

# 運用報告書 (全体版)

第11期<決算日2022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	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 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。
運用方法	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。 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。 現金等 <sup>※1</sup> を活用し、基準価額の変動リスクを年率3%程度 <sup>※2</sup> に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。 ※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。 ※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。 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 <sup>※3</sup> 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。 ※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。 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。
組入制限	マザーファンド受益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、2022年2月15日に第11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
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
10期 (2021年8月16日)	8,768	10	1.8	74.8	△62.2	—	427
11期 (2022年2月15日)	8,739	10	△0.2	79.5	△64.0	0.2	393

(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)	円	%	%	%	%
2021年8月16日	8,768	—	74.8	△62.2	—
8月末	8,725	△0.5	74.9	△62.7	—
9月末	8,627	△1.6	73.9	△62.3	—
10月末	8,587	△2.1	78.3	△66.9	—
11月末	8,631	△1.6	77.3	△65.4	—
12月末	8,667	△1.2	80.4	△65.2	0.2
2022年1月末	8,731	△0.4	76.5	△61.4	0.2
(期末)					
2022年2月15日	8,749	△0.2	79.5	△64.0	0.2

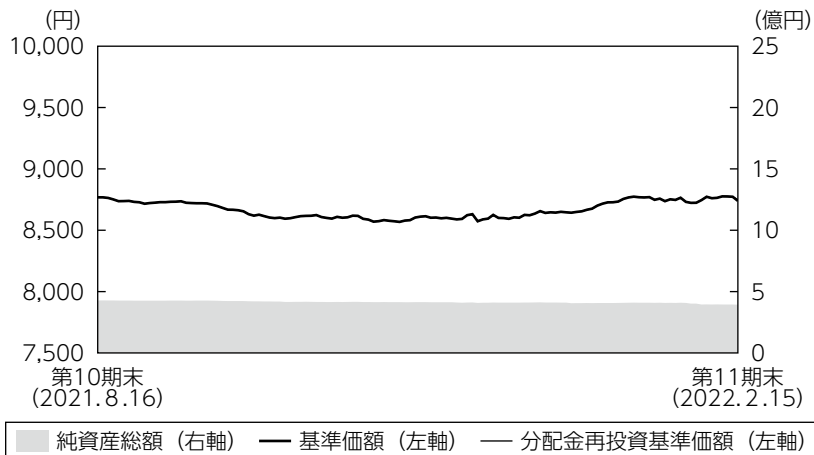
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは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（2021年8月17日から2022年2月15日まで）

### 基準価額等の推移



第11期首： 8,768円  
第11期末： 8,739円  
(既払分配金10円)  
騰落率：  $\Delta 0.2\%$   
(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

当ファンドの基準価額は下落しました。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）銘柄群が市場平均に対して堅調に推移した一方、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財務状況が健全な銘柄群が市場平均に対して軟調に推移したことが基準価額にマイナスに寄与しました。

## 投資環境

先進国株式市場は、期初から2021年9月にかけては中国大手不動産会社の破綻懸念等が重石となり下落しましたが、その後10月に向け、好調な企業業績が支えとなり値を戻す展開となりました。11月から期末にかけては、金融政策正常化進展の観測が広がったことに加えて、新型コロナウイルスのオミクロン株への懸念やウクライナ情勢緊迫化などが重石となり、下落に転じました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

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	IDEXX LABORATORIES INC	アメリカ・ドル	1.3%
2	HERMES INTL	ユーロ	1.3
3	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	1.3
4	PERNOD-RICARD	ユーロ	1.2
5	INVESTOR AB-B SHS	スウェーデン・クローナ	1.1
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ・ドル	1.1
7	INTUIT INC	アメリカ・ドル	1.1
8	日本電信電話	日本・円	1.1
9	SANOFI	ユーロ	1.0
10	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ユーロ	1.0
組入銘柄数		191銘柄	



#### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	NESTLE SA-REGISTERED	スイス・フラン	1.6%
2	東京エレクトロン	日本・円	1.4
3	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	1.4
4	BP PLC	イギリス・ポンド	1.3
5	SANOFI	ユーロ	1.2
6	DEUTSCHE POST AG-REG	ユーロ	1.2
7	SAP SE	ユーロ	1.2
8	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス・ポンド	1.2
9	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	カナダ・ドル	1.1
10	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ユーロ	1.1
組入銘柄数		251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
	2021年8月17日 ～2022年2月15日
当期分配金（税引前）	10円
対基準価額比率	0.11%
当期の収益	10円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	563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11期		項目の概要
	(2021年8月17日 ～2022年2月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	40円	0.457%	(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8,667円です。
(投信会社)	(19)	(0.220)	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)	(0.220)	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	5	0.053	(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)	( 3)	(0.037)	
(先物・オプション)	( 1)	(0.016)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	4	0.051	(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)	( 4)	(0.051)	
(d) その他費用	24	0.273	(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)	(23)	(0.265)	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)	( 1)	(0.006)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	72	0.835	

(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。

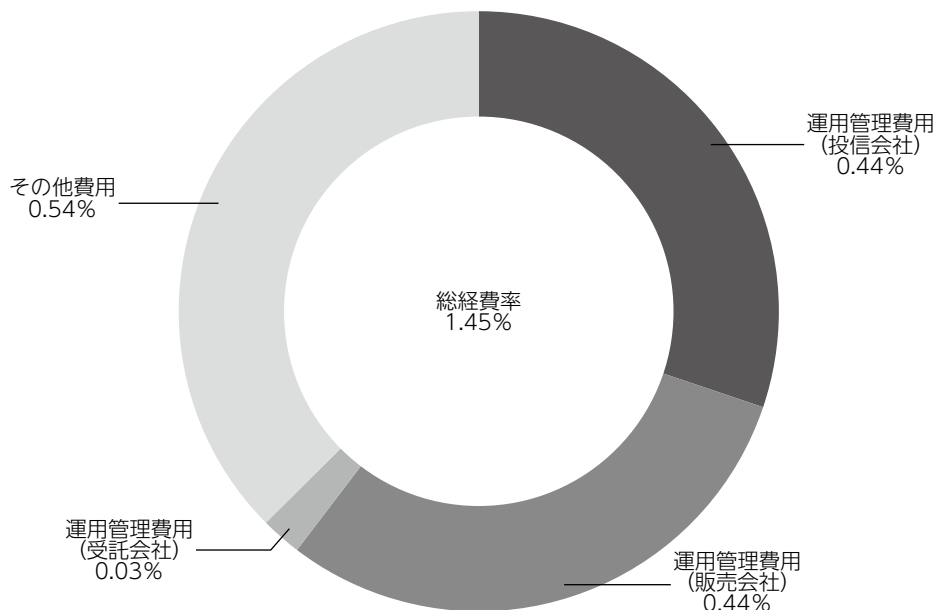
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.45%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（2021年8月17日から2022年2月15日まで）  
 期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■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	516,451千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	318,550千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.62

(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（2021年8月17日から2022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)	220千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B)／(A)	1.2%

(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 先 物 取 引	百万円 616	百万円 80	% 13.0	百万円 597	百万円 80	% 13.4

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 412,865	千口 412,865		千円 381,900

## ■投資信託財産の構成

2022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	381,900 千円	96.5 %
コール・ローン等、その他	13,855	3.5
投資信託財産総額	395,755	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、2022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307,563千円、79.2%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、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.42円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=82.31円、1香港・ドル=14.79円、1イギリス・ポンド=156.24円、1スイス・フラン=124.94円、1スウェーデン・クローナ=12.30円、1ユーロ=130.56円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	395,755,310円
コール・ローン等	13,855,006
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)	381,900,304
(B) 負 債	2,355,629
未払収益分配金	450,162
未払解約金	2,999
未払信託報酬	1,895,236
その他未払費用	7,232
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	393,399,681
元 本	450,162,754
次 期 繰 越 損 益 金	△56,763,073
(D) 受 益 権 総 口 数	450,162,754口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,739円

(注) 期首における元本額は487,698,241円、当期中における追加設定元本額は11,498,007円、同解約元本額は49,033,494円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年8月17日 至2022年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△3,934円
受 取 利 息	426
支 払 利 息	△4,360
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,143,544
売 買 損 益	1,020,194
買 入 損 益	123,350
(C) 信 託 報 酬 等	△1,902,468
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△762,858
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△45,595,072
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△9,954,981
(配 当 等 相 当 額)	(3,424,600)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,379,581)
(G) 合 計(D+E+F)	△56,312,911
(H) 収 益 分 配 金	△450,162
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△56,763,073
追 加 信 託 差 損 益 金	△9,954,981
(配 当 等 相 当 額)	(3,437,413)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,392,394)
分 配 準 備 積 立 金	21,918,943
繰 越 損 益 金	△68,727,035

(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	1,076,188円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,437,413
(d) 分配準備積立金	21,292,917
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	25,806,518
(f) 1万口当たり当期分配対象額	573.27
(g) 分配金	450,162
(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6期（決算日 2022年2月15日）

（計算期間 2021年2月16日～2022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6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。

## ■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
	期騰落	中率				
2期(2018年2月15日)	円 9,837	% 0.0	% 82.2	% △70.2	% -	百万円 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
6期(2022年2月15日)	9,250	2.5	81.9	△65.9	0.2	381

(注1) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 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3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

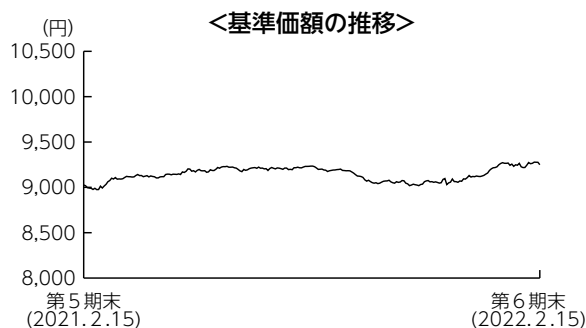
## ■当期中の基準価額の推移

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 証 比 率
	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	9,026	—	88.3	△87.1	—
2 月 末	8,976	△0.6	87.8	△87.0	—
3 月 末	9,131	1.2	82.7	△69.8	—
4 月 末	9,142	1.3	84.4	△71.6	—
5 月 末	9,185	1.8	86.2	△73.1	—
6 月 末	9,218	2.1	73.7	△60.8	—
7 月 末	9,195	1.9	83.0	△69.1	—
8 月 末	9,187	1.8	84.1	△70.4	—
9 月 末	9,078	0.6	82.9	△69.9	—
10 月 末	9,039	0.1	87.0	△74.4	—
11 月 末	9,098	0.8	84.6	△71.7	—
12 月 末	9,146	1.3	86.6	△70.2	0.3
2022 年 1 月 末	9,227	2.2	81.9	△65.8	0.2
(期 末) 2022 年 2 月 15 日	9,250	2.5	81.9	△65.9	0.2

(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（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は9,250円となり、前期末比で2.5%上昇しました。

### 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）銘柄群が市場平均に対して堅調に推移したため、基準価額に対してプラスに寄与しました。

## 投資環境

期初から2021年8月にかけては金利上昇が警戒される場面もあった中、好調な経済指標や企業業績が支えとなり先進国株式市場は上昇しました。9月から10月にかけては中国大手不動産会社の破綻懸念等が重石となり下落しましたが、好調な企業業績が支えとなり値を戻す展開となりました。11月から期末にかけては、金融政策正常化進展の観測が広がったことに加えて、新型コロナウイルスのオミクロン株への懸念やウクライナ情勢緊迫化などが重石となり、上値の重い展開となりました。

## 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	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	



##### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	NESTLE SA-REGISTERED	スイス・フラン	1.6%
2	東京エレクトロン	日本・円	1.4
3	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	1.4
4	BP PLC	イギリス・ポンド	1.3
5	SANOFI	ユーロ	1.2
6	DEUTSCHE POST AG-REG	ユーロ	1.2
7	SAP SE	ユーロ	1.2
8	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス・ポンド	1.2
9	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	カナダ・ドル	1.1
10	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ユーロ	1.1
組入銘柄数		251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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) (投 資 証 券)	10円 (7) (4) (0)	0.113% (0.073) (0.040) (0.000)	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式)	11 (11)	0.115 (0.115)	(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)	65 (61) (4)	0.710 (0.668) (0.042)	(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、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	86	0.938	
期中の平均基準価額は9,145円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ■ 売買及び取引の状況 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 34.3 (0.6)	千円 75,718 (-)	千株 41	千円 105,699
	ア メ リ カ	百株 176.59 (1.34)	千アメリカ・ドル 1,303 (△4)	百株 181.64	千アメリカ・ドル 1,641
外国	カ ナ ダ	百株 86.79 (△0.69)	千カナダ・ドル 592 (△0.07745)	百株 141.81	千カナダ・ドル 670
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 108.78 (-)	千オーストラリア・ドル 225 (-)	百株 208.35	千オーストラリア・ドル 289
	香 港	百株 229 (-)	千香港・ドル 1,205 (-)	百株 520	千香港・ドル 1,139
	イ ギ リ ス	百株 539.73 (△0.03)	千イギリス・ポンド 332 (△0.13727)	百株 743.16	千イギリス・ポンド 436
	ス イ ス	百株 21.44 (-)	千スイス・フラン 206 (-)	百株 26.16	千スイス・フラン 199
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 89.63 (37.04)	千スウェーデン・クローナ 1,121 (-)	百株 124.35	千スウェーデン・クローナ 1,629
	ユ ー ロ ア イ ル ラ ン ド	百株 0.83 (-)	千ユーロ 8 (-)	百株 -	千ユーロ -



		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ プ	オ ラ ン ダ	百株 129.85 (-)	千ユーロ 163 (△0.36147)	百株 93.19	千ユーロ 142
		ベ ル ギ ー	百株 3.94 (-)	千ユーロ 28 (-)	百株 3.85	千ユーロ 43
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 1.59 (-)	千ユーロ 13 (-)	百株 2.85	千ユーロ 18
		フ ラ ン ス	百株 80.57 (0.41)	千ユーロ 339 (-)	百株 91.1	千ユーロ 419
		ド イ ツ	百株 67.17 (-)	千ユーロ 250 (-)	百株 55.35	千ユーロ 257
		ス ベ イ ン	百株 113.26 (18.61)	千ユーロ 96 (△0.10006)	百株 118.08	千ユーロ 86
		イ タ リ ア	百株 46.85 (-)	千ユーロ 35 (-)	百株 311.5	千ユーロ 88
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 7.71 (-)	千ユーロ 27 (-)	百株 84.93	千ユーロ 70
		オ ー ス ト リ ア	百株 3.85 (-)	千ユーロ 15 (-)	百株 8.22	千ユーロ 37

(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。

## (2) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	0.523 (-)	4 (-)	- (-)	- (-)
AGNC INVESTMENT CORP	0.267 (-)	3 (-)	- (-)	- (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は分割割当、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 規 額	決 済 額	新 売 付 規 額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評 価 損 益
国内	株式	T O P I X	百万円 -	百万円 -	百万円 214	百万円 254	百万円 -	百万円 38	百万円 1
外	株	S&P500 EMINI FUT	-	-	359	405	-	76	5
		S&P/TSE 60 IX FUT	-	-	104	125	-	23	△0
		SPI 200 FUTURES	-	-	59	60	-	14	0
		HANG SENG IDX FUT	-	-	20	40	-	-	-
		FTSE 100 INDEX FUTURE	-	-	128	140	-	23	△0
国	式	SWISS MKT IX FUTURE	-	-	57	57	-	14	0
		OMXS30 IND FUTURE	-	-	173	182	-	8	0
		DJ EURO STOXX 50	-	-	247	275	-	52	1

(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	1,184,252千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	333,889千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	3.54

(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（2021年2月16日から2022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 530	百万円 16	% 3.2	百万円 654	百万円 29	% 4.6
株 式 先 物 取 引	1,541	254	16.5	1,365	214	15.7

### (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)	452千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	15千円
(B)/(A)	3.5%

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
<b>鉱業 (-%)</b>			
INPEX	2.2	-	-
<b>食料品 (-%)</b>			
明治ホールディングス	0.2	-	-
味の素	0.6	-	-
東洋水産	0.1	-	-
<b>化学 (3.5%)</b>			
住友化学	-	1.8	1,011
東ソー	0.5	-	-
信越化学工業	0.1	-	-
三菱瓦斯化学	0.2	-	-
三井化学	0.3	-	-
J S R	0.1	-	-
富士フィルムホールディングス	0.5	-	-
日東電工	0.2	0.1	852
<b>医薬品 (1.5%)</b>			
協和キリン	0.5	-	-
大日本住友製薬	0.5	-	-
中外製薬	0.2	0.2	792
小野薬品工業	0.6	-	-
第一三共	0.3	-	-
大塚ホールディングス	0.1	-	-
<b>ゴム製品 (2.8%)</b>			
ブリヂストン	0.3	0.3	1,470
<b>ガラス・土石製品 (1.4%)</b>			
AGC	0.3	-	-
日本碍子	-	0.4	738
<b>鉄鋼 (4.1%)</b>			
日本製鉄	-	0.6	1,188
ジェイエフイーホールディングス	-	0.6	991
<b>非鉄金属 (-%)</b>			
住友電気工業	1.1	-	-
<b>金属製品 (-%)</b>			
リンナイ	0.1	-	-
<b>機械 (2.5%)</b>			
クボタ	0.7	-	-
ダイキン工業	0.1	-	-
セガサミーホールディングス	0.2	-	-
マキタ	0.2	-	-
三菱重工業	0.1	0.4	1,308
<b>電気機器 (13.5%)</b>			
ブラザー工業	-	0.4	859
日本電気	0.4	-	-
富士通	0.3	-	-
セイコーエプソン	-	0.4	726
パナソニック	1.6	-	-
アズビル	0.2	-	-
村田製作所	0.1	-	-
東京エレクトロン	-	0.1	5,522

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>輸送用機器 (6.7%)</b>			
豊田自動織機	0.2	-	-
デンソー	0.4	-	-
いすゞ自動車	-	0.6	945
アイシン	-	0.2	875
マツダ	1	0.4	364
本田技研工業	1.8	-	-
スズキ	0.2	-	-
ヤマハ発動機	0.5	0.5	1,364
<b>精密機器 (0.8%)</b>			
島津製作所	-	0.1	417
<b>その他製品 (1.7%)</b>			
パンダイナムコホールディングス	0.2	-	-
大日本印刷	-	0.3	877
<b>電気・ガス業 (2.6%)</b>			
中国電力	0.5	-	-
東京瓦斯	-	0.6	1,388
大阪瓦斯	0.5	-	-
東邦瓦斯	0.1	-	-
<b>陸運業 (0.9%)</b>			
東海旅客鉄道	0.1	-	-
S Gホールディングス	-	0.2	495
<b>海運業 (3.7%)</b>			
日本郵船	-	0.2	1,932
<b>情報・通信業 (7.3%)</b>			
ネクソン	0.5	-	-
野村総合研究所	0.5	-	-
トレンドマイクロ	-	0.2	1,200
日本電信電話	1.6	0.8	2,628
東宝	0.2	-	-
カプコン	0.1	-	-
コナミホールディングス	0.1	-	-
<b>卸売業 (20.5%)</b>			
メディアパルホールディングス	-	0.4	848
伊藤忠商事	-	0.6	2,276
丸紅	-	1.2	1,419
三井物産	-	0.8	2,371
住友商事	-	0.8	1,489
三菱商事	-	0.6	2,378
<b>小売業 (2.5%)</b>			
ローソン	-	0.1	497
日本マクドナルドホールディングス	-	0.1	495
MonotaRO	0.1	-	-
ウエルシアホールディングス	-	0.1	317
セブン&アイ・ホールディングス	0.1	-	-
<b>銀行業 (5.8%)</b>			
ゆうちょ銀行	0.9	-	-
新生銀行	0.2	-	-
三井住友フィナンシャルグループ	-	0.6	2,586

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千葉銀行	0.6	—	—
静岡銀行	0.9	0.5	453
京都銀行	0.1	—	—
<b>証券、商品先物取引業 (3.5%)</b>			
SBIホールディングス	—	0.1	308
大和証券グループ本社	—	2.2	1,520
野村ホールディングス	1.8	—	—
<b>保険業 (2.9%)</b>			
かんぽ生命保険	—	0.4	837
第一生命ホールディングス	0.7	—	—
東京海上ホールディングス	—	0.1	689
<b>不動産業 (1.3%)</b>			
飯田グループホールディングス	0.2	0.3	673
<b>サービス業 (10.5%)</b>			
パーソルホールディングス	—	0.1	267

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベネフィット・ワン	—	0.1	262
電通グループ	—	0.2	924
ユー・エス・エス	—	0.4	772
日本郵政	—	1.6	1,569
セコム	—	0.2	1,718
	千株	千株	千円
合 計	株 数・金 額	27	20.9
	銘柄数<比率>	58銘柄	44銘柄
			<13.8%>

(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	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	—	—	—	インターネット販売・通信販売
AMGEN INC	—	0.4	—	1,035	バイオテクノロジー
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1.26	—	—	—	電力
AUTOMATIC DATA PROCESSING	—	0.34	6	792	情報技術サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	—	0.65	5	641	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	—	0.26	6	806	ヘルスケア機器・用品
VERIZON COMM INC	0.85	—	—	—	各種電気通信サービス
BEST BUY CO INC	—	0.46	4	534	専門小売り
YUM! BRANDS INC	0.19	0.4	4	560	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	—	1.14	4	536	電力
ROBERT HALF INTL INC	0.61	0.61	7	841	専門サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1.03	0.65	5	669	航空貨物・物流サービス
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	—	0.02	2	326	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	—	1.52	10	1,172	医薬品
ONEOK INC	—	1.26	7	915	石油・ガス・消耗燃料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	—	6.17	3	439	メディア
COTERRA ENERGY INC	6.03	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	2.83	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	—	0.41	8	945	機械
CITRIX SYSTEMS INC	—	0.49	4	576	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	3.29	3	376	各種電気通信サービス
CERNER CORP	—	0.28	2	296	ヘルスケア・テクノロジー
CISCO SYSTEMS INC	—	2.34	12	1,436	通信機器
COMCAST CORP-CL A	5.86	2.65	12	1,449	メディア
CONSOLIDATED EDISON INC	—	0.59	4	565	総合公益事業
SEALED AIR CORP	—	0.36	2	263	容器・包装
HEICO CORP-CL A	1.09	—	—	—	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	1.8	—	—	—	機械
DR HORTON INC	5.15	—	—	—	家庭用耐久財
MOODY'S CORP	—	0.08	2	298	資本市場

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	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	2.06	—	—	—	情報技術サービス
TARGET CORP	—	0.37	7	890	複合小売り
REPUBLIC SERVICES INC	—	0.37	4	506	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	0.06	—	—	—	専門サービス
OMNICOM GROUP	—	0.59	4	577	メディア
DUKE ENERGY CORP	0.65	—	—	—	電力
CITIGROUP INC	—	1.48	9	1,135	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	0.36	—	—	—	化学
EATON CORP PLC	1.26	—	—	—	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	—	0.16	2	262	ソフトウェア
ELECTRONIC ARTS INC	—	0.21	2	323	娯楽
ERIE INDEMNITY CO	0.38	—	—	—	保険
EOG RESOURCES INC	—	0.34	3	445	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	—	0.1	3	350	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	—	0.19	2	234	航空貨物・物流サービス
FASTENAL CO	—	1.27	6	761	商社・流通業
FORD MOTOR CO	—	3.53	6	711	自動車
GENERAL MILLS INC	4.42	—	—	—	食品
GENUINE PARTS CO	—	0.34	4	498	販売
GILEAD SCIENCES INC	2.25	1.03	6	726	バイオテクノロジー
VWV GRAINGER INC	—	0.05	2	269	商社・流通業
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	0.86	—	—	—	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	—	0.43	4	469	レジャー用品
HERSHEY FOODS CORP	—	0.14	2	328	食品
HP INC	—	2.27	8	956	コンピュータ・周辺機器
F5 INC	0.07	—	—	—	通信機器
JUNIPER NETWORKS INC	5.67	—	—	—	通信機器
HOME DEPOT INC	—	0.75	26	3,043	専門小売り
HORMEL FOODS CORP	4.48	—	—	—	食品
BIOGEN INC	—	0.11	2	271	バイオテクノロジー
INTUIT INC	0.43	0.07	3	427	ソフトウェア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	0.95	—	—	—	建設関連製品
INTEL CORP	—	2.41	11	1,323	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	—	1.16	4	469	メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	0.25	4	491	情報技術サービス
JOHNSON & JOHNSON	—	1.34	22	2,561	医薬品
KEYCORP	—	3.16	8	945	銀行
KROGER CO	—	0.59	2	311	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	0.15	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PACKAGING CORP OF AMERICA	1.4	0.32	4	543	容器・包装
LENNAR CORP	1.73	—	—	—	家庭用耐久財
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	—	0.48	10	1,185	航空貨物・物流サービス
LOWE'S COS INC	—	0.18	4	469	専門小売り
S&P GLOBAL INC	—	0.08	3	351	資本市場
METLIFE INC	—	0.92	6	744	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	0.6	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	—	0.93	9	1,098	ヘルスケア機器・用品
MERCK & CO.INC.	—	1.53	11	1,350	医薬品
MICROSOFT CORP	1.62	1.03	30	3,507	ソフトウェア
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	0.81	—	—	—	半導体・半導体製造装置
3M CO	—	0.45	7	820	コングロマリット
NETAPP INC	—	0.51	4	516	コンピュータ・周辺機器

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	千アメリカ・ドル	千円	
NEWELL BRANDS INC	—	1.85	4	532	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	1.14	—	—	—	金属・鉱業
NORFOLK SOUTHERN CORP	—	0.23	6	722	陸運・鉄道
NUCOR CORP	—	0.23	2	311	金属・鉱業
ORACLE CORP	—	1.12	8	1,020	ソフトウェア
PACCAR INC	4.93	—	—	—	機械
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	0.05	2	291	ヘルスケア機器・用品
PFIZER INC	—	3	14	1,724	医薬品
BROWN & BROWN INC	—	0.37	2	281	保険
GARMIN LTD	2.07	—	—	—	家庭用耐久財
T ROWE PRICE GROUP INC	2.75	—	—	—	資本市場
PROCTER & GAMBLE CO	0.15	—	—	—	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	3.41	0.61	6	747	保険
QUALCOMM INC	0.88	0.68	11	1,296	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	0.35	—	—	—	バイオテクノロジー
US BANCORP	—	1.26	7	841	銀行
SEAGEN INC	0.03	—	—	—	バイオテクノロジー
THE TRAVELERS COMPANIES INC	0.41	—	—	—	保険
POOL CORP	—	0.05	2	260	販売
ANTHEM INC	—	0.08	3	409	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	—	0.36	5	582	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	—	0.29	2	238	建設関連製品
SNAP-ON INC	0.75	0.2	4	486	機械
AT&T INC	—	4.49	10	1,246	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	—	1.61	22	2,539	石油・ガス・消耗燃料
NORTONLIFELOCK INC	—	1.66	4	564	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	2.18	—	—	—	ソフトウェア
TERADYNE INC	0.35	0.16	1	207	半導体・半導体製造装置
TYSON FOODS INC	2.4	—	—	—	食品
UNION PACIFIC CORP	—	0.43	10	1,203	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	1.07	10	1,155	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	—	0.47	22	2,573	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	—	0.14	3	373	バイオテクノロジー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	0.06	—	—	—	食品・生活必需品小売り
WATERS CORP	—	0.07	2	256	ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1.9	—	—	—	食品
WHIRLPOOL CORP	—	0.19	3	431	家庭用耐久財
WILLIAMS COS INC	—	1.93	5	670	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	—	0.99	6	776	専門小売り
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	3	—	—	—	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	1	—	—	—	コングロマリット
REGIONS FINANCIAL CORP	—	1.17	2	331	銀行
T-MOBILE US INC	1.44	—	—	—	無線通信サービス
CELANESE CORP	—	0.15	2	266	化学
MASIMO CORP	0.25	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	—	0.07	2	253	繊維・アパレル・贅沢品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	—	1.04	11	1,311	タバコ
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1.88	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	—	0.22	3	460	航空宇宙・防衛
HCA HEALTHCARE INC	—	0.12	2	326	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	—	0.5	3	428	専門サービス
TESLA INC	—	0.14	12	1,415	自動車

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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PHILLIPS 66	—	0.69	6	720	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	0.65	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
WORKDAY INC	0.27	—	—	—	ソフトウェア
ABBVIE INC	—	1.03	14	1,700	バイオテクノロジー
NEWS CORP/NEW-CL A	5.83	—	—	—	メディア
BROADCOM INC	—	0.22	12	1,469	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	0.25	—	—	—	電力
STERIS PLC	0.35	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
CIGNA CORP	—	0.31	6	805	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DOW INC	—	0.99	6	695	化学
MATCH GROUP INC	0.91	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	—	0.68	7	832	コンピュータ・周辺機器
PAYCOM SOFTWARE INC	0.02	—	—	—	ソフトウェア
IAC/INTERACTIVECORP	0.92	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	0.33	3.31	4	574	医薬品
FNF GROUP	—	0.84	4	463	保険
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	0.14	2	268	電子装置・機器・部品
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC	—	2	11	1,315	飲料
KRAFT HEINZ CO	—	1.32	4	526	食品
ALPHABET INC-CL A	0.17	0.05	13	1,564	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	0.71	2.97	5	578	コンピュータ・周辺機器
ALPHABET INC-CL C	0.14	0.05	13	1,561	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 >	98.82 65銘柄	95.11 107銘柄	736 —	84,975 <22.3%>
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	—	2.63	17	1,592	金属・鉱業
BARRICK GOLD CORP	9.27	—	—	—	金属・鉱業
BCE INC	—	2.44	16	1,470	各種電気通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2.85	2.9	46	4,246	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	7.04	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	0.97	—	—	—	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	—	7.3	25	2,319	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1.59	3.89	60	5,517	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	5.91	—	—	—	金属・鉱業
KINROSS GOLD CORP	18.3	—	—	—	金属・鉱業
FORTIS INC	6.46	—	—	—	電力
GREAT WEST LIFECO INC	—	4.96	19	1,788	保険
IMPERIAL OIL LTD	2.43	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	—	5.57	25	2,292	資本市場
MAGNA INTERNATIONAL INC	4.69	—	—	—	自動車部品
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.26	—	—	—	保険
METRO INC	3.79	—	—	—	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	3.31	—	—	—	電力
QUEBECOR INC-B	—	5.7	17	1,590	メディア
SUNCOR ENERGY INC	6.98	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TC ENERGY CORP	0.51	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	1.33	16	1,502	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	0.45	—	—	—	食品・生活必需品小売り
B2GOLD CORP	18.53	—	—	—	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	—	3.97	37	3,363	化学
WSP GLOBAL INC	—	1.23	19	1,805	建設・土木
HYDRO ONE LTD	4.29	—	—	—	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	97.63 18銘柄	41.92 11銘柄	303 —	27,490 <7.2%>



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	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	5.81	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	14.89	—	—	—	金属・鉱業
BHP GROUP LTD	1.88	8.95	43	3,560	金属・鉱業
COMPUTERSHARE LT	—	5.17	11	981	情報技術サービス
ORIGIN ENERGY LTD	22.71	—	—	—	電力
RIO TINTO LIMITED	0.45	—	—	—	金属・鉱業
TPG TELECOM LTD	7.35	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	0.87	4.06	18	1,560	建設資材
BLUESCOPE STEEL LTD	6.79	—	—	—	金属・鉱業
NEWCREST MINING LTD	8.68	—	—	—	金属・鉱業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	4.84	—	—	—	保険
SONIC HEALTHCARE	4.53	2.88	10	889	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	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	39.95	20.89	10	894	ホテル・レストラン・レジャー
WOODSIDE PETROLEUM LTD	3.13	5.78	15	1,304	石油・ガス・消耗燃料
AUSNET SERVICES	34.91	—	—	—	電力
EVOLUTION MINING LTD	24.65	—	—	—	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	—	26.42	9	787	陸運・鉄道
IDP EDUCATION LTD	—	3.71	10	838	各種消費者サービス
COLES GROUP LTD	—	7.56	12	1,015	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	2.12	—	—	—	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	184.99 17銘柄	85.42 9銘柄	143 —	11,831 <3.1%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	1	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PCCW LTD	100	—	—	—	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	—	25	127	1,883	電力
MTR CORP	10	—	—	—	陸運・鉄道
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	—	35	174	2,583	電力
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	20	30	137	2,029	ホテル・レストラン・レジャー
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	20	—	—	—	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	40	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
HKT TRUST / HKT LTD	50	—	—	—	各種電気通信サービス
SITC INTERNATIONAL CO LTD	—	40	125	1,857	海運業
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	65	—	—	—	電力
WH GROUP LTD	115	—	—	—	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	421 9銘柄	130 4銘柄	564 —	8,354 <2.2%>
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BHP GROUP PLC	5.19	—	—	—	金属・鉱業
BT GROUP PLC	80.47	—	—	—	各種電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL	1.71	—	—	—	化学
DIAGEO PLC	—	3.96	14	2,247	飲料
NATIONAL GRID PLC	18.24	—	—	—	総合公益事業
KINGFISHER PLC	36.93	—	—	—	専門小売り
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	7.2	—	—	—	タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	1.36	—	—	—	金属・鉱業
HSBC HOLDINGS PLC	48.21	—	—	—	銀行
UNILEVER PLC	1.29	—	—	—	パーソナル用品
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	35.15	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	9.99	—	—	—	メディア
PERSIMMON PLC	5.55	—	—	—	家庭用耐久財

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	
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RIO TINTO PLC	6.9	—	—	—	金属・鉱業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1.48	—	—	—	家庭用品
RELX PLC	—	8.86	19	3,099	専門サービス
SSE PLC	—	7.97	12	1,898	電力
BP PLC	14.61	80.12	32	5,014	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	11.22	13.12	8	1,398	ソフトウェア
TAYLOR WIMPLEY PLC	58.35	—	—	—	家庭用耐久財
TESCO PLC	—	22.69	6	1,047	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	1.19	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	—	18.79	29	4,612	医薬品
SAINSBURY (J) PLC	27.18	35.49	9	1,537	食品・生活必需品小売り
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	0.37	—	—	—	家庭用耐久財
SHELL PLC-A SHS	5.16	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2.69	—	—	—	医薬品
EXPERIAN PLC	—	2.24	6	1,002	専門サービス
MONDI PLC	6.75	—	—	—	紙製品・林産品
INFORMA PLC	15.32	—	—	—	メディア
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	17.44	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG	—	1.68	4	631	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	14.77	9	1,516	保険
FERGUSON PLC	—	0.57	6	975	商社・流通業
AUTO TRADER GROUP PLC	—	6.23	3	621	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 >	419.95 25銘柄	216.49 13銘柄	163 —	25,603 <6.7%>
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
LOGITECH INTL-REG	1.39	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	1.04	4.28	50	6,272	食品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.7	0.22	7	940	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	2.65	—	—	—	医薬品
SWISSCOM AG-REG	0.07	—	—	—	各種電気通信サービス
ABB LTD	—	4.31	13	1,690	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	—	2.22	10	1,294	専門サービス
GEBERIT AG	—	0.04	2	297	建設関連製品
ROCHE HOLDING AG-BEARER	—	0.07	2	324	医薬品
HOLCIM LTD	—	2.56	12	1,621	建設資材
SONOVA HOLDING AG	0.28	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG	—	0.02	2	345	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	0.28	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	0.51	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
BANQUE CANTONALE VAUD	0.36	—	—	—	銀行
SWISS RE LTD	—	1.32	12	1,617	保険
UBS GROUP AG	12.55	—	—	—	資本市場
VAT GROUP AG	—	0.07	2	297	機械
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比率 >	19.83 10銘柄	15.11 10銘柄	117 —	14,701 <3.8%>
<b>(スウェーデン)</b>	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ERICSSON LM-B SHS	5.28	19.11	220	2,706	通信機器
VOLVO AB-A SHS	—	3.78	80	989	機械
VOLVO AB-B SHS	—	9.42	198	2,443	機械
SWEDISH MATCH AB	0.96	—	—	—	タバコ
TELE2 AB-B SHS	0.5	6.87	89	1,104	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	1.2	2.67	76	944	各種金融サービス

銘柄	株数	当 期		末 期		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INDUSTRIVARDEN C	2.63	2.87	81	996	各種金融サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	2.87	—	—	—	家庭用耐久財	
INVESTOR AB-B SHS	6.66	—	—	—	各種金融サービス	
ASSA ABLOY AB-B	3.23	—	—	—	建設関連製品	
TELIA CO AB	15.62	—	—	—	各種電気通信サービス	
BOLIDEN AB	4.22	—	—	—	金属・鉱業	
KINNEVIK AB-B	3.66	—	—	—	各種金融サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	5.62	3.15	38	469	機械	
HEXAGON AB-B SHS	0.13	—	—	—	電子装置・機器・部品	
EPIROC AB-A	—	3.09	58	721	機械	
EPIROC AB-B	—	2.58	41	514	機械	
EQT AB	—	1.36	46	567	資本市場	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	52.58 13銘柄	54.9 10銘柄	931 —	11,457 <3.0%>	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KINGSPAN GROUP PLC	—	0.83	7	942	建設関連製品	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —銘柄	0.83 1銘柄	7 —	942 <0.2%>	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ING GROEP NV-CVA	—	16.92	21	2,846	銀行	
ASM INTERNATIONAL NV	—	0.33	9	1,177	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	—	2.69	16	2,209	専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2.82	5.23	15	1,964	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1.75	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
VOPAK (KON.)	1.56	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
KONINKLIJKE KPN NV	—	35.44	10	1,425	各種電気通信サービス	
FERRARI NV	—	0.48	9	1,214	自動車	
STELLANTIS NV	11.47	—	—	—	自動車	
NN GROUP NV	4.88	2.29	11	1,508	保険	
STELLANTIS NV	11.19	—	—	—	自動車	
ABN AMRO BANK NV	—	6.95	8	1,169	銀行	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	33.67 6銘柄	70.33 8銘柄	103 —	13,515 <3.5%>	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SOFINA	0.27	—	—	—	各種金融サービス	
SOLVAY SA	—	0.92	9	1,276	化学	
AGEAS	—	2.1	9	1,212	保険	
UCB SA	1.85	—	—	—	医薬品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	0.48	—	—	—	各種金融サービス	
ELIA GROUP	0.33	—	—	—	電力	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2.93 4銘柄	3.02 2銘柄	19 —	2,489 <0.7%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SES FDR	1.26	—	—	—	メディア	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1.26 1銘柄	— —銘柄	— —	— <—%>	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BNP PARIBAS	—	4.39	27	3,539	銀行	
CAPGEMINI SA	2.13	—	—	—	情報技術サービス	
EIFFAGE	—	1.06	10	1,328	建設・土木	
L'OREAL	0.56	0.65	22	2,996	パーソナル用品	
MICHELIN(CGDE)-B	2.35	—	—	—	自動車部品	

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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
REMY COINTREAU	—	0.28	4	642	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	5.22	—	—	—	建設関連製品
SEB SA	0.37	0.59	7	1,038	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	0.89	—	—	—	電気設備
TOTALENERGIES SE	5.93	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	0.96	—	—	—	自動車部品
ORANGE	4.65	—	—	—	各種電気通信サービス
HERMES INTL	0.17	0.1	11	1,549	繊維・アパレル・贅沢品
CARREFOUR SA	9.12	6.26	10	1,406	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	1.04	—	—	—	情報技術サービス
SANOFI	5.2	3.94	36	4,742	医薬品
ESSILORLUXOTTICA	—	1.2	19	2,576	繊維・アパレル・贅沢品
WENDEL	—	0.78	7	946	各種金融サービス
ILIAD SA	0.03	—	—	—	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	0.41	0.49	4	646	ヘルスケア機器・用品
ENGIE	—	10.51	15	1,961	総合公益事業
ELECTRICITE DE FRANCE	4.17	—	—	—	電力
IPSEN SA	—	0.66	6	804	医薬品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	2.17	7	1,024	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	43.2 16銘柄	33.08 14銘柄	193 —	25,203 <6.6%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4.27	3.49	32	4,218	自動車
FRESENIUS SE & CO KGAA	—	3.22	11	1,537	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	1.55	—	—	—	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	0.21	—	—	—	化学
CONTINENTAL AG	1.63	—	—	—	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	—	7.06	36	4,720	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	—	1.28	10	1,428	自動車
MERCK KGAA	0.77	—	—	—	医薬品
SAP SE	—	3.42	36	4,705	ソフトウェア
HENKEL AG & CO KGAA	1.84	—	—	—	家庭用品
BAYER AG	—	4.23	22	2,914	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2.43	—	—	—	家庭用品
BEIERSDORF AG	1.21	—	—	—	パーソナル用品
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	2.35	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VOLKSWAGEN AG	0.37	—	—	—	自動車
DEUTSCHE BANK AG-REG	29.48	—	—	—	資本市場
BMW VORZUG	1.01	—	—	—	自動車
BECHTLE AG	—	0.97	4	596	情報技術サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	—	32.01	8	1,107	各種電気通信サービス
COVESTRO AG	—	3.26	17	2,243	化学
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	47.12 12銘柄	58.94 9銘柄	179 —	23,472 <6.1%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	35.01	—	—	—	電力
TELEFONICA S.A	—	32.79	14	1,874	各種電気通信サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	4.18	—	—	—	ガス
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	—	6.29	10	1,397	電力
INDITEX	—	9.59	24	3,171	専門小売り
ENAGAS	—	4.31	8	1,046	ガス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	39.19 2銘柄	52.98 4銘柄	57 —	7,490 <2.0%>

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	—	4.99	9	1,195	保険
UNICREDIT SPA	1.97	—	—	—	銀行
ENI SPA	18.22	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENEL SPA	32.06	—	—	—	電力
TELECOM ITALIA SPA	90.98	—	—	—	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	120.61	—	—	—	各種電気通信サービス
RECORDATI SPA	0.84	—	—	—	医薬品
DIASORIN SPA	—	0.37	4	578	ヘルスケア機器・用品
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	5.33	—	—	—	各種電気通信サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	270.01 7銘柄	5.36 2銘柄	13 —	1,774 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	3.75	—	—	—	紙製品・林産品
NOKIA OYJ	72.89	—	—	—	通信機器
NESTE OYJ	2.87	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ORION OYJ	—	2.29	7	1,039	医薬品
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	79.51 3銘柄	2.29 1銘柄	7 —	1,039 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	2.6	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VOEST-ALPINE AG	1.77	—	—	—	金属・鉱業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	4.37 2銘柄	— —銘柄	— —	— <—%>
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,816.06 210銘柄	865.78 205銘柄	— —	260,343 <68.2%>

(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) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	株数	株数	当 期 末	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	—	0.523	3	434
AGNC INVESTMENT CORP	—	0.267	3	422
合 計	口数・金額 銘柄数<比率>	— —銘柄<—%>	0.79 2銘柄<0.2%>	7 —
				856 —

(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投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(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。

## (4) 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 38
	S & P 5 0 0 E M I N I F U T	百万円 -	百万円 76
国外	S & P / T S E 6 0 I X F U T	-	23
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	-	14
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	-	23
	S W I S S M K T I X F U T U R E	-	14
	O M X S 3 0 I N D F U T U R E	-	8
国	D J E U R O S T O X X 5 0	-	52

(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

2022年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 312,967	% 80.6
投資信託受益証券、投資証券	856	0.2
コール・ローン等、その他	74,339	19.2
投資信託財産総額	388,163	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、307,563千円、79.2%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、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.42円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=82.31円、1香港・ドル=14.79円、1イギリス・ポンド=156.24円、1スイス・フラン=124.94円、1スウェーデン・クローナ=12.30円、1ユーロ=130.56円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	705,049,398円
コール・ローン等	30,940,685
株 式(評価額)	312,967,396
投資証券(評価額)	856,525
未 収 入 金	327,370,943
未 収 配 当 金	296,418
差入委託証拠金	32,617,431
(B) 負 債	323,154,529
未 払 金	323,154,529
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	381,894,869
元 本	412,865,194
次 期 繰 越 損 益 金	△30,970,325
(D) 受 益 権 総 口 数	412,865,194口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,250円

(注1) 期首元本額 482,346,519円  
追加設定元本額 17,589,679円  
一部解約元本額 87,071,004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) 412,865,194円  
期末元本合計 412,865,194円

## ■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	9,078,786円
受 取 配 当 金	9,083,121
受 取 利 息	101
そ の 他 収 益 金	71
支 払 利 息	△4,507
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	36,463,182
売 買 益	111,116,938
売 買 損	△74,653,756
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△32,197,668
取 引 益	17,843,838
取 引 損	△50,041,506
(D) そ の 他 費 用	△2,833,704
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	10,510,596
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△46,962,246
(G) 解 約 差 損 益 金	7,071,004
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,589,679
(I) 合 計(E+F+G+H)	△30,970,325
次 期 繰 越 損 益 金(I)	△30,970,325

(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。