

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2023年8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
運用方法	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。
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、2023年8月15日に第14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

<https://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 込み 分 配 金	騰落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
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
12期 (2022年8月15日)	8,712	10	△0.2	82.1	△70.2	—	379
13期 (2023年2月15日)	8,627	10	△0.9	86.6	△75.6	—	364
14期 (2023年8月15日)	8,423	10	△2.2	92.4	△91.3	0.2	341

(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) 2023年2月15日	円	%	%	%	%
2月末	8,627	—	86.6	△75.6	—
3月末	8,640	0.2	86.2	△74.8	—
4月末	8,548	△0.9	86.4	△75.8	—
5月末	8,480	△1.7	89.6	△80.1	—
6月末	8,355	△3.2	92.0	△83.7	—
7月末	8,408	△2.5	91.0	△89.5	0.2
7月末	8,406	△2.6	93.4	△91.7	0.2
(期末) 2023年8月15日	8,433	△2.2	92.4	△91.3	0.2

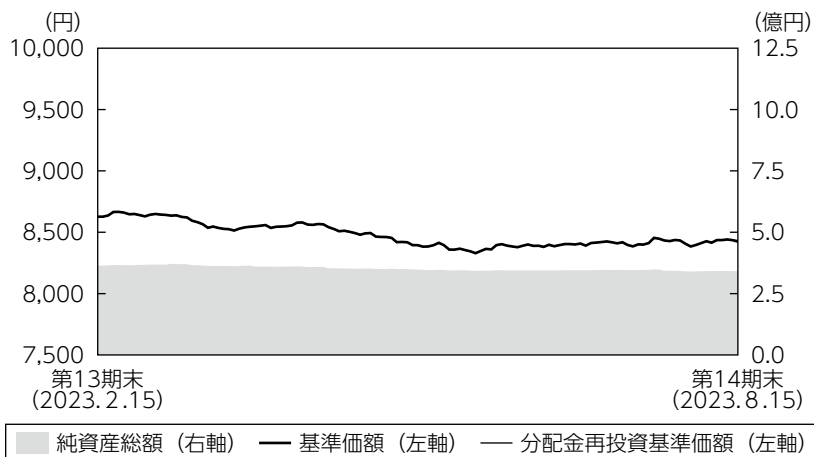
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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（2023年2月16日から2023年8月15日まで）

基準価額等の推移



第14期首： 8,627円
第14期末： 8,423円
(既払分配金10円)
騰落率： $\Delta 2.2\%$
(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。当該期間を通して、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軟調に推移したため、この点が基準価額に対してマイナスに影響しました。一方で、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は堅調に推移しましたが、高配当銘柄群のマイナスの影響を打ち消すには至りませんでした。

投資環境

米国の中堅銀行の経営破綻をきっかけとして、米国および欧州に金融不安が広がったことを背景に、期初から2023年3月中旬にかけて株式市場は下落しました。その後は金融不安が和らいだことや、米連邦債務上限問題が決着し、債務不履行懸念が払拭されたことに加え、各国の物価指標からインフレ鈍化が確認されたことなどを受け、利上げ長期化観測が後退したことなどにより、株式市場は上昇しました。

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	ASML HOLDING NV	ユーロ	2.4%
2	NESTLE SA-REGISTERED	スイス・フラン	2.2
3	GSK PLC	イギリス・ポンド	1.6
4	BHP GROUP LTD	オーストラリア・ドル	1.4
5	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	1.4
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.3
7	BANK OF NOVA SCOTIA	カナダ・ドル	1.2
8	BP PLC	イギリス・ポンド	1.1
9	SANOFI	ユーロ	1.1
10	INDITEX	ユーロ	1.1
組入銘柄数		221銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ASML HOLDING NV	ユーロ	2.0%
2	GSK PLC	イギリス・ポンド	1.6
3	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	1.3
4	BHP GROUP LTD	オーストラリア・ドル	1.2
5	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	1.2
6	SWISS RE LTD	スイス・フラン	1.2
7	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
8	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	1.1
9	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	1.1
10	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス・ポンド	1.1
組入銘柄数		232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
	2023年2月16日 ～2023年8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	860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、安定的なリターンを獲得に努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2023年2月16日 ～2023年8月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	38円	0.453%	(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8,476円です。
(投信会社)	(18)	(0.218)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(18)	(0.218)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(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	4	0.045	(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)	(0.027)	
(先物・オプション)	(1)	(0.018)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	2	0.028	(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)	(2)	(0.028)	
(d) その他費用	33	0.392	(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)	(33)	(0.389)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	78	0.918	

(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。

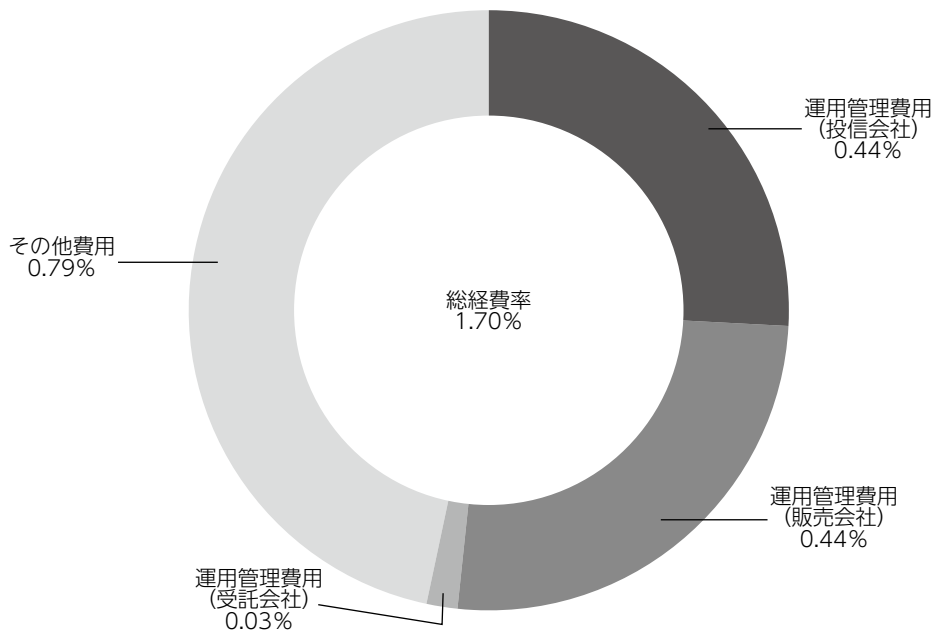
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.70%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（2023年2月16日から2023年8月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 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□ -	千円 -	千□ 15,400	千円 14,000

■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	326,744千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	315,503千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.03

(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（2023年2月16日から2023年8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)	158千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B)／(A)	1.7%

(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まず。

【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 610	百万円 85	% 14.0	百万円 611	百万円 84	% 13.9

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 388,958	千口 373,557		千円 338,741

<補足情報>

■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）マザーファンドの組入資産の明細

下記は、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（373,557,545口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在	
	株数	千株	株数	千株
食料品（-％）		千株	千株	千円
ヤクルト本社	0.1	—	—	—
日本たばこ産業	0.6	—	—	—
化学（2.1％）				
住友化学	1.9	—	—	—
信越化学工業	0.1	—	—	—
資生堂	0.1	—	—	—
日東電工	—	0.1	970	
医薬品（-％）				
武田薬品工業	0.6	—	—	—
石油・石炭製品（-％）				
出光興産	0.2	—	—	—
ゴム製品（2.5％）				
ブリヂストン	—	0.2	1,118	
鉄鋼（7.4％）				
日本製鉄	0.6	0.6	2,034	
JFEホールディングス	0.6	0.6	1,350	
金属製品（-％）				
SUMCO	0.5	—	—	—
電気機器（9.3％）				
オムロン	—	0.1	701	
セイコーエプソン	0.4	0.4	941	
アズビル	—	0.1	474	
シスメックス	0.1	—	—	—
浜松ホトニクス	0.1	—	—	—
キャノン	—	0.6	2,147	
リコー	0.8	—	—	—
輸送用機器（1.5％）				
マツダ	1.3	0.5	705	
ヤマハ発動機	0.2	—	—	—
その他製品（-％）				
任天堂	0.5	—	—	—
電気・ガス業（2.9％）				
関西電力	0.8	0.7	1,330	
東京瓦斯	0.2	—	—	—
陸運業（-％）				
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	—	—	—
海運業（12.0％）				
日本郵船	0.4	0.4	1,535	
商船三井	0.3	0.6	2,434	
川崎汽船	—	0.3	1,485	

銘柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在	
	株数	千株	株数	千株
空運業（-％）		千株	千株	千円
日本航空	0.2	—	—	—
情報・通信業（4.9％）				
トレンドマイクロ	0.2	—	—	—
大塚商会	0.2	—	—	—
日本電信電話	—	10	1,640	
カプコン	0.1	0.1	611	
S C S K	0.4	—	—	—
卸売業（9.3％）				
丸紅	0.9	0.9	2,185	
住友商事	0.6	0.7	2,079	
三菱商事	0.6	—	—	—
小売業（7.1％）				
日本マクドナルドホールディングス	0.2	—	—	—
ZOZO	—	0.3	812	
セブン&アイ・ホールディングス	0.4	0.4	2,446	
銀行業（21.6％）				
ゆうちょ銀行	—	1.3	1,499	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.6	2.6	2,915	
三井住友トラスト・ホールディングス	0.2	0.3	1,577	
三井住友フィナンシャルグループ	0.8	0.6	3,840	
証券・商品先物取引業（2.6％）				
SBIホールディングス	—	0.4	1,172	
保険業（9.5％）				
SOMPOホールディングス	0.2	0.4	2,478	
東京海上ホールディングス	—	0.6	1,863	
不動産業（4.5％）				
ヒューリック	—	0.8	988	
野村不動産ホールディングス	—	0.3	1,053	
サービス業（2.7％）				
博報堂DYホールディングス	0.6	—	—	—
ユー・エス・エス	—	0.4	1,012	
日本郵政	1.3	0.2	216	
合計	株数・金額	千株	千株	千円
		20	25.5	45,623
	銘柄数<比率>	38銘柄	30銘柄	<13.5%>

(注1) 銘柄欄の（ ）内は、2023年8月15日現在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、2023年8月15日現在のマザーファンド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	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在		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	
AMGEN INC	0.43	0.5	13	1,899	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	0.99	1.04	6	899	建設関連製品
APPLIED MATERIALS INC	-	0.22	3	454	半導体・半導体製造装置
AUTOMATIC DATA PROCESSING	0.38	0.42	10	1,540	専門サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	-	1.4	6	920	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	-	1.24	5	772	ヘルスケア機器・用品
VERIZON COMM INC	-	3.57	11	1,744	各種電気通信サービス
BEST BUY CO INC	0.97	-	-	-	専門小売り
FIRSTENERGY CORP	2.01	-	-	-	電力
BORGWARNER INC	-	0.42	1	252	自動車用部品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	-	0.51	4	708	航空貨物・物流サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1.66	1.85	11	1,659	医薬品
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	0.34	0.39	4	641	保険
FEDEX CORP	0.38	-	-	-	航空貨物・物流サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	-	15.96	7	1,092	メディア
CARDINAL HEALTH INC	0.65	0.61	5	825	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CISCO SYSTEMS INC	2.97	3.15	16	2,471	通信機器
NRG ENERGY, INC.	1.39	-	-	-	電力
COMCAST CORP-CL A	3.4	3.42	15	2,318	メディア
MOODY'S CORP	-	0.07	2	345	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	0.42	-	-	-	商業サービス・用品
OMNICOM GROUP	0.62	0.54	4	628	メディア
CITIGROUP INC	1.91	-	-	-	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	-	0.57	4	698	化学
CADENCE DESIGN SYS INC	0.16	-	-	-	ソフトウェア
ELECTRONIC ARTS INC	-	0.17	2	303	娯楽
ENTERGY CORP	0.46	-	-	-	電力
EXPEDITORS INTERNATIONAL	0.27	0.17	1	289	航空貨物・物流サービス
FAIR ISAAC CORP	0.05	-	-	-	ソフトウェア
FASTENAL CO	1.27	1.06	6	891	商社・流通業
FORD MOTOR CO	-	5.21	6	925	自動車
GILEAD SCIENCES INC	1.51	1.25	9	1,453	バイオテクノロジー
GARTNER INC	0.1	-	-	-	情報技術サービス
GRACO INC	-	0.23	1	261	機械
WW GRAINGER INC	0.05	0.03	2	312	商社・流通業
MONSTER BEVERAGE CORP	-	0.4	2	343	飲料
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	-	0.32	5	868	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	0.8	0.73	4	697	レジャー用品
HERSHEY FOODS CORP	-	0.09	2	294	食品
HP INC	2.04	1.83	5	854	コンピュータ・周辺機器
JUNIPER NETWORKS INC	1.43	-	-	-	通信機器
HOME DEPOT INC	0.66	-	-	-	専門小売り
LENNOX INTERNATIONAL INC	-	0.06	2	325	建設関連製品
HUNTINGTON BANCSHARES INC	-	4.52	5	769	銀行
ILLINOIS TOOL WORKS	0.58	-	-	-	機械
INTEL CORP	-	3.52	12	1,828	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	-	1.24	4	595	メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	-	0.12	2	300	金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	1.58	1.77	30	4,469	医薬品

銘柄	2023年2月15日現在	2023年8月15日現在			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	
KLA CORPORATION	—	0.05	2	357	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	0.47	0.5	6	927	家庭用品
KROGER CO	—	0.47	2	332	生活必需品流通・小売り
ELI LILLY & CO	—	0.13	6	1,018	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	0.64	—	—	—	専門小売り
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	0.62	—	—	—	航空貨物・物流サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	0.2	—	—	—	航空宇宙・防衛
LOWE'S COS INC	0.68	0.68	15	2,236	専門小売り
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	—	0.28	2	328	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	—	0.16	3	447	保険
METLIFE INC	—	1.13	7	1,045	保険
MICROSOFT CORP	—	0.83	26	3,915	ソフトウェア
NETAPP INC	—	0.69	5	768	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	3.4	—	—	—	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	1.24	1.42	5	815	金属・鉱業
NORFOLK SOUTHERN CORP	—	0.32	6	1,003	陸上運輸
ORACLE CORP	—	1.24	14	2,086	ソフトウェア
PAYCHEX INC	0.52	0.54	6	982	専門サービス
PEPSICO INC	0.73	0.73	13	1,951	飲料
PFIZER INC	3.66	3.66	13	1,922	医薬品
ALTRIA GROUP INC	1.79	—	—	—	タバコ
BROWN & BROWN INC	—	0.31	2	321	保険
T ROWE PRICE GROUP INC	0.48	0.5	5	817	資本市場
QUALCOMM INC	0.94	—	—	—	半導体・半導体製造装置
US BANCORP	1.68	—	—	—	銀行
ROLLINS INC	0.68	0.47	1	283	商業サービス・用品
ACCENTURE PLC-CL A	0.47	0.49	15	2,223	情報技術サービス
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	—	1.09	6	888	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	—	0.01	3	470	ホテル・レストラン・レジャー
ELEVANCE HEALTH INC	0.08	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	—	0.1	2	402	化学
SNAP-ON INC	0.38	—	—	—	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	—	0.69	6	955	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	1.66	—	—	—	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	—	1.37	4	668	旅客航空輸送
AT&T INC	5.84	6.69	9	1,389	各種電気通信サービス
STEEL DYNAMICS INC	0.29	—	—	—	金属・鉱業
SYNOPSIS INC	—	0.06	2	379	ソフトウェア
TEXAS INSTRUMENTS INC	0.72	—	—	—	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	—	0.56	12	1,873	陸上運輸
RTX CORP	1.16	1.26	10	1,585	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.46	0.46	23	3,422	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	—	0.08	2	406	バイオテクノロジー
WALMART INC	—	0.28	4	652	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	0.47	—	—	—	商業サービス・用品
WATSCO INC	—	0.19	6	999	商社・流通業
REGIONS FINANCIAL CORP	1.61	—	—	—	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	—	0.15	5	868	ホテル・レストラン・レジャー
T-MOBILE US INC	—	0.21	2	426	無線通信サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	0.16	2	353	建設関連製品

銘柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在		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	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	—	0.01	1	269	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN UNION CO	3.18	—	—	—	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	0.12	0.06	2	336	繊維・アパレル・贅沢品
ULTA BEAUTY INC	0.07	—	—	—	専門小売り
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1.19	—	—	—	タバコ
VISA INC	—	0.26	6	919	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	—	0.15	2	310	水道
HCA HEALTHCARE INC	—	0.09	2	354	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NXP SEMICONDUCTOR NV	0.46	0.36	7	1,086	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	0.72	0.46	5	817	専門サービス
LEAR CORP	0.35	—	—	—	自動車用部品
FORTINET INC	0.69	0.33	1	286	ソフトウェア
PHILLIPS 66	0.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	—	0.31	9	1,382	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ABBVIE INC	1.16	1.32	20	2,926	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	0.28	0.28	23	3,481	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	—	0.81	4	679	電力
ALLEGION PLC	0.24	—	—	—	建設関連製品
DROPBOX INC	—	0.76	2	313	ソフトウェア
CIGNA GROUP	0.59	0.32	9	1,350	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	1.17	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	1.18	1.19	6	959	化学
FOX CORP-B	1.51	—	—	—	メディア
FERGUSON PLC	0.43	—	—	—	商社・流通業
CARLYLE GROUP INC	1.51	—	—	—	資本市場
F&G ANNUITIES & LIFE INC	0.08	—	—	—	保険
ROYALTY PHARMA PLC	1.19	1.45	4	635	医薬品
VIATRIS INC	4.38	4.99	5	813	医薬品
HF SINCLAIR CORP	—	0.97	5	818	石油・ガス・消耗燃料
ARISTA NETWORKS INC	—	0.13	2	337	通信機器
PHINIA INC	—	0.08	0.22744	33	自動車用部品
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1.31	—	—	—	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	0.13	2	297	電子装置・機器・部品
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC	—	1	6	934	飲料
KRAFT HEINZ CO	1.39	1.57	5	782	食品
ALPHABET INC-CL A	—	0.8	10	1,529	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	3.23	3.21	5	822	コンピュータ・周辺機器
ALPHABET INC-CL C	—	0.74	9	1,420	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>	87.41 79銘柄	108.34 98銘柄	680 —	99,094 <29.3%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA	5.87	4.89	31	3,395	銀行
BCE INC	4.17	1.77	9	1,077	各種電気通信サービス
CGI INC	—	1.47	20	2,205	情報技術サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	—	4.28	23	2,575	銀行
CANADIAN TIRE CORP-CL A	0.86	—	—	—	大規模小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	3.97	5.68	18	1,967	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3.06	2.26	35	3,823	陸上運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3.21	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
EMPIRE CO LTD	—	3.28	11	1,269	生活必需品流通・小売り

銘柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在		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	20.84	20.84	13	1,512	金属・鉱業
RB GLOBAL INC	1.67	—	—	—	商業サービス・用品
IGM FINANCIAL INC	6.04	—	—	—	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	—	9.01	23	2,530	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	—	0.18	20	2,200	保険
QUEBECOR INC-B	3.93	—	—	—	メディア
LUNDIN MINING CORP	13.22	—	—	—	金属・鉱業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1.26	1.14	13	1,424	商社・流通業
ARC RESOURCES LTD	13.47	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	—	5.33	11	1,216	金融サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	—	3.17	15	1,631	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	81.57 13銘柄	63.3 13銘柄	248 —	26,832 <7.9%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	7.48	10.89	22	2,121	金属・鉱業
BHP GROUP LTD	11	9.29	41	3,927	金属・鉱業
AMPOL LTD	2.02	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	4.26	—	—	—	専門サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1.23	—	—	—	銀行
RIO TINTO LIMITED	1.43	1.17	12	1,177	金属・鉱業
APA GROUP	9.14	—	—	—	ガス
ARISTOCRAT LEISU	2.36	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	—	1.94	9	852	建設資材
MACQUARIE GROUP LTD	1.13	—	—	—	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	—	7.16	9	890	保険
SONIC HEALTHCARE	3.3	2.64	8	843	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	—	1.8	5	549	金融サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	2.97	—	—	—	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD	4.49	3.69	9	897	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AURIZON HOLDINGS LTD	—	22.02	7	746	陸上運輸
LOTTERY CORP LTD	20.89	17.09	9	855	ホテル・レストラン・レジャー
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	14.57	36	3,458	銀行
MEDIBANK PVT LTD	—	17.43	5	564	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	—	24.6	9	885	金属・鉱業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	71.7 13銘柄	134.29 13銘柄	188 —	17,771 <5.2%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3	—	—	—	資本市場
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	10	10	40	748	電力
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	10	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	15	—	—	—	銀行
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	20	20	22	421	建設関連製品
SITC INTERNATIONAL CO LTD	10	10	16	308	海上運輸
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	100	—	—	—	電力
WH GROUP LTD	70	—	—	—	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	238 8銘柄	40 3銘柄	79 —	1,478 <0.4%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NATIONAL GRID PLC	11.33	—	—	—	総合公益事業
BAE SYSTEMS PLC	11.25	—	—	—	航空宇宙・防衛

銘柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在		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	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5.15	7.84	20	3,695	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	—	25.29	15	2,901	銀行
PEARSON PLC	—	8.33	6	1,279	各種消費者サービス
RIO TINTO PLC	2.2	—	—	—	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	67.08	137.5	9	1,830	無線通信サービス
NATWEST GROUP PLC	—	36.1	8	1,566	銀行
BP PLC	42.41	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	8.17	—	—	—	ソフトウェア
TAYLOR WIMPLEY PLC	57.79	56.42	6	1,212	家庭用耐久財
3I GROUP PLC	—	2.88	5	1,015	資本市場
GSK PLC	23.5	21.72	30	5,557	医薬品
WPP PLC	8.29	—	—	—	メディア
INTERTEK GROUP PLC	—	1.67	7	1,313	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	—	2.1	4	864	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	1.39	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
ABRDN PLC	31.56	30.23	5	1,018	資本市場
GLENCORE PLC	—	40.99	17	3,282	金属・鉱業
COCA-COLA HBC AG	—	1.89	4	811	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	11.76	6	1,171	保険
M&G PLC	25.66	32.79	6	1,177	金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	295.78 13銘柄	417.51 15銘柄	155 —	28,700 <8.5%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
NESTLE SA-REGISTERED	5	—	—	—	食品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	—	0.84	22	3,688	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	2.73	2.46	22	3,708	医薬品
ABB LTD	4.13	3.3	11	1,859	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	2.79	—	—	—	専門サービス
HOLCIM LTD	2.14	1.64	9	1,629	建設資材
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	0.15	14	2,385	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	—	1.4	8	1,397	資本市場
SWISS RE LTD	1.18	2.76	23	3,915	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17.97 6銘柄	12.55 7銘柄	112 —	18,585 <5.5%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	6.24	4.53	65	882	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	3.53	44	599	機械
ERICSSON LM-B SHS	21.94	—	—	—	通信機器
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	—	3.92	50	674	銀行
SKANSKA AB-B SHS	4.79	—	—	—	建設・土木
VOLVO AB-A SHS	3.59	3.45	80	1,078	機械
VOLVO AB-B SHS	9.6	8.32	188	2,537	機械
TELE2 AB-B SHS	8.91	—	—	—	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	2.56	73	995	金融サービス
BOLIDEN AB	2	—	—	—	金属・鉱業
INDUTRADE AB	—	1.26	27	364	機械
EPIROC AB-A	2.4	—	—	—	機械
NORDEA BANK ABP	—	17.23	208	2,807	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	59.47 8銘柄	44.8 8銘柄	737 —	9,939 <2.9%>

銘 柄	2023年2月15日現在		2023 年 8 月 15 日 現 在		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1.84	—	—	—	容器・包装
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1.84 — 銘柄	— — 銘柄	— —	— < — % >
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ING GROEP NV-CVA	—	9.64	12	2,003	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	0.34	—	—	—	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	2.31	—	—	—	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	4.27	3.15	9	1,533	生活必需品流通・小売り
ASML HOLDING NV	0.97	0.7	42	6,726	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	—	13.05	6	1,048	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6.58	4.01	7	1,228	ヘルスケア機器・用品
KONINKLIJKE KPN NV	26.67	20.32	6	1,048	各種電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5.6	4	4	769	飲料
OCI NV	1.89	2.37	5	910	化学
FERRARI NV	0.56	0.36	10	1,646	自動車
JDE PEET'S BV	—	1.92	5	816	食品
NN GROUP NV	2	—	—	—	保険
STELLANTIS NV	11.36	—	—	—	自動車
ABN AMRO BANK NV	5.31	4.11	5	926	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	67.86 12 銘柄	63.63 11 銘柄	117 —	18,659 < 5.5 % >
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KBC GROUPE	1.51	1.16	7	1,201	銀行
SOLVAY SA	—	0.5	5	827	化学
AGEAS	—	1.52	5	904	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1.51 1 銘柄	3.18 3 銘柄	18 —	2,934 < 0.9 % >
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AXA SA	—	4.73	13	2,099	保険
BOUYGUES	2.56	1.89	6	960	建設・土木
BNP PARIBAS	3.38	2.58	15	2,444	銀行
CAPGEMINI SA	—	0.52	8	1,344	情報技術サービス
EIFFAGE	0.8	0.58	5	858	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	—	0.99	7	1,145	メディア
L'OREAL	—	0.52	21	3,430	パーソナルケア用品
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	2.91	1.64	10	1,590	建設関連製品
SOCIETE GENERALE-A	4.18	—	—	—	銀行
VINCI S.A.	1.74	—	—	—	建設・土木
KERING	0.29	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
SANOFI	3.04	2.3	22	3,564	医薬品
BIOMERIEUX	0.53	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
ENGIE	8.24	6.24	9	1,441	総合公益事業
IPSEN SA	0.5	—	—	—	医薬品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1.74	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	29.91 12 銘柄	21.99 10 銘柄	118 —	18,880 < 5.6 % >
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FRESENIUS SE & CO KGAA	—	2.52	7	1,195	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
GEA GROUP AG	1.43	—	—	—	機械

銘 柄	2023年2月15日現在		2023年8月15日現在		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	
DEUTSCHE POST AG-REG	—	2.7	11	1,879	航空貨物・物流サービス
BAYER AG	3.19	3.19	16	2,669	医薬品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	—	1.98	13	2,164	自動車
HEIDELBERG MATERIALS AG	—	0.79	6	954	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	2.42	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.53	0.37	12	2,057	保険
NEMETSCHEK SE	—	0.64	4	646	ソフトウェア
RATIONAL AG	0.09	—	—	—	機械
WACKER-CHEMIE GMBH	—	0.41	5	887	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	27.86	36.66	6	1,047	各種電気通信サービス
TALANX AG	—	0.86	5	813	保険
SCOUT24 SE	—	0.81	4	790	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 >	35.52 6銘柄	50.93 11銘柄	95 —	15,108 <4.5%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA S.A	28.49	20.52	7	1,189	各種電気通信サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2.66	—	—	—	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	24	—	—	—	銀行
INDITEX	9.36	6.14	20	3,271	専門小売り
ENAGAS	4.16	2.96	4	738	ガス
AMADEUS IT GROUP SA	—	1.36	8	1,382	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	68.67 5銘柄	30.98 4銘柄	41 —	6,581 <1.9%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ENI SPA	9.67	7.38	10	1,642	石油・ガス・消耗燃料
RECORDATI SPA	1.31	—	—	—	医薬品
PRYSMIAN SPA	1.84	—	—	—	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	0.3	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	—	0.97	6	986	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	13.12 4銘柄	8.35 2銘柄	16 —	2,628 <0.8%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FORTUM OYJ	4.52	4.42	5	821	電力
NESTE OYJ	2.02	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ORION OYJ	—	1.33	4	741	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6.54 2銘柄	5.75 2銘柄	9 —	1,562 <0.5%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	—	1.44	6	966	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— 1銘柄	1.44 1銘柄	6 —	966 <0.3%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,076.87 183銘柄	1,007.04 201銘柄	— —	269,724 <79.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年8月15日現在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、2023年8月15日現在のマザーファンド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	2023年8月15日現在			
		2023年2月15日現在 □ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		-	0.225	4	635
合 計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	-	0.225	4	635
		-銘柄<-%>	1銘柄<0.2%>	-	-

(注1) 邦貨換算金額は、2023年8月15日現在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、2023年8月15日現在のマザーファンド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	2023年8月15日現在	
			買 建 額	売 建 額
国内	T O P I X		百万円 -	百万円 45
外	S & P 5 0 0 E M I N I F U T		百万円 -	百万円 98
	S & P / T S E 6 0 I X F U T		-	26
	S P I 2 0 0 F U T U R E S		-	17
	FTSE 100 INDEX FUTURE		-	27
国	SWISS MKT IX FUTURE		-	18
	OMXS30 IND FUTURE		-	8
	DJ EURO STOXX 50		-	68

(注) 外貨建の評価額は、2023年8月15日現在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

2023年8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	338,741	98.6
コール・ローン等、その他	4,715	1.4
投資信託財産総額	343,457	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、2023年8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303,099千円、83.3%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、2023年8月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=145.60円、1カナダ・ドル=108.16円、1オーストラリア・ドル=94.47円、1香港・ドル=18.62円、1イギリス・ポンド=184.62円、1スイス・フラン=165.81円、1スウェーデン・クローナ=13.47円、1ユーロ=158.78円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年8月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	343,457,965円
コール・ローン等	1,715,984
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)	338,741,981
未 収 入 金	3,000,000
(B) 負 債	2,006,835
未 払 収 益 分 配 金	405,361
未 払 信 託 報 酬	1,595,412
そ の 他 未 払 費 用	6,062
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	341,451,130
元 本	405,361,098
次 期 繰 越 損 益 金	△63,909,968
(D) 受 益 権 総 口 数	405,361,098口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,423円

(注) 期首における元本額は421,974,877円、当期中における追加設定元本額は19,639,108円、同解約元本額は36,252,887円です。

■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2023年8月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△534円
受 取 利 息	33
支 払 利 息	△567
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,077,727
売 買 損 益	394,087
買 入 損 益	△6,471,814
(C) 信 託 報 酬	△1,601,474
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△7,679,735
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△41,277,438
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△14,547,434
(配 当 等 相 当 額)	(6,062,358)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△20,609,792)
(G) 合 計(D+E+F)	△63,504,607
(H) 収 益 分 配 金	△405,361
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△63,909,968
追 加 信 託 差 損 益 金	△14,547,434
(配 当 等 相 当 額)	(6,122,130)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△20,669,564)
分 配 準 備 積 立 金	28,763,047
繰 越 損 益 金	△78,125,581

(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	5,529,157円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	6,122,130
(d) 分 配 準 備 積 立 金	23,639,251
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	35,290,538
(f) 1万口当たり当期分配対象額	870.60
(g) 分 配 金	405,361
(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7期（決算日 2023年2月15日）

（計算期間 2022年2月16日～2023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7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	期騰落 中率	株式組入 率	株式先物 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産 総額
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
7期(2023年2月15日)	9,237	△0.1	87.8	△76.6	—	359

(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）。

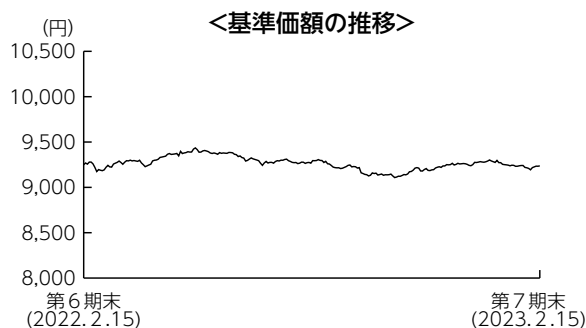
■当期中の基準価額の推移

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) 2022 年 2 月 15 日	9,250	—	81.9	△65.9	0.2
2 月 末	9,196	△0.6	80.9	△65.4	0.2
3 月 末	9,299	0.5	91.1	△73.1	0.2
4 月 末	9,374	1.3	88.5	△69.8	0.2
5 月 末	9,374	1.3	89.0	△70.8	0.2
6 月 末	9,314	0.7	81.9	△68.8	0.1
7 月 末	9,286	0.4	83.3	△70.8	—
8 月 末	9,241	△0.1	83.6	△71.3	—
9 月 末	9,126	△1.3	79.4	△68.3	—
10 月 末	9,138	△1.2	87.4	△75.6	—
11 月 末	9,236	△0.2	87.6	△75.2	—
12 月 末	9,277	0.3	82.0	△70.8	—
2023 年 1 月 末	9,238	△0.1	85.6	△74.6	—
(期 末) 2023 年 2 月 15 日	9,237	△0.1	87.8	△76.6	—

(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（2022年2月16日から2023年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は9,237円となり、前期末比で0.1%下落しました。

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。当該期間を通して、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）銘柄群が市場平均並みで推移した一方、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ため、基準価額に対してマイナスに寄与しました。

投資環境

期初から2022年3月上旬にかけてはロシアによるウクライナ侵攻や原油価格高騰が嫌気され下落しました。その後は一時的に反発する局面もあったものの、9月末にかけて、各国中央銀行による金融政策引き締めへの警戒感等を背景に下落基調が継続しました。10月以降は利上げペース減速期待が高まり、株式市場は上昇に転じました。

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	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	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	ASML HOLDING NV	ユーロ	2.4%
2	NESTLE SA-REGISTERED	スイス・フラン	2.2
3	GSK PLC	イギリス・ポンド	1.6
4	BHP GROUP LTD	オーストラリア・ドル	1.4
5	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	1.4
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.3
7	BANK OF NOVA SCOTIA	カナダ・ドル	1.2
8	BP PLC	イギリス・ポンド	1.1
9	SANOFI	ユーロ	1.1
10	INDITEX	ユーロ	1.1
組入銘柄数		221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)	4円 (1) (3) (0)	0.044% (0.012) (0.032) (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) (投 資 証 券)	5 (5) (0)	0.058 (0.058) (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)	77 (75) (2)	0.833 (0.813) (0.019)	(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	87	0.935	
期中の平均基準価額は9,265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 (2022年2月16日から2023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 19.8 (0.4)	千円 43,813 (-)	千株 21.1	千円 50,619
	ア メ リ カ	百株 94.53 (2.96)	千アメリカ・ドル 686 (-)	百株 105.19	千アメリカ・ドル 746
外 国	カ ナ ダ	百株 80.48 (2.9)	千カナダ・ドル 250 (-)	百株 43.73	千カナダ・ドル 265
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 34.72 (22.5)	千オーストラリア・ドル 112 (-)	百株 70.94	千オーストラリア・ドル 73
	香 港	百株 224 (-)	千香港・ドル 321 (-)	百株 116	千香港・ドル 436
	イ ギ リ ス	百株 453.3 (15.03)	千イギリス・ポンド 145 (-)	百株 389.04	千イギリス・ポンド 157
	ス イ ス	百株 7.56 (0.43)	千スイス・フラン 77 (△0.84245)	百株 5.13	千スイス・フラン 60
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 46.86 (-)	千スウェーデン・クローナ 577 (-)	百株 42.29	千スウェーデン・クローナ 597
	ユ ー ロ 口	百株 1.84 (-)	千ユーロ 6 (-)	百株 0.83	千ユーロ 4

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ プ	オ ラ ン ダ	百株 62.98 (-)	千ユーロ 132 (-)	百株 65.45	千ユーロ 73
		ベ ル ギ ー	百株 7.45 (-)	千ユーロ 20 (-)	百株 8.96	千ユーロ 25
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 2.7 (-)	千ユーロ 5 (-)	百株 2.7	千ユーロ 6
		フ ラ ン ス	百株 26.11 (0.17)	千ユーロ 145 (-)	百株 29.45	千ユーロ 198
		ド イ ツ	百株 12.49 (-)	千ユーロ 50 (△0.57618)	百株 35.91	千ユーロ 137
		ス ベ イ ン	百株 73.87 (35.45)	千ユーロ 37 (-)	百株 93.63	千ユーロ 36
		イ タ リ ア	百株 15.45 (-)	千ユーロ 24 (-)	百株 7.69	千ユーロ 12
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 7.34 (-)	千ユーロ 16 (-)	百株 3.09	千ユーロ 12
		オ ー ス ト リ ア	百株 0.47 (-)	千ユーロ 4 (-)	百株 0.47	千ユーロ 3

(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	3
	(-)	(-)	(-)	(-)
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 150	百万円 152	百万円 -	百万円 39	百万円 △0
外国	株	S&P500 EMINI FUT	-	-	323	322	-	82	△2
		S&P/TSE 60 IX FUT	-	-	99	99	-	24	△0
		SPI 200 FUTURES	-	-	64	64	-	17	△0
		FTSE 100 INDEX FUTURE	-	-	94	95	-	25	△1
国内	式	SWISS MKT IX FUTURE	-	-	62	63	-	16	△0
		OMXS30 IND FUTURE	-	-	96	96	-	8	△0
		DJ EURO STOXX 50	-	-	207	208	-	60	△4

(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	586,977千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	310,252千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.89

(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（2022年2月16日から2023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 先 物 取 引	百万円 1,102	百万円 152	% 13.8	百万円 1,099	百万円 150	% 13.7
金 銭 信 託	0.000	0.000	100.0	0.000	0.000	100.0

(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)	162千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	5千円
(B)/(A)	3.3%

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、みずほ信託銀行です。

■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
食料品 (5.1%)			
ヤクルト本社	—	0.1	915
日本たばこ産業	—	0.6	1,671
化学 (6.9%)			
住友化学	1.8	1.9	887
信越化学工業	—	0.1	1,944
資生堂	—	0.1	618
日東電工	0.1	—	—
医薬品 (5.0%)			
武田薬品工業	—	0.6	2,517
中外製薬	0.2	—	—
石油・石炭製品 (1.3%)			
出光興産	—	0.2	637
ゴム製品 (—%)			
ブリヂストン	0.3	—	—
ガラス・土石製品 (—%)			
日本碍子	0.4	—	—
鉄鋼 (5.5%)			
日本製鉄	0.6	0.6	1,773
J F Eホールディングス	0.6	0.6	968
金属製品 (1.9%)			
SUMCO	—	0.5	961
機械 (—%)			
三菱重工業	0.4	—	—
電気機器 (6.1%)			
ブラザー工業	0.4	—	—
セイコーエプソン	0.4	0.4	733
シスメックス	—	0.1	849
浜松ホトニクス	—	0.1	660
リコー	—	0.8	820
東京エレクトロン	0.1	—	—
輸送用機器 (4.2%)			
いすゞ自動車	0.6	—	—
アイシン	0.2	—	—
マツダ	0.4	1.3	1,443
ヤマハ発動機	0.5	0.2	672
精密機器 (—%)			
島津製作所	0.1	—	—
その他製品 (5.3%)			
大日本印刷	0.3	—	—
任天堂	—	0.5	2,668
電気・ガス業 (3.0%)			
関西電力	—	0.8	978
東京瓦斯	0.6	0.2	542
陸運業 (1.5%)			
S Gホールディングス	0.2	—	—
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	0.1	734
海運業 (4.6%)			
日本郵船	0.2	0.4	1,319
商船三井	—	0.3	1,017

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
空運業 (1.0%)			
日本航空	—	0.2	512
情報・通信業 (6.7%)			
トレンドマイクロ	0.2	0.2	1,264
大塚商会	—	0.2	918
日本電信電話	0.8	—	—
カプコン	—	0.1	438
S C S K	—	0.4	773
卸売業 (11.5%)			
メディアパルホールディングス	0.4	—	—
伊藤忠商事	0.6	—	—
丸紅	1.2	0.9	1,579
三井物産	0.8	—	—
住友商事	0.8	0.6	1,421
三菱商事	0.6	0.6	2,770
小売業 (7.0%)			
ローソン	0.1	—	—
日本マクドナルドホールディングス	0.1	0.2	1,070
ウエルシアホールディングス	0.1	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	—	0.4	2,426
銀行業 (16.4%)			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	2.6	2,550
三井住友トラスト・ホールディングス	—	0.2	983
三井住友フィナンシャルグループ	0.6	0.8	4,728
静岡銀行	0.5	—	—
証券・商品先物取引業 (—%)			
S B Iホールディングス	0.1	—	—
大和証券グループ本社	2.2	—	—
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	0.4	—	—
S O M P Oホールディングス	—	0.2	1,110
東京海上ホールディングス	0.1	—	—
不動産業 (—%)			
飯田グループホールディングス	0.3	—	—
サービス業 (4.8%)			
パーソルホールディングス	0.1	—	—
ベネフィット・ワン	0.1	—	—
博報堂D Yホールディングス	—	0.6	880
電通グループ	0.2	—	—
ユー・エス・エス	0.4	—	—
日本郵政	1.6	1.3	1,545
セコム	0.2	—	—
合 計	株 数	株 数	評 価 額
	20.9	20	50,305
	銘柄数<比率>	44銘柄	38銘柄 <14.0%>

(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	
AMGEN INC	0.4	0.43	10 1,376	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	—	0.99	6 857	建設関連製品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	0.34	0.38	8 1,133	情報技術サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	0.65	—	— —	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	0.26	—	— —	ヘルスケア機器・用品
BEST BUY CO INC	0.46	0.97	8 1,137	専門小売り
YUM! BRANDS INC	0.4	—	— —	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	1.14	2.01	8 1,072	電力
ROBERT HALF INTL INC	0.61	—	— —	専門サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0.65	—	— —	航空貨物・物流サービス
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	0.02	—	— —	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1.52	1.66	11 1,592	医薬品
ONEOK INC	1.26	—	— —	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	0.34	4 593	保険
FEDEX CORP	—	0.38	8 1,073	航空貨物・物流サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	6.17	—	— —	メディア
CARDINAL HEALTH INC	—	0.65	5 679	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CATERPILLAR INC	0.41	—	— —	機械
CITRIX SYSTEMS INC	0.49	—	— —	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	3.29	—	— —	各種電気通信サービス
CERNER CORP	0.28	—	— —	ヘルスケア・テクノロジー
CISCO SYSTEMS INC	2.34	2.97	14 1,881	通信機器
NRG ENERGY, INC.	—	1.39	4 647	電力
COMCAST CORP-CL A	2.65	3.4	13 1,763	メディア
CONSOLIDATED EDISON INC	0.59	—	— —	総合公益事業
SEALED AIR CORP	0.36	—	— —	容器・包装
MOODY'S CORP	0.08	—	— —	資本市場
TARGET CORP	0.37	—	— —	複合小売り
REPUBLIC SERVICES INC	0.37	0.42	5 696	商業サービス・用品
OMNICOM GROUP	0.59	0.62	5 767	メディア
CITIGROUP INC	1.48	1.91	9 1,308	銀行
CADENCE DESIGN SYS INC	0.16	0.16	3 422	ソフトウェア
ELECTRONIC ARTS INC	0.21	—	— —	娯楽
ENTERGY CORP	—	0.46	4 648	電力
EOG RESOURCES INC	0.34	—	— —	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	0.1	—	— —	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	0.19	0.27	3 405	航空貨物・物流サービス
FAIR ISAAC CORP	—	0.05	3 463	ソフトウェア
FASTENAL CO	1.27	1.27	6 889	商社・流通業
FORD MOTOR CO	3.53	—	— —	自動車
GENUINE PARTS CO	0.34	—	— —	販売
GILEAD SCIENCES INC	1.03	1.51	12 1,717	バイオテクノロジー
GARTNER INC	—	0.1	3 454	情報技術サービス
VW GRAINGER INC	0.05	0.05	3 442	商社・流通業
HASBRO INC	0.43	0.8	4 617	レジャー用品
HERSHEY FOODS CORP	0.14	—	— —	食品
HP INC	2.27	2.04	6 823	コンピュータ・周辺機器
JUNIPER NETWORKS INC	—	1.43	4 595	通信機器
HOME DEPOT INC	0.75	0.66	21 2,790	専門小売り
BIAGEN INC	0.11	—	— —	バイオテクノロジー

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	
ILLINOIS TOOL WORKS	—	0.58	13 1,833	機械
INTUIT INC	0.07	—	—	ソフトウェア
INTEL CORP	2.41	—	—	半導体・半導体製造装置
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1.16	—	—	メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	0.25	—	—	情報技術サービス
JOHNSON & JOHNSON	1.34	1.58	25 3,399	医薬品
KEYCORP	3.16	—	—	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	—	0.47	6 802	家庭用品
KROGER CO	0.59	—	—	食品・生活必需品小売り
PACKAGING CORP OF AMERICA	0.32	—	—	容器・包装
BATH & BODY WORKS INC	—	0.64	2 381	専門小売り
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	0.48	0.62	11 1,537	航空貨物・物流サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	—	0.2	9 1,278	航空宇宙・防衛
LOWE'S COS INC	0.18	0.68	14 1,930	専門小売り
S&P GLOBAL INC	0.08	—	—	資本市場
METLIFE INC	0.92	—	—	保険
MEDTRONIC PLC	0.93	—	—	ヘルスケア機器・用品
MERCK & CO.INC.	1.53	—	—	医薬品
MICROSOFT CORP	1.03	—	—	ソフトウェア
3M CO	0.45	—	—	コンプロマリット
NETAPP INC	0.51	—	—	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	1.85	3.4	5 672	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	—	1.24	5 774	金属・鉱業
NORFOLK SOUTHERN CORP	0.23	—	—	陸運・鉄道
NUCOR CORP	0.23	—	—	金属・鉱業
ORACLE CORP	1.12	—	—	ソフトウェア
PAYCHEX INC	—	0.52	5 786	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.05	—	—	ヘルスケア機器・用品
PEPSICO INC	—	0.73	12 1,703	飲料
PFIZER INC	3	3.66	16 2,124	医薬品
ALTRIA GROUP INC	—	1.79	8 1,126	タバコ
BROWN & BROWN INC	0.37	—	—	保険
T ROWE PRICE GROUP INC	—	0.48	5 770	資本市場
PROGRESSIVE CORP	0.61	—	—	保険
QUALCOMM INC	0.68	0.94	12 1,651	半導体・半導体製造装置
US BANCORP	1.26	1.68	8 1,096	銀行
ROLLINS INC	—	0.68	2 321	商業サービス・用品
ACCENTURE PLC-CL A	—	0.47	13 1,777	情報技術サービス
POOL CORP	0.05	—	—	販売
ELEVANCE HEALTH INC	0.08	0.08	3 522	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	0.36	—	—	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	—	—	建設関連製品
SNAP-ON INC	0.2	0.38	9 1,272	機械
TRUIST FINANCIAL CORP	—	1.66	8 1,076	銀行
AT&T INC	4.49	5.84	11 1,485	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1.61	—	—	石油・ガス・消耗燃料
STEEL DYNAMICS INC	—	0.29	3 487	金属・鉱業
GEN DIGITAL INC	1.66	—	—	ソフトウェア
TERADYNE INC	0.16	—	—	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	—	0.72	12 1,685	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	0.43	—	—	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1.07	1.16	11 1,561	航空宇宙・防衛

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	
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.47	0.46	22	3,010	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	—	—	—	バイオテクノロジー
WASTE MANAGEMENT INC	—	0.47	7	944	商業サービス・用品
WATERS CORP	0.07	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
WHIRLPOOL CORP	0.19	—	—	—	家庭用耐久財
WILLIAMS COS INC	1.93	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	0.99	—	—	—	専門小売り
REGIONS FINANCIAL CORP	1.17	1.61	3	509	銀行
CELANESE CORP	0.15	—	—	—	化学
WESTERN UNION CO	—	3.18	4	595	情報技術サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	0.07	0.12	3	509	繊維・アパレル・贅沢品
ULTA BEAUTY INC	—	0.07	3	487	専門小売り
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1.04	1.19	12	1,607	タバコ
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	0.22	—	—	—	航空宇宙・防衛
HCA HEALTHCARE INC	0.12	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NXP SEMICONDUCTOR NV	—	0.46	8	1,159	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	0.5	0.72	6	907	専門サービス
LEAR CORP	—	0.35	4	660	自動車部品
FORTINET INC	—	0.69	4	560	ソフトウェア
TESLA INC	0.14	—	—	—	自動車
PHILLIPS 66	0.69	0.63	6	903	石油・ガス・消耗燃料
ABBVIE INC	1.03	1.16	17	2,350	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	0.22	0.28	16	2,239	半導体・半導体製造装置
ALLEGION PLC	—	0.24	2	381	建設関連製品
CIGNA CORP	0.31	0.59	17	2,345	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	—	1.17	5	668	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	0.99	1.18	7	936	化学
FOX CORP-B	—	1.51	5	664	メディア
FERGUSON PLC	—	0.43	6	841	商社・流通業
CARLYLE GROUP INC	—	1.51	5	708	資本市場
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	0.68	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
F&G ANNUITIES & LIFE INC	—	0.08	0.18392	24	保険
ROYALTY PHARMA PLC	—	1.19	4	600	医薬品
VIATRIS INC	3.31	4.38	5	686	医薬品
FNF GROUP	0.84	—	—	—	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	—	1.31	5	754	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	0.14	—	—	—	電子装置・機器・部品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	2	—	—	—	飲料
KRAFT HEINZ CO	1.32	1.39	5	736	食品
ALPHABET INC-CL A	0.05	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	2.97	3.23	5	709	コンピュータ・周辺機器
ALPHABET INC-CL C	0.05	—	—	—	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>	95.11 107銘柄	87.41 79銘柄	643 —	85,417 <23.8%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2.63	—	—	—	金属・鉱業
BANK OF NOVA SCOTIA	—	5.87	43	4,320	銀行
BCE INC	2.44	4.17	25	2,537	各種電気通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2.9	—	—	—	銀行
CANADIAN TIRE CORP-CL A	—	0.86	14	1,402	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	7.3	3.97	14	1,446	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3.89	3.06	48	4,857	陸運・鉄道

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	—	3.21	12	1,260	繊維・アパレル・贅沢品
KINROSS GOLD CORP	—	20.84	11	1,146	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	—	1.67	14	1,418	商業サービス・用品
GREAT WEST LIFECO INC	4.96	—	—	—	保険
IGM FINANCIAL INC	5.57	6.04	25	2,542	資本市場
QUEBECOR INC-B	5.7	3.93	12	1,248	メディア
LUNDIN MINING CORP	—	13.22	11	1,180	金属・鉱業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	1.26	13	1,346	商社・流通業
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1.33	—	—	—	紙製品・林産品
ARC RESOURCES LTD	—	13.47	21	2,163	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	3.97	—	—	—	化学
WSP GLOBAL INC	1.23	—	—	—	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	41.92 11銘柄	81.57 13銘柄	270 —	26,871 <7.5%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	—	7.48	16	1,537	金属・鉱業
BHP GROUP LTD	8.95	11	52	4,865	金属・鉱業
AMPOL LTD	—	2.02	6	584	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	5.17	4.26	10	970	情報技術サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	—	1.23	13	1,245	銀行
RIO TINTO LIMITED	—	1.43	17	1,610	金属・鉱業
APA GROUP	—	9.14	9	906	ガス
ARISTOCRAT LEISU	—	2.36	8	788	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	4.06	—	—	—	建設資材
MACQUARIE GROUP LTD	—	1.13	21	2,007	資本市場
SONIC HEALTHCARE	2.88	3.3	9	877	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS LTD	20.89	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5.78	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	—	2.97	10	998	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	—	4.49	10	1,014	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AURIZON HOLDINGS LTD	26.42	—	—	—	陸運・鉄道
IDP EDUCATION LTD	3.71	—	—	—	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	—	20.89	10	966	ホテル・レストラン・レジャー
COLES GROUP LTD	7.56	—	—	—	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	85.42 9銘柄	71.7 13銘柄	198 —	18,373 <5.1%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	25	—	—	—	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	—	3	101	1,711	資本市場
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	35	10	43	738	電力
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	30	10	53	906	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	—	15	39	672	銀行
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	20	31	539	建設関連製品
SITC INTERNATIONAL CO LTD	40	10	17	290	海運業
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	—	100	52	879	電力
WH GROUP LTD	—	70	32	557	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	130 4銘柄	238 8銘柄	372 —	6,297 <1.8%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
DIAGEO PLC	3.96	—	—	—	飲料
NATIONAL GRID PLC	—	11.33	11	1,932	総合公益事業
BAE SYSTEMS PLC	—	11.25	9	1,574	航空宇宙・防衛

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	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	—	5.15	16	2,591	タバコ
RIO TINTO PLC	—	2.2	13	2,141	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	—	67.08	6	1,054	無線通信サービス
RELX PLC	8.86	—	—	—	専門サービス
SSE PLC	7.97	—	—	—	電力
BP PLC	80.12	42.41	23	3,842	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	13.12	8.17	6	1,005	ソフトウェア
TAYLOR WIMPLEY PLC	—	57.79	6	1,115	家庭用耐久財
TESCO PLC	22.69	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GSK PLC	18.79	23.5	34	5,587	医薬品
WPP PLC	—	8.29	8	1,320	メディア
INTERCONTINENTAL HOTELS	—	1.39	7	1,251	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	35.49	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ABRDN PLC	—	31.56	6	1,092	資本市場
EXPERIAN PLC	2.24	—	—	—	専門サービス
COCA-COLA HBC AG	1.68	—	—	—	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	14.77	—	—	—	保険
FERGUSON PLC	0.57	—	—	—	商社・流通業
M&G PLC	—	25.66	5	831	各種金融サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	6.23	—	—	—	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>	216.49 13銘柄	295.78 13銘柄	156 —	25,342 <7.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
NESTLE SA-REGISTERED	4.28	5	55	8,016	食品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.22	—	—	—	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	—	2.73	21	3,162	医薬品
ABB LTD	4.31	4.13	12	1,850	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	2.22	2.79	9	1,389	専門サービス
GEBERIT AG	0.04	—	—	—	建設関連製品
ROCHE HOLDING AG-BEARER	0.07	—	—	—	医薬品
HOLCIM LTD	2.56	2.14	11	1,719	建設資材
STRAUMANN HOLDING AG	0.02	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SWISS RE LTD	1.32	1.18	11	1,618	保険
VAT GROUP AG	0.07	—	—	—	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15.11 10銘柄	17.97 6銘柄	123 —	17,758 <4.9%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	—	6.24	78	1,009	機械
ERICSSON LM-B SHS	19.11	21.94	131	1,687	通信機器
SKANSKA AB-B SHS	—	4.79	91	1,178	建設・土木
VOLVO AB-A SHS	3.78	3.59	77	988	機械
VOLVO AB-B SHS	9.42	9.6	197	2,529	機械
TELE2 AB-B SHS	6.87	8.91	83	1,068	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	2.67	—	—	—	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	2.87	—	—	—	各種金融サービス
BOLIDEN AB	—	2	87	1,127	金属・鉱業
HUSQVARNA AB-B SHS	3.15	—	—	—	機械
EPIROC AB-A	3.09	2.4	49	630	機械
EPIROC AB-B	2.58	—	—	—	機械
EQT AB	1.36	—	—	—	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	54.9 10銘柄	59.47 8銘柄	796 —	10,220 <2.8%>

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…アイルランド) KINGSPAN GROUP PLC SMURFIT KAPPA GROUP PLC	百株 0.83 -	百株 - 1.84	千ユーロ - 6	千円 - 964	建設関連製品 容器・包装
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	0.83 1銘柄	1.84 1銘柄	6 -	964 <0.3%>
(ユーロ…オランダ) ING GROEP NV-CVA ASM INTERNATIONAL NV RANDSTAD NV KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV ASML HOLDING NV KONINKLIJKE PHILIPS NV KONINKLIJKE KPN NV DAVIDE CAMPARI-MILANO NV OCI NV FERRARI NV NN GROUP NV STELLANTIS NV ABN AMRO BANK NV	百株 16.92 0.33 2.69 5.23 - - 35.44 - - 0.48 2.29 - 6.95	百株 - 0.34 2.31 4.27 0.97 6.58 26.67 5.6 1.89 0.56 2 11.36 5.31	千ユーロ - 11 13 11 60 10 8 5 5 13 7 17 8	千円 - 1,573 1,949 1,673 8,592 1,486 1,199 820 787 1,962 1,139 2,523 1,223	銀行 半導体・半導体製造装置 専門サービス 食品・生活必需品小売り 半導体・半導体製造装置 ヘルスケア機器・用品 各種電気通信サービス 飲料 化学 自動車 保険 自動車 銀行
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	70.33 8銘柄	67.86 12銘柄	174 -	24,931 <6.9%>
(ユーロ…ベルギー) KBC GROUPE SOLVAY SA AGEAS	百株 - 0.92 2.1	百株 1.51 - -	千ユーロ 10 - -	千円 1,523 - -	銀行 化学 保険
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	3.02 2銘柄	1.51 1銘柄	10 -	1,523 <0.4%>
(ユーロ…フランス) BOUYGUES BNP PARIBAS EIFFAGE L'OREAL REMY COINTREAU COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN SEB SA SOCIETE GENERALE-A VINCI S.A. HERMES INTL KERING CARREFOUR SA SANOFI ESSILORLUXOTTICA WENDEL BIOMERIEUX ENGIE IPSEN SA LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	百株 - 4.39 1.06 0.65 0.28 - 0.59 - - 0.1 - 6.26 3.94 1.2 0.78 0.49 10.51 0.66 2.17	百株 2.56 3.38 0.8 - - 2.91 - 4.18 1.74 - 0.29 - 3.04 - - 0.53 8.24 0.5 1.74	千ユーロ 7 21 8 - - 15 - 11 18 - 16 26 - - 5 10 5 6	千円 1,126 3,103 1,174 - - 2,190 - 1,580 2,670 - 2,321 3,820 - - 730 1,555 751 954	建設・土木 銀行 建設・土木 パーソナル用品 飲料 建設関連製品 家庭用耐久財 銀行 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品 繊維・アパレル・贅沢品 食品・生活必需品小売り 医薬品 ヘルスケア機器・用品 各種金融サービス ヘルスケア機器・用品 総合公益事業 医薬品 ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	33.08 14銘柄	29.91 12銘柄	154 -	21,980 <6.1%>
(ユーロ…ドイツ) BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG FRESENIUS SE & CO KGAA GEA GROUP AG	百株 3.49 3.22 -	百株 - - 1.43	千ユーロ - - 5	千円 - - 840	自動車 ヘルスケア・アロバイダー/ヘルスケア・サービス 機械

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	7.06	—	—	—	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	1.28	—	—	—	自動車
SAP SE	3.42	—	—	—	ソフトウェア
BAYER AG	4.23	3.19	19	2,750	医薬品
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	—	2.42	9	1,289	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	—	0.53	17	2,455	保険
RATIONAL AG	—	0.09	5	791	機械
BECHTLE AG	0.97	—	—	—	情報技術サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	32.01	27.86	7	1,101	各種電気通信サービス
COVESTRO AG	3.26	—	—	—	化学
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	58.94 9銘柄	35.52 6銘柄	64 —	9,229 <2.6%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA S.A	32.79	28.49	10	1,487	各種電気通信サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	—	2.66	7	1,038	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	—	24	16	2,353	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	6.29	—	—	—	電力
INDITEX	9.59	9.36	26	3,776	専門小売り
ENAGAS	4.31	4.16	7	1,000	ガス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	52.98 4銘柄	68.67 5銘柄	67 —	9,656 <2.7%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	4.99	—	—	—	保険
ENI SPA	—	9.67	14	2,044	石油・ガス・消耗燃料
RECORDATI SPA	—	1.31	5	766	医薬品
PRYSMIAN SPA	—	1.84	6	972	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	0.37	0.3	3	505	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5.36 2銘柄	13.12 4銘柄	30 —	4,289 <1.2%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FORTUM OYJ	—	4.52	6	931	電力
NESTE OYJ	—	2.02	9	1,333	石油・ガス・消耗燃料
ORION OYJ	2.29	—	—	—	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2.29 1銘柄	6.54 2銘柄	15 —	2,265 <0.6%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	865.78 205銘柄	1,076.87 183銘柄	— —	265,122 <73.8%>

(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	期 首(前期末)	当 期 末		
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		0.523	-	-	-
AGNC INVESTMENT CORP		0.267	-	-	-
合 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	0.79	-	-	-
		2銘柄<0.2%>	-銘柄<-%>	-	-

(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 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	T O P I X		百万円	百万円
			-	39
外	S & P 5 0 0 E M I N I F U T		百万円	百万円
			-	82
		S & P / T S E 6 0 I X F U T	-	24
		S P I 2 0 0 F U T U R E S	-	17
		FTSE 100 INDEX FUTURE	-	25
国	S W I S S M K T I X F U T U R E		-	16
		O M X S 3 0 I N D F U T U R E	-	8
		D J E U R O S T O X X 5 0	-	60

(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

2023年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 315,427	% 85.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	54,964	14.8
投 資 信 託 財 産 総 額	370,392	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、292,921千円、79.1%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、2023年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=132.79円、1カナダ・ドル=99.52円、1オーストラリア・ドル=92.69円、1香港・ドル=16.92円、1イギリス・ポンド=161.76円、1スイス・フラン=144.06円、1スウェーデン・クローナ=12.83円、1ユーロ=142.62円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	674,948,342円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,951,054
株 式(評価額)	315,427,779
未 収 入 金	307,782,180
未 収 配 当 金	415,065
差 入 委 託 証 拠 金	38,372,264
(B) 負 債	315,662,499
未 払 金	315,662,499
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	359,285,843
元 本	388,958,360
次 期 繰 越 損 益 金	△29,672,517
(D) 受 益 権 総 口 数	388,958,360口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,237円

(注1) 期首元本額 412,865,194円
追加設定元本額 0円
一部解約元本額 23,906,834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)
388,958,360円
期末元本合計 388,958,360円

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	11,774,194円
受 取 配 当 金	11,521,868
受 取 利 息	35,337
そ の 他 収 益 金	220,863
支 払 利 息	△3,874
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,649,967
売 買 益	93,949,295
売 買 損	△100,599,262
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,691,652
取 引 益	31,513,466
取 引 損	△34,205,118
(D) そ の 他 費 用	△3,041,601
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△609,026
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△30,970,325
(G) 解 約 差 損 益 金	1,906,834
(H) 合 計(E+F+G)	△29,672,517
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△29,672,517

(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。