

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 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 | 8,640 | 0.2 | 86.2 | △74.8 | — |
| 3月末 | 8,548 | △0.9 | 86.4 | △75.8 | — |
| 4月末 | 8,480 | △1.7 | 89.6 | △80.1 | — |
| 5月末 | 8,355 | △3.2 | 92.0 | △83.7 | — |
| 6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 |

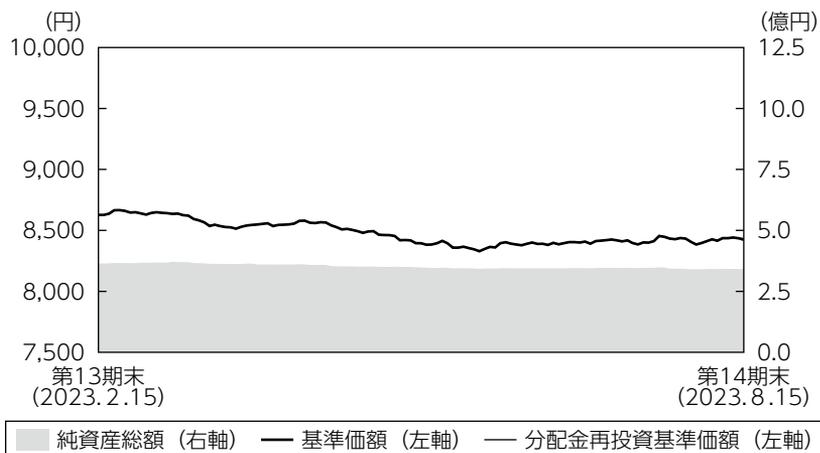
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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： Δ 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。

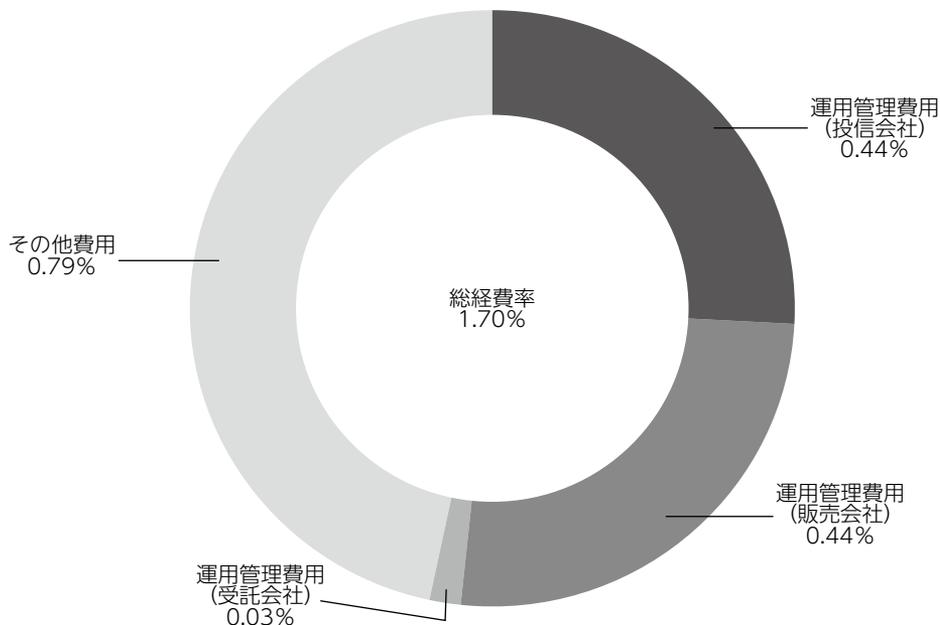
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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 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 | | 千株 | 千株 | 千円 |
| | 株数・金額 | 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 ・ 金 額 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 | | 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 | | | | |
| 3期(2019年2月15日) | 円 9,780 | % △0.6 | % 81.5 | % △69.7 | % - | 百万円 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）。

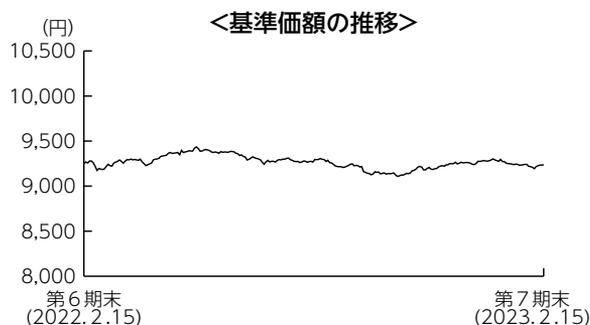
■当期中の基準価額の推移

| 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 |
| 国 | 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 |
| 国 | 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 | ア イ ル ラ ン ド | 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 |
| VWV 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 | | 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 | 期末 | | |
| | | | 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。