

## 運用報告書 (全体版)

第15期<決算日2024年2月15日>

### 世界株配当収益追求ファンド (価格変動抑制型)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/株式/特殊型 (絶対収益追求型)
信託期間	2016年10月24日から2027年8月16日までです。
運用方針	安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	世界株配当収益追求ファンド (価格変動抑制型)
	グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型) マザーファンド
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：はいとうドリ

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、2024年2月15日に第15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
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
15期 (2024年2月15日)	8,395	10	△0.2	94.0	△89.2	—	312

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

### ■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰落率			
(期首)	円	%	%	%	%
2023年8月15日	8,423	—	92.4	△91.3	0.2
8月末	8,376	△0.6	94.0	△93.2	0.2
9月末	8,491	0.8	84.2	△82.5	0.2
10月末	8,468	0.5	82.3	△80.5	0.2
11月末	8,385	△0.5	89.3	△88.1	0.2
12月末	8,405	△0.2	86.3	△82.3	—
2024年1月末	8,429	0.1	91.2	△86.4	—
(期末)					
2024年2月15日	8,405	△0.2	94.0	△89.2	—

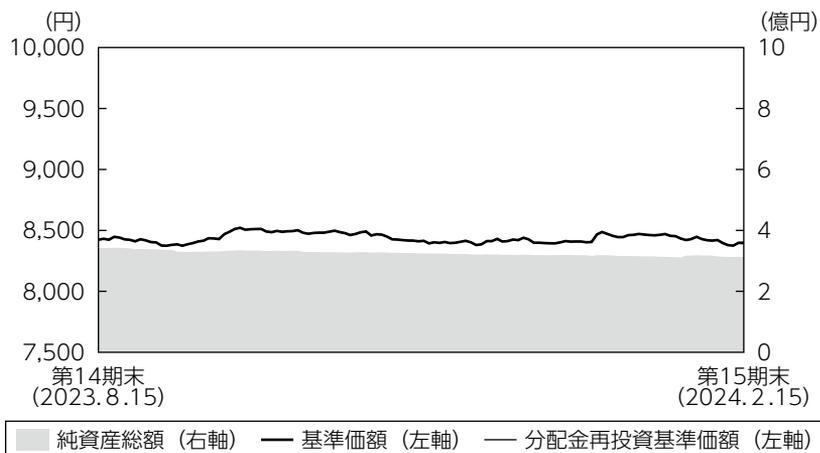
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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8月16日から2024年2月15日まで）

### 基準価額等の推移



第15期首： 8,423円  
第15期末： 8,395円  
(既払分配金10円)  
騰落率：  $\Delta 0.2\%$   
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は下落しました。当該期間を通して、当ファンドが重点的に保有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）銘柄群が市場平均を下回り、この点が基準価額にマイナスに寄与しました。

## 投資環境

期初から2023年10月にかけてはイスラエル情勢の緊迫化や長期金利上昇への警戒感から株式市場は下落しましたが、11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから米国など多くの株式市場は上昇しました。その後は早期利下げ観測は後退したものの、大型ハイテク株などに牽引されて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	2.0%
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	

#### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	2.7%
2	NVIDIA CORP	アメリカ・ドル	2.6
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	2.4
4	MANULIFE FINANCIAL CORP	カナダ・ドル	1.9
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.8
6	BROADCOM INC	アメリカ・ドル	1.7
7	META PLATFORMS INC	アメリカ・ドル	1.5
8	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	1.3
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	1.3
10	BHP GROUP LTD	オーストラリア・ドル	1.3
組入銘柄数		230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8月16日 ～2024年2月15日
当期分配金（税引前）	10円
対基準価額比率	0.12%
当期の収益	10円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	913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15期		項目の概要
	(2023年8月16日 ～2024年2月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	39円	0.459%	(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8,436円です。
(投信会社)	(19)	(0.221)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(19)	(0.221)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 1)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.026	(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)	( 1)	(0.007)	
(先物・オプション)	( 2)	(0.018)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.014	(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)	( 1)	(0.014)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	42	0.503	(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)	(42)	(0.499)	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	84	1.001	

(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。

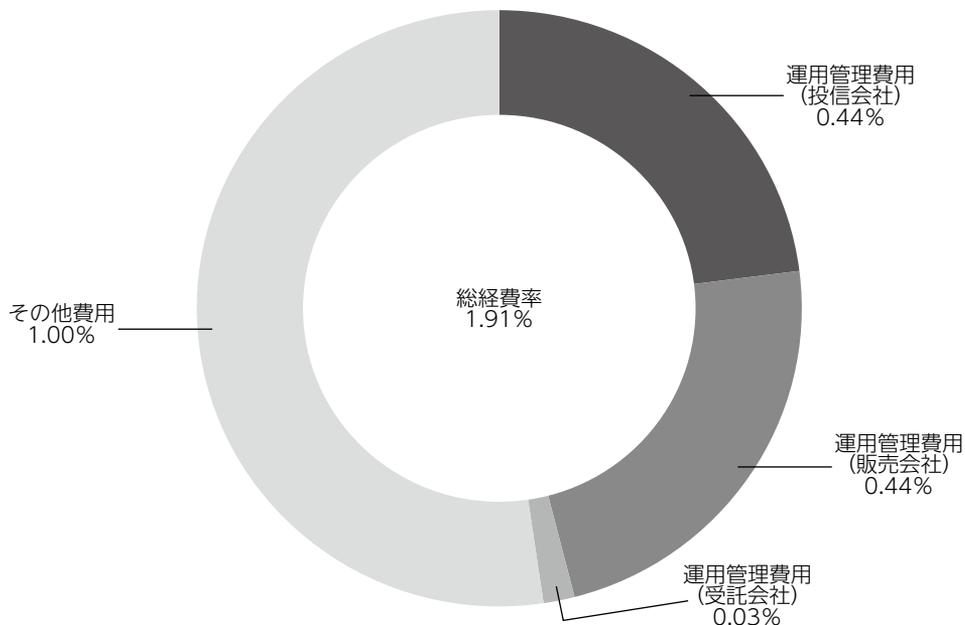
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.91%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8月16日から2024年2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□ 32,996	千円 30,000

## ■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	284,351千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	285,956千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.99

(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8月16日から2024年2月15日まで）

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

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	83千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B)／(A)	3.2%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

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

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式 先 物 取 引	百万円 656	百万円 94	% 14.3	百万円 598	百万円 93	% 15.7

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 373,557	千口 340,561		千円 309,536

## ■投資信託財産の構成

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
グローバル株式スマートインカムプラス戦略 (リスク抑制型) マザーファンド	309,536	98.2
コール・ローン等、その他	5,618	1.8
投資信託財産総額	315,154	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、2024年2月15日現在、グローバル株式スマートインカムプラス戦略(リスク抑制型) マザーファンドは261,710千円、77.3%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、2024年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.49円、1カナダ・ドル=111.14円、1オーストラリア・ドル=97.61円、1香港・ドル=19.25円、1イギリス・ポンド=189.17円、1スイス・フラン=169.93円、1スウェーデン・クローナ=14.32円、1ユーロ=161.52円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	315,154,635円
コール・ローン等	5,618,524
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)	309,536,111
(B) 負 債	3,022,685
未払収益分配金	371,822
未払解約金	1,153,493
未払信託報酬	1,491,709
その他未払費用	5,661
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	312,131,950
元 本	371,822,474
次 期 繰 越 損 益 金	△59,690,524
(D) 受 益 権 総 口 数	371,822,474口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,395円

(注) 期首における元本額は405,361,098円、当期中における追加設定元本額は13,883,538円、同解約元本額は47,422,162円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年8月16日 至2024年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△281円
受 取 利 息	20
支 払 利 息	△301
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	783,532
売 買 損 益	867,386
買 入 損 益	△83,854
(C) 信 託 報 酬	△1,497,370
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△714,119
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△43,653,444
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△14,951,139
(配 当 等 相 当 額)	(6,562,445)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△21,513,584)
(G) 合 計(D+E+F)	△59,318,702
(H) 次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△371,822
追 加 信 託 差 損 益 金	△59,690,524
(配 当 等 相 当 額)	△14,951,139
(売 買 損 益 相 当 額)	(6,577,816)
分 配 準 備 積 立 金	(△21,528,955)
繰 越 損 益 金	27,379,935
繰 越 損 益 金	△72,119,320

(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	2,315,338円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	6,577,816
(d) 分配準備積立金	25,436,419
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	34,329,573
(f) 1万口当たり当期分配対象額	923.28
(g) 分配金	371,822
(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8期（決算日 2024年2月15日）

（計算期間 2023年2月16日～2024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8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				
4期(2020年2月17日)	円 9,421	% △3.7	% 82.0	% △74.2	% -	百万円 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
8期(2024年2月15日)	9,089	△1.6	94.8	△90.0	-	309

(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）。

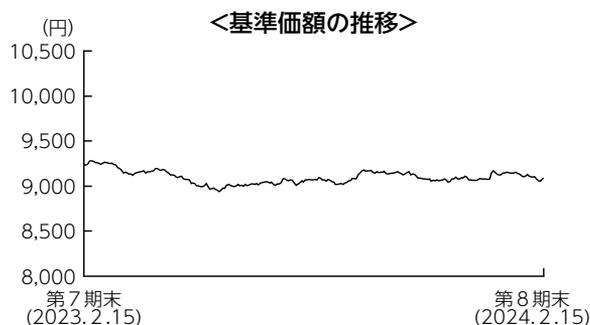
## ■当期中の基準価額の推移

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) 2023 年 2 月 15 日	9,237	—	87.8	△76.6	—
2 月 末	9,254	0.2	88.1	△76.4	—
3 月 末	9,160	△0.8	87.3	△76.6	—
4 月 末	9,094	△1.5	90.0	△80.5	—
5 月 末	8,967	△2.9	92.0	△83.6	—
6 月 末	9,030	△2.2	91.0	△89.6	0.2
7 月 末	9,035	△2.2	93.5	△91.8	0.2
8 月 末	9,020	△2.3	94.4	△93.5	0.2
9 月 末	9,151	△0.9	84.3	△82.6	0.2
10 月 末	9,134	△1.1	82.9	△81.0	0.2
11 月 末	9,051	△2.0	89.4	△88.2	0.2
12 月 末	9,079	△1.7	87.5	△83.4	—
2024 年 1 月 末	9,112	△1.4	93.3	△88.4	—
(期 末) 2024 年 2 月 15 日	9,089	△1.6	94.8	△90.0	—

(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（2023年2月16日から2024年2月15日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は9,089円となり、前期末比で1.6%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、当ファンドが重点的に保有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）銘柄群が市場平均を下回り、この点が基準価額にマイナスに寄与しました。

## 投資環境

先進国株式は多くの市場が上昇しました。期前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となりました。2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や長期金利上昇への警戒感から下落しましたが、11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから米国など多くの株式市場は上昇しました。その後は早期利下げ観測は後退したものの、大型ハイテック株などに牽引されて株式市場は上昇しました。

## ポートフォリオについて

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

### 【運用状況】

#### ○組入上位10銘柄（現物）

##### 期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	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	CANADIAN NATL RAILWAY CO	カナダ・ドル	2.7%
2	NVIDIA CORP	アメリカ・ドル	2.6
3	MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	2.4
4	MANULIFE FINANCIAL CORP	カナダ・ドル	1.9
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.8
6	BROADCOM INC	アメリカ・ドル	1.7
7	META PLATFORMS INC	アメリカ・ドル	1.5
8	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	1.3
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	1.3
10	BHP GROUP LTD	オーストラリア・ドル	1.3
組入銘柄数		230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)	7円 (3) (3) (0)	0.072% (0.036) (0.036) (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)	4 (4) (0)	0.043 (0.043) (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)	81 (81) (0)	0.894 (0.890) (0.004)	(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	92	1.009	
期中の平均基準価額は9,098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 (2023年2月16日から2024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 16.6 (10.3)	千円 43,768 (-)	千株 27.4	千円 55,696
	ア メ リ カ	百株 98.39 (0.08)	千アメリカ・ドル 621 (-)	百株 81.9	千アメリカ・ドル 566
外 国	カ ナ ダ	百株 79.2 (-)	千カナダ・ドル 288 (-)	百株 88.55	千カナダ・ドル 313
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 121.44 (-)	千オーストラリア・ドル 146 (-)	百株 108.24	千オーストラリア・ドル 155
	香 港	百株 (-)	千香港・ドル (-)	百株 208	千香港・ドル 270
	イ ギ リ ス	百株 227.67 (-)	千イギリス・ポンド 124 (△0.98557)	百株 332.55	千イギリス・ポンド 179
国	ス イ ス	百株 11.88 (0.49)	千スイス・フラン 95 (△0.71635)	百株 16.11	千スイス・フラン 107
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 41.48 (2)	千スウェーデン・クローナ 537 (-)	百株 77.04	千スウェーデン・クローナ 993
	ユ ー ロ ア イ ル ラ ン ド	百株 0.51 (-)	千ユーロ 1 (-)	百株 1.84	千ユーロ 6

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ ョ ッ プ	オ ラ ン ダ	百株 14.12 (0.29)	千ユーロ 29 (-)	百株 53.49	千ユーロ 164
		ベ ル ギ ー	百株 2.02 (0.3)	千ユーロ 11 (-)	百株 3.05	千ユーロ 17
		フ ラ ン ス	百株 12.71 (-)	千ユーロ 60 (△0.27324)	百株 30.43	千ユーロ 173
		ド イ ツ	百株 25.36 (-)	千ユーロ 86 (△0.56018)	百株 51.28	千ユーロ 98
		ス ペ イ ン	百株 7.49 (0.84)	千ユーロ 18 (-)	百株 54.71	千ユーロ 69
		イ タ リ ア	百株 29.55 (-)	千ユーロ 17 (-)	百株 14.09	千ユーロ 35
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 3.2 (-)	千ユーロ 9 (-)	百株 7.87	千ユーロ 19
		オ ー ス ト リ ア	百株 2 (-)	千ユーロ 7 (-)	百株 1.44	千ユーロ 5
		バ ミ ュ ー ダ	百株 13.05 (-)	千ユーロ 5 (-)	百株 6.63	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	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	0.225 (-)	4 (-)	0.225 (-)	4 (-)

(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 178	百万円 179	百万円 -	百万円 51	百万円 △4
外国	株	S&P500 EMINI FUT	-	-	374	370	-	113	△7
		S&P/TSE 60 IX FUT	-	-	103	102	-	28	△0
		SPI 200 FUTURES	-	-	68	68	-	18	△0
		FTSE 100 INDEX FUTURE	-	-	108	122	-	14	0
国内	式	SWISS MKT IX FUTURE	-	-	70	70	-	18	△0
		OMXS30 IND FUTURE	-	-	105	112	-	3	△0
		DJ EURO STOXX 50	-	-	199	240	-	30	△0

(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	611,095千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	300,730千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.03

(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2024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 1,267	百万円 179	% 14.2	百万円 1,209	百万円 178	% 14.8

### (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)	242千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	5千円
(B)/(A)	2.2%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>建設業 (1.8%)</b>			
大林組	—	0.7	959
<b>食料品 (3.7%)</b>			
ヤクルト本社	0.1	—	—
キリンホールディングス	—	0.5	1,052
キッコーマン	—	0.1	940
日本たばこ産業	0.6	—	—
<b>化学 (4.8%)</b>			
住友化学	1.9	—	—
信越化学工業	0.1	—	—
積水化学工業	—	0.7	1,461
花王	—	0.2	1,092
資生堂	0.1	—	—
<b>医薬品 (2.1%)</b>			
武田薬品工業	0.6	—	—
中外製薬	—	0.2	1,141
<b>石油・石炭製品 (—%)</b>			
出光興産	0.2	—	—
<b>鉄鋼 (4.2%)</b>			
日本製鉄	0.6	0.4	1,371
J F Eホールディングス	0.6	0.4	899
<b>金属製品 (1.8%)</b>			
SUMCO	0.5	0.4	945
<b>機械 (4.8%)</b>			
小松製作所	—	0.4	1,715
日立建機	—	0.2	833
<b>電気機器 (7.0%)</b>			
セイコーエプソン	0.4	0.4	964
横河電機	—	0.2	625
アズビル	—	0.1	468
シスメックス	0.1	0.1	819
浜松ホトニクス	0.1	—	—
リコー	0.8	0.7	882
<b>輸送用機器 (7.0%)</b>			
マツダ	1.3	0.4	686
本田技研工業	—	1.4	2,410
スズキ	—	0.1	660
ヤマハ発動機	0.2	—	—
<b>その他製品 (—%)</b>			
任天堂	0.5	—	—
<b>電気・ガス業 (1.7%)</b>			
中部電力	—	0.5	911
関西電力	0.8	—	—
東京瓦斯	0.2	—	—
<b>陸運業 (—%)</b>			
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>海運業 (9.8%)</b>			
日本郵船	0.4	0.3	1,432
商船三井	0.3	0.6	3,129
川崎汽船	—	0.1	691
<b>空運業 (—%)</b>			
日本航空	0.2	—	—
<b>情報・通信業 (5.1%)</b>			
トレンドマイクロ	0.2	—	—
大塚商会	0.2	0.1	601
ソフトバンク	—	1.1	2,140
カプコン	0.1	—	—
S C S K	0.4	—	—
<b>卸売業 (10.4%)</b>			
丸紅	0.9	0.6	1,429
三井物産	—	0.4	2,420
住友商事	0.6	0.5	1,727
三菱商事	0.6	—	—
<b>小売業 (2.7%)</b>			
日本マクドナルドホールディングス	0.2	—	—
マツキヨココカラ&カンパニー	—	0.3	771
ZOZO	—	0.2	685
セブン&アイ・ホールディングス	0.4	—	—
<b>銀行業 (22.5%)</b>			
ゆうちょ銀行	—	1.3	1,935
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.6	2.1	2,948
三井住友トラスト・ホールディングス	0.2	0.6	1,723
三井住友フィナンシャルグループ	0.8	0.7	5,439
<b>証券、商品先物取引業 (3.5%)</b>			
SBIホールディングス	—	0.3	1,163
大和証券グループ本社	—	0.7	724
<b>保険業 (3.3%)</b>			
SOMPOホールディングス	0.2	—	—
東京海上ホールディングス	—	0.4	1,746
<b>不動産業 (2.3%)</b>			
ヒューリック	—	0.8	1,228
<b>サービス業 (1.5%)</b>			
博報堂D.Y.ホールディングス	0.6	—	—
ユー・エス・エス	—	0.3	786
日本郵政	1.3	—	—
合 計	株 数・金 額	株 数	金 額
	20	19.5	53,564
	銘柄数<比率>	38銘柄	39銘柄 <17.3%>

(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		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	0.49	14	2,138	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	0.99	—	—	—	建設関連製品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	0.38	—	—	—	専門サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	—	1.54	8	1,262	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	—	1.78	7	1,061	ヘルスケア機器・用品
VERIZON COMM INC	—	5.63	22	3,401	各種電気通信サービス
BEST BUY CO INC	0.97	—	—	—	専門小売り
YUM! BRANDS INC	—	0.6	8	1,210	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	2.01	—	—	—	電力
ROBERT HALF INC	—	0.73	5	885	専門サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	—	0.75	5	833	航空貨物・物流サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1.66	2.26	11	1,662	医薬品
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	0.34	—	—	—	保険
FEDEX CORP	0.38	—	—	—	航空貨物・物流サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	—	11.25	5	814	メディア
CARDINAL HEALTH INC	0.65	0.71	7	1,106	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	—	—	—	通信機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	—	0.54	4	680	家庭用品
NRG ENERGY, INC.	1.39	—	—	—	電力
COMCAST CORP-CL A	3.4	3.48	14	2,200	メディア
CONSOLIDATED EDISON INC	—	0.38	3	496	総合公益事業
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	0.14	3	524	ソフトウェア
REPUBLIC SERVICES INC	0.42	—	—	—	商業サービス・用品
DECKERS OUTDOOR CORP	—	0.04	3	510	繊維・アパレル・贅沢品
OMNICOM GROUP	0.62	—	—	—	メディア
EBAY INC	—	1.68	7	1,066	大規模小売り
CITIGROUP INC	1.91	—	—	—	銀行
CADENCE DESIGN SYS INC	0.16	—	—	—	ソフトウェア
ELECTRONIC ARTS INC	—	0.26	3	559	娯楽
ERIE INDEMNITY CO	—	0.09	3	476	保険
ENERGY CORP	0.46	—	—	—	電力
EOG RESOURCES INC	—	1.16	12	1,937	石油・ガス・消耗燃料
EXPEDITORS INTERNATIONAL	0.27	—	—	—	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	1.21	8	1,277	商社・流通業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	0.02	2	449	銀行
GILEAD SCIENCES INC	1.51	1.39	10	1,527	バイオテクノロジー
GARTNER INC	0.1	0.08	3	541	情報技術サービス
NVIDIA CORP	—	0.71	52	7,896	半導体・半導体製造装置
VW GRAINGER INC	0.05	—	—	—	商社・流通業
MONSTER BEVERAGE CORP	—	0.68	3	571	飲料
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	0.38	7	1,201	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	0.8	—	—	—	レジャー用品
HP INC	2.04	2.37	6	1,019	コンピュータ・周辺機器
JUNIPER NETWORKS INC	1.43	2.16	7	1,203	通信機器
HOME DEPOT INC	0.66	—	—	—	専門小売り
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	0.07	3	470	建設関連製品
ILLINOIS TOOL WORKS	0.58	—	—	—	機械
INTEL CORP	—	3.52	15	2,340	半導体・半導体製造装置
INTERNATIONAL PAPER CO	—	1.73	5	898	容器・包装

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	
INCYTE CORP	-	0.46	2	400	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	1.58	1.77	27	4,148	医薬品
KLA CORPORATION	-	0.08	5	787	半導体・半導体製造装置
KIMBERLY-CLARK CORP	0.47	0.5	5	890	家庭用品
PACKAGING CORP OF AMERICA	-	0.18	2	448	容器・包装
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	0.25	10	1,573	航空宇宙・防衛
LOWE'S COS INC	0.68	-	-	-	専門小売り
MARSH & MCLENNAN COS	-	0.27	5	803	保険
MASCO CORP	-	0.43	3	475	建設関連製品
MICROSOFT CORP	-	1.23	50	7,579	ソフトウェア
3M CO	-	0.84	7	1,168	コンプロマリット
NETAPP INC	-	0.34	2	449	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	-	-	-	金属・鉱業
NORFOLK SOUTHERN CORP	-	0.37	9	1,404	陸上運輸
NUCOR CORP	-	0.21	3	572	金属・鉱業
OLD DOMINION FREIGHT LINE	-	0.09	3	583	陸上運輸
PAYCHEX INC	0.52	0.63	7	1,158	専門サービス
PEPSICO INC	0.73	-	-	-	飲料
PFIZER INC	3.66	5.1	13	2,080	医薬品
ALTRIA GROUP INC	1.79	-	-	-	タバコ
BROWN & BROWN INC	-	0.44	3	544	保険
T ROWE PRICE GROUP INC	0.48	0.97	10	1,552	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	-	0.49	6	941	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUALCOMM INC	0.94	-	-	-	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	-	0.06	5	855	バイオテクノロジー
US BANCORP	1.68	-	-	-	銀行
ROLLINS INC	0.68	0.69	3	459	商業サービス・用品
RPM INTERNATIONAL INC	-	0.26	2	423	化学
ACCENTURE PLC-CL A	0.47	-	-	-	情報技術サービス
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	-	1.3	8	1,225	金融サービス
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	-	0.15	4	702	化学
SNAP-ON INC	0.38	-	-	-	機械
TRUIST FINANCIAL CORP	1.66	2.31	8	1,230	銀行
AT&T INC	5.84	7.32	12	1,862	各種電気通信サービス
STARBUCKS CORP	-	1.21	11	1,712	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	0.29	-	-	-	金属・鉱業
TEXAS INSTRUMENTS INC	0.72	-	-	-	半導体・半導体製造装置
UNION PACIFIC CORP	-	0.56	14	2,107	陸上運輸
RTX CORP	1.16	1.51	13	2,076	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.46	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	-	0.19	3	462	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	-	0.13	5	817	バイオテクノロジー
WASTE MANAGEMENT INC	0.47	-	-	-	商業サービス・用品
WATSCO INC	-	0.16	6	933	商社・流通業
REGIONS FINANCIAL CORP	1.61	-	-	-	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	-	0.07	2	447	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN UNION CO	3.18	-	-	-	金融サービス

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LULULEMON ATHLETICA INC	0.12	0.08	3	554	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
NXP SEMICONDUCTOR NV	0.46	0.39	9	1,373	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	0.72	—	—	—	専門サービス
LEAR CORP	0.35	—	—	—	自動車用部品
FORTINET INC	0.69	—	—	—	ソフトウェア
PHILLIPS 66	0.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	—	0.67	31	4,772	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	0.47	7	1,201	石油・ガス・消耗燃料
ABBVIE INC	1.16	1.31	22	3,438	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	0.28	0.28	35	5,318	半導体・半導体製造装置
ALLEGION PLC	0.24	—	—	—	建設関連製品
DOCUSIGN INC	—	0.45	2	345	ソフトウェア
CIGNA GROUP	0.59	0.36	12	1,834	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	1.45	7	1,169	化学
FOX CORP-A	—	2.09	6	951	メディア
FOX CORP-B	1.51	2.19	6	914	メディア
FERGUSON PLC	0.43	—	—	—	商社・流通業
CARLYLE GROUP INC	1.51	1.51	6	1,000	資本市場
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	—	0.8	6	1,045	コンピュータ・周辺機器
F&G ANNUITIES & LIFE INC	0.08	—	—	—	保険
AIRBNB INC	—	0.29	4	646	ホテル・レストラン・レジャー
ROYALTY PHARMA PLC	1.19	2.34	6	1,031	医薬品
VIATRIS INC	4.38	6.33	7	1,149	医薬品
ARISTA NETWORKS INC	—	0.18	4	719	通信機器
FNF GROUP	—	1.34	6	1,048	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1.31	—	—	—	銀行
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	—	1	6	995	飲料
KRAFT HEINZ CO	1.39	2.05	7	1,053	食品
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	3.23	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
小 計	株 数	株 数	768	115,676	
	銘 柄 数	銘 柄 数	—	<37.4%>	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA	5.87	—	—	—	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	—	1.08	11	1,228	銀行
BCE INC	4.17	—	—	—	各種電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP-CL A	0.86	—	—	—	大規模小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	3.97	—	—	—	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3.06	4.37	76	8,476	陸上運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3.21	4.65	21	2,404	繊維・アパレル・贅沢品
EMPIRE CO LTD	—	5.78	19	2,162	生活必需品流通・小売り
KINROSS GOLD CORP	20.84	—	—	—	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	—	16.83	51	5,736	保険
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	2	16	1,873	生活必需品流通・小売り
QUEBECOR INC-B	3.93	—	—	—	各種電気通信サービス
LUNDIN MINING CORP	13.22	19.64	21	2,398	金属・鉱業
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1.26	—	—	—	商社・流通業

銘柄	株数	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	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	0.57	6	674	紙製品・林産品	
ARC RESOURCES LTD	13.47	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	—	12.76	28	3,195	商業サービス・用品	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	—	1.57	8	949	資本市場	
AIR CANADA	—	2.97	5	626	旅客航空輸送	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	81.57 13銘柄	72.22 11銘柄	267 —	29,726 <9.6%>	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
FORTESCUE LTD	7.48	12.02	33	3,248	金属・鉱業	
BHP GROUP LTD	11	8.82	40	3,955	金属・鉱業	
AMPOL LTD	2.02	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
COMPUTERSHARE LT	4.26	4.34	11	1,113	専門サービス	
COCHLEAR LTD	—	0.38	12	1,220	ヘルスケア機器・用品	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1.23	—	—	—	銀行	
RIO TINTO LIMITED	1.43	1.14	14	1,427	金属・鉱業	
APA GROUP	9.14	11.49	9	902	ガス	
ARISTOCRAT LEISU	2.36	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	—	2.37	13	1,282	建設資材	
MACQUARIE GROUP LTD	1.13	—	—	—	資本市場	
SUNCORP GROUP LTD	—	8.1	11	1,141	保険	
SONIC HEALTHCARE	3.3	—	—	—	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	—	2.52	8	825	金融サービス	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	—	5.43	16	1,652	石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS GROUP LTD	2.97	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
SEEK LTD	4.49	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
LOTTERY CORP LTD	20.89	20.74	10	996	ホテル・レストラン・レジャー	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	7.55	20	2,049	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	71.7 13銘柄	84.9 12銘柄	203 —	19,816 <6.4%>	
<b>(香港)</b>	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	45	875	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	13	254	建設関連製品	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	10	—	—	—	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	30 2銘柄	58 —	1,130 <0.4%>	
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
DCC PLC	—	0.64	3	680	コンゴロマリット	
NATIONAL GRID PLC	11.33	—	—	—	総合公益事業	
BAE SYSTEMS PLC	11.25	—	—	—	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5.15	3.63	8	1,647	タバコ	
NEXT PLC	—	0.27	2	423	大規模小売り	
HSBC HOLDINGS PLC	—	11.01	6	1,292	銀行	
UNILEVER PLC	—	5	19	3,770	パーソナルケア用品	
RIO TINTO PLC	2.2	—	—	—	金属・鉱業	
VODAFONE GROUP PLC	67.08	71.9	4	888	無線通信サービス	
NATWEST GROUP PLC	—	19.84	4	784	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
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	24.73	3	672	家庭用耐久財
TESCO PLC	—	9.44	2	495	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC	—	1.18	2	533	資本市場
GSK PLC	23.5	6.65	11	2,098	医薬品
WPP PLC	8.29	—	—	—	メディア
WHITBREAD PLC	—	1.07	3	697	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	—	0.91	3	753	専門サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS	1.39	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
ABRDN PLC	31.56	—	—	—	資本市場
GLENCORE PLC	—	17.6	6	1,303	金属・鉱業
COCA-COLA HBC AG	—	0.9	2	405	飲料
M&G PLC	25.66	16.13	3	670	金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	295.78 13銘柄	190.9 16銘柄	90 —	17,116 <5.5%>
(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-GENUSSCHEIN	—	0.96	21	3,706	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	2.73	2.8	24	4,177	医薬品
CLARIANT AG-REG	—	4.34	4	807	化学
ABB LTD	4.13	—	—	—	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	2.79	1.47	5	911	専門サービス
GEBERIT AG	—	0.13	6	1,115	建設関連製品
ROCHE HOLDING AG-BEARER	—	0.24	5	977	医薬品
HOLCIM LTD	2.14	1.35	8	1,526	建設資材
THE SWATCH GROUP AG-REG	—	1.27	5	871	繊維・アパレル・贅沢品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	0.12	14	2,474	資本市場
SWISS RE LTD	1.18	1.55	15	2,699	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17.97 6銘柄	14.23 10銘柄	113 —	19,268 <6.2%>
(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	3.14	52	757	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	2.49	36	522	機械
ERICSSON LM-B SHS	21.94	10.04	55	794	通信機器
SKF AB-B SHS	—	1.89	40	575	機械
SKANSKA AB-B SHS	4.79	—	—	—	建設・土木
VOLVO AB-A SHS	3.59	1.33	36	518	機械
VOLVO AB-B SHS	9.6	4.02	106	1,530	機械
TELE2 AB-B SHS	8.91	—	—	—	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	1.02	33	486	金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	—	1.05	34	501	金融サービス
BOLIDEN AB	2	—	—	—	金属・鉱業
INDUTRADE AB	—	0.93	25	363	機械
EPIROC AB-A	2.4	—	—	—	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	59.47 8銘柄	25.91 9銘柄	422 —	6,050 <2.0%>
(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	0.51	1	306	容器・包装
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1.84 1銘柄	0.51 1銘柄	1 —	306 <0.1%>

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	
			株数	株数			
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円			
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	—	0.26	4	649			半導体・半導体製造装置
ING GROEP NV-CVA	—	6.09	7	1,208			銀行
ASM INTERNATIONAL NV	0.34	—	—	—			半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	2.31	0.83	4	709			専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	4.27	2.06	5	886			生活必需品流通・小売り
ASML HOLDING NV	0.97	—	—	—			半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6.58	2.13	3	640			ヘルスケア機器・用品
KONINKLIJKE KPN NV	26.67	11.62	3	601			各種電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5.6	—	—	—			飲料
OCI NV	1.89	1.31	3	574			化学
FERRARI NV	0.56	0.12	4	689			自動車
JDE PEET'S BV	—	1.07	2	387			食品
NN GROUP NV	2	0.99	3	599			保険
STELLANTIS NV	11.36	—	—	—			自動車
ABN AMRO BANK NV	5.31	2.3	3	532			銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	67.86 12銘柄	28.78 11銘柄	46	7,478	—	<2.4%>
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円			
KBC GROUPE	1.51	—	—	—			銀行
AGEAS	—	0.78	2	484			保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1.51 1銘柄	0.78 1銘柄	2	484	—	<0.2%>
<b>(ユーロ…フランス)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円			
BOUYGUES	2.56	—	—	—			建設・土木
BNP PARIBAS	3.38	—	—	—			銀行
EIFFAGE	0.8	0.33	3	512			建設・土木
PUBLICIS GROUPE	—	0.56	5	877			メディア
L'OREAL	—	0.17	7	1,184			パーソナルケア用品
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	2.91	—	—	—			建設関連製品
SOCIETE GENERALE-A	4.18	—	—	—			銀行
VINCI S.A.	1.74	—	—	—			建設・土木
ORANGE	—	4.51	4	774			各種電気通信サービス
KERING	0.29	—	—	—			繊維・アパレル・贅沢品
SANOFI	3.04	1.66	14	2,298			医薬品
BIOMERIEUX	0.53	—	—	—			ヘルスケア機器・用品
ENGIE	8.24	3.68	5	854			総合公益事業
IPSEN SA	0.5	—	—	—			医薬品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1.74	1.28	4	798			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	12.19 7銘柄	45	7,300	—	<2.4%>
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円			
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	—	0.62	6	1,013			自動車
FRESENIUS SE & CO KGAA	—	1.37	3	577			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
HENKEL AG & CO KGAA	—	0.49	3	498			家庭用品
BAYER AG	3.19	1.93	5	875			医薬品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	—	1.33	8	1,407			自動車
HEIDELBERG MATERIALS AG	—	0.24	1	319			建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	2.42	0.87	3	553			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	0.12	4	794			保険
NEMETSCHKE SE	—	0.2	1	281			ソフトウェア

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	
BMW VORZUG	—	0.33	3	508	自動車
RATIONAL AG	0.09	0.02	1	241	機械
EVONIK INDUSTRIES AG	—	1.59	2	439	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	27.86	—	—	—	各種電気通信サービス
TALANX AG	—	0.23	1	250	保険
SCOUT24 SE	—	0.26	1	272	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	9.6 14銘柄	49 —	8,032 <2.6%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA S.A	28.49	12.51	4	722	各種電気通信サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2.66	0.84	3	495	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	24	5.17	4	767	銀行
INDITEX	9.36	1.95	7	1,234	専門小売り
ENAGAS	4.16	1.7	2	393	ガス
AENA SME SA	—	0.12	1	321	運送インフラ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	68.67 5銘柄	22.29 6銘柄	24 —	3,935 <1.3%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	—	27.77	7	1,262	銀行
ENI SPA	9.67	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
RECORDATI SPA	1.31	0.33	1	269	医薬品
PRYSMIAN SPA	1.84	0.48	1	317	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	0.3	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13.12 4銘柄	28.58 3銘柄	11 —	1,849 <0.6%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	—	1.27	1	286	機械
SAMPO OYJ-A SHS	—	0.6	2	393	保険
FORTUM OYJ	4.52	—	—	—	電力
NESTE OYJ	2.02	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6.54 2銘柄	1.87 2銘柄	4 —	679 <0.2%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ERSTE GROUP BANK AG	—	0.56	2	356	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	0.56 1銘柄	2 —	356 <0.1%>
(ユーロ…バミューダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON LTD	—	6.42	3	558	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	6.42 1銘柄	3 —	558 <0.2%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,076.87 183銘柄	633.72 191銘柄	— —	239,769 <77.5%>

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

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

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

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期	
		買建額	売建額
国内	T O P I X	百万円 -	百万円 51
	S & P 5 0 0 E M I N I F U T	百万円 -	百万円 113
国外	S & P / T S E 6 0 I X F U T	-	28
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	-	18
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	-	14
	S W I S S M K T I X F U T U R E	-	18
	O M X S 3 0 I N D F U T U R E	-	3
国	D J E U R O S T O X X 5 0	-	30

(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

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 293,334	% 86.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	45,059	13.3
投 資 信 託 財 産 総 額	338,393	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、261,710千円、77.3%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、2024年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.49円、1カナダ・ドル=111.14円、1オーストラリア・ドル=97.61円、1香港・ドル=19.25円、1イギリス・ポンド=189.17円、1スイス・フラン=169.93円、1スウェーデン・クローナ=14.32円、1ユーロ=161.52円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	635,430,673円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,970,462
株 式(評価額)	293,334,076
未 収 入 金	298,205,812
未 収 配 当 金	234,421
差 入 委 託 証 拠 金	37,685,902
(B) 負 債	325,886,249
未 払 金	325,886,249
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	309,544,424
元 本	340,561,240
次 期 繰 越 損 益 金	△31,016,816
(D) 受 益 権 総 口 数	340,561,240口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,089円

(注1) 期首元本額 388,958,360円  
追加設定元本額 0円  
一部解約元本額 48,397,120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)  
340,561,240円  
期末元本合計 340,561,240円

## ■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	11,794,817円
受 取 配 当 金	11,311,658
受 取 利 息	90,789
そ の 他 収 益 金	394,747
支 払 利 息	△2,377
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,598,402
売 買 益	98,038,651
売 買 損	△80,440,249
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△32,128,180
取 引 益	14,789,705
取 引 損	△46,917,885
(D) そ の 他 費 用	△3,006,458
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△5,741,419
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△29,672,517
(G) 解 約 差 損 益 金	4,397,120
(H) 合 計(E+F+G)	△31,016,816
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△31,016,816

(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。