61	5	659	各種電気通信サービス
RECORDATI SPA	2.96	0.84	3	477	医薬品
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	—	5.33	4	630	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	368.89 7銘柄	270.01 7銘柄	62 —	7,940 <1.8%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	3	3.75	12	1,536	紙製品・林産品
NOKIA OYJ	51.74	72.89	25	3,228	通信機器
ELISA OYJ	3.26	—	—	—	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	—	2.87	16	2,092	石油・ガス・消耗燃料
ORION OYJ	1.43	—	—	—	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	59.43 4銘柄	79.51 3銘柄	53 —	6,858 <1.6%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	—	2.6	9	1,166	石油・ガス・消耗燃料
VOEST-ALPINE AG	—	1.77	5	701	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— 1銘柄	4.37 2銘柄	14 —	1,868 <0.4%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,342.08 220銘柄	1,816.06 210銘柄	— —	303,492 <69.7%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別(ユーロは国別)株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期	
		買建額	売建額
国内	T O P I X	百万円 -	百万円 78
	S & P 5 0 0 E M I N I F U T	百万円 -	百万円 103
外	S & P / T S E 6 0 I X F U T	-	36
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	-	13
	H A N G S E N G I D X F U T	-	20
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	-	28
	S W I S S M K T I X F U T U R E	-	12
	OMXS30 IND FUTURE	-	15
国	D J E U R O S T O X X 5 0	-	70

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 384,660	% 82.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	82,785	17.7
投 資 信 託 財 産 総 額	467,446	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、342,711千円、73.3%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、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.12円、1カナダ・ドル=82.84円、1オーストラリア・ドル=81.60円、1香港・ドル=13.56円、1イギリス・ポンド=145.85円、1スイス・フラン=117.85円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1ユーロ=127.44円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	870,910,066円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,576,934
株 式(評価額)	384,660,644
未 収 入 金	404,372,522
未 収 配 当 金	295,818
差 入 委 託 証 拠 金	64,004,148
(B) 負 債	435,525,793
未 払 金	435,525,793
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	435,384,273
元 本	482,346,519
次 期 繰 越 損 益 金	△46,962,246
(D) 受 益 権 総 口 数	482,346,519口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,026円

(注1) 期首元本額 657,017,395円
追加設定元本額 60,564,180円
一部解約元本額 235,235,056円

(注2) 期末における元本の内訳
世界株配当収益追求ファンド(価格変動抑制型)
482,346,519円
期末元本合計 482,346,519円

■損益の状況

当期 自2020年2月18日 至2021年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	11,261,148円
受 取 配 当 金	11,265,724
受 取 利 息	3,864
そ の 他 収 益 金	2,544
支 払 利 息	△10,984
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,113,020
売 買 益	158,523,553
売 買 損	△159,636,573
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△30,101,361
取 引 益	125,143,458
取 引 損	△155,244,819
(D) そ の 他 費 用	△2,606,546
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△22,559,779
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△38,073,343
(G) 解 約 差 損 益 金	18,235,056
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	△4,564,180
(I) 合 計(E+F+G+H)	△46,962,246
次 期 繰 越 損 益 金(I)	△46,962,246

(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)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3) (H)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。