

Smart-i S&P500インデックス

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2021年6月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「Smart-i S&P500インデックス」は、2021年6月25日に第1期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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／海外／株式／インデックス型
信託期間	2020年7月29日から無期限です。
運用方針	S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	RM S&P500マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、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には分配を行わないことがあります。

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ：<https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率				
(設定日)	円	円				%	%	%	百万円
2020年7月29日	10,000	—	—	699,762.56	—	—	—	—	201
1期(2021年6月25日)	14,007	0	40.1	985,265.43	40.8	91.0	7.7	2.4	1,193

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。S & P 5 0 0[®]とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S & P 5 0 0 は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスがリソナアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがリソナアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) (ベンチマーク)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2020年7月29日	10,000	—	699,762.56	—	—	—	—
7月末	10,001	0.0	696,428.51	△ 0.5	94.6	2.5	2.7
8月末	10,897	9.0	759,339.83	8.5	94.7	2.5	2.5
9月末	10,398	4.0	725,995.29	3.7	93.2	4.1	2.5
10月末	10,209	2.1	713,036.68	1.9	88.3	9.4	2.3
11月末	11,153	11.5	779,733.84	11.4	87.2	10.0	2.2
12月末	11,390	13.9	796,735.37	13.9	88.7	8.5	2.1
2021年1月末	11,688	16.9	818,205.56	16.9	88.7	8.5	2.1
2月末	12,028	20.3	842,516.07	20.4	88.2	9.2	2.1
3月末	12,961	29.6	908,718.47	29.9	64.4	35.5	1.6
4月末	13,562	35.6	952,086.17	36.1	89.5	8.6	2.2
5月末	13,657	36.6	959,167.62	37.1	64.0	35.3	1.6
(期 末)							
2021年6月25日	14,007	40.1	985,265.43	40.8	91.0	7.7	2.4

(注) 騰落率は設定日比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2020年7月29日～2021年6月25日)

期中の基準価額等の推移



設定時：10,000円

期 末：14,007円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率： 40.1% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) は、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) は当ファンドのベンチマークです。
- (注) S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。S & P 5 0 0[®]とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。S & P 5 0 0は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスがりそなアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor'sおよびS&Pは、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow JonesはDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがりそなアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は設定時10,000円から当期末14,007円となり、4,007円の値上がりとなりました。

米国株式の市況(S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース))の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも米国の株価が上昇したことが寄りました。

投資環境

米国株式市況

米国の株式市場は、設定時と比較して上昇しました。新型コロナウイルス問題に伴う先行きの不透明感が続くなか、政策当局による大規模な財政・金融支援策に対する期待等から上昇基調で推移しました。低金利環境が相場を下支えたことに加え、新型コロナウイルスワクチンの開発・普及に向けた期待や、米大統領選挙の結果判明により景気見通しや政治・政局を巡る不確実性が一定程度緩和されたこと等も追い風となりました。その後、長期金利の上昇により調整する場面も見られましたが、追加的経済対策実現への期待等から経済活動の早期正常化を織り込む動きとなり、上昇基調を維持しました。

為替市況

設定時と比較して、円は米ドルに対し円安となりました。

FRB（米連邦準備制度理事会）が主導する金融緩和策の継続により低金利環境の長期化が見込まれるなか、米国の実質金利低下等を受けて一時102円台まで円高が進みましたが、期末にかけては米国の長期金利上昇に伴う金利差拡大等を背景に円安が進み、米ドルは一時110円台後半をつける場面も見られました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM S&P500マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用を行いました。

RM S&P500マザーファンド

S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式を主要投資対象とし、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+40.1%となり、ベンチマークの+40.8%を0.7%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

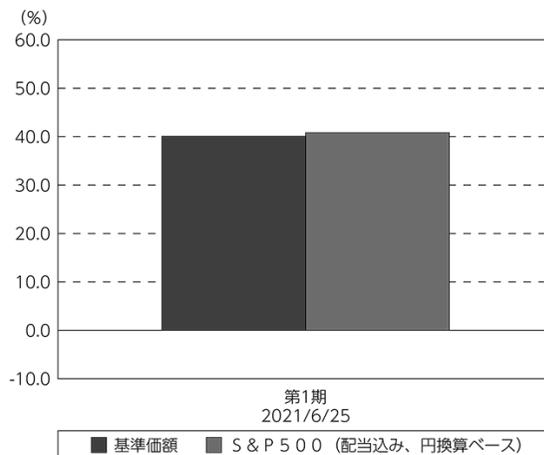
(マイナス要因)

- ・ 信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・ コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・ 配当金の課税負担が生じたこと

(その他の要因)

- ・ ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第1期
	2020年7月29日～ 2021年6月25日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,007

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
 (注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RM S&P500マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RM S&P500マザーファンド

引き続き、主としてS&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式に投資し、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○1万口当たりの費用明細

(2020年7月29日～2021年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	26	0.220	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(12)	(0.100)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(12)	(0.100)	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、購入後の 情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.020)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	33	0.282	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(20)	(0.171)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(5)	(0.039)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(8)	(0.072)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(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 ）	(0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	48	0.409	(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 ）	(46)	(0.398)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.003)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	107	0.912	
期中の平均基準価額は、11,631円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

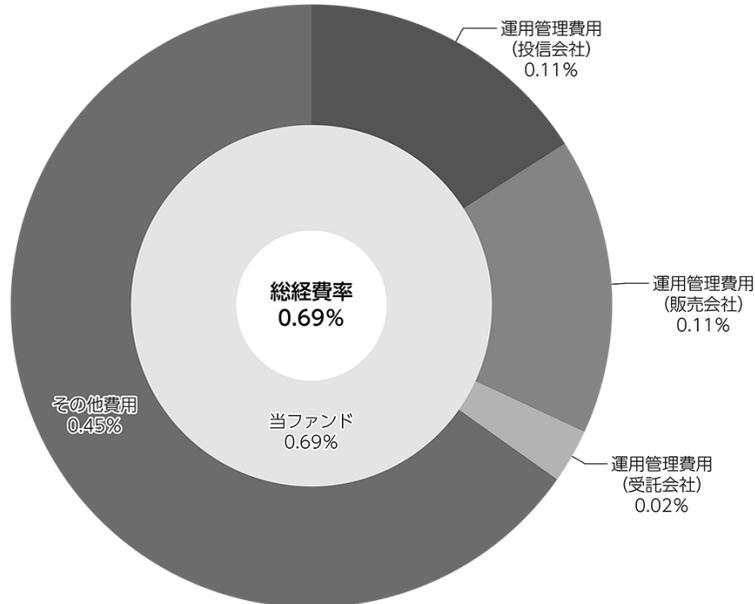
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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0.69%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年7月29日～2021年6月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
RM S&P500マザーファンド	千口 888,378	千円 1,115,710	千口 38,626	千円 52,640

○株式売買比率

(2020年7月29日～2021年6月25日)

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
	RM S&P500マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	984,712千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	293,316千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.35

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年7月29日～2021年6月25日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取引理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2021年6月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
RM S&P500マザーファンド		849,751	1,193,305

○投資信託財産の構成

(2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
RM S&P500マザーファンド	1,193,305	94.3
コール・ローン等、その他	71,903	5.7
投資信託財産総額	1,265,208	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) RM S&P500マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,220,464千円)の投資信託財産総額(1,238,818千円)に対する比率は98.5%です。

(注) 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。1米ドル=110.99円。

○特定資産の価格等の調査

(2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,265,208,275
コール・ローン等	26,432,590
RM S&P500マザーファンド(評価額)	1,193,305,685
未収入金	45,470,000
(B) 負債	71,351,434
未払解約金	70,748,250
未払信託報酬	582,533
未払利息	71
その他未払費用	20,580
(C) 純資産総額(A-B)	1,193,856,841
元本	852,306,107
次期繰越損益金	341,550,734
(D) 受益権総口数	852,306,107口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,007円

(注) 当ファンドの設定時元本額は201,000,000円、期中追加設定元本額は812,297,809円、期中一部解約元本額は160,991,702円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は14,007円です。

○損益の状況 (2020年7月29日～2021年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,320
支払利息	△ 1,320
(B) 有価証券売買損益	109,744,192
売買益	130,308,780
売買損	△ 20,564,588
(C) 信託報酬等	△ 892,721
(D) 当期損益金(A+B+C)	108,850,151
(E) 追加信託差損益金	232,700,583
(配当等相当額)	(△ 1,015)
(売買損益相当額)	(232,701,598)
(F) 計(D+E)	341,550,734
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	341,550,734
追加信託差損益金	232,700,583
(配当等相当額)	(729,338)
(売買損益相当額)	(231,971,245)
分配準備積立金	108,850,151

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(E)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,109,663円)、費用控除後の有価証券等損益額(104,740,488円)、および信託約款に規定する収益調整金(232,700,583円)より分配対象収益は341,550,734円(1万口当たり4,007円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

・投資する親投資信託の名称変更に伴い、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

<当ファンドが投資対象とするRM S&P500マザーファンドは以下の約款変更を行いました。>

・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

RM S&P500マザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2021年6月25日）
（2020年7月29日～2021年6月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2020年7月29日から無期限です。
運用方針	<p>①主として、米国の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式のうち、S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S&P500（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、米国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）、米国の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>②株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。</p> <p>③組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
主要投資対象	<p>・米国の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式*のうち、S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式</p> <p>*DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。</p>
主な投資制限	<p>・株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株 先物比 率	投資信託 組入比率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
(設定日)	円	%		%	%	%	%	百万円
2020年7月29日	10,000	—	699,762.56	—	—	—	—	200
1期(2021年6月25日)	14,043	40.4	985,265.43	40.8	91.1	7.7	2.4	1,193

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。S & P 5 0 0[®]とは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。S & P 5 0 0は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスがリーソナアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがリーソナアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 5 0 0 (配当込み、円換算ベース) (ベンチマーク)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2020年7月29日	10,000	—	699,762.56	—	—	—	—
7月末	10,001	0.0	696,428.51	△ 0.5	94.6	2.5	2.7
8月末	10,900	9.0	759,339.83	8.5	94.7	2.5	2.5
9月末	10,403	4.0	725,995.29	3.7	93.3	4.1	2.5
10月末	10,216	2.2	713,036.68	1.9	88.3	9.4	2.3
11月末	11,164	11.6	779,733.84	11.4	87.3	10.1	2.2
12月末	11,403	14.0	796,735.37	13.9	88.8	8.5	2.1
2021年1月末	11,704	17.0	818,205.56	16.9	88.8	8.5	2.1
2月末	12,047	20.5	842,516.07	20.4	88.3	9.2	2.1
3月末	12,986	29.9	908,718.47	29.9	64.5	35.5	1.6
4月末	13,591	35.9	952,086.17	36.1	89.5	8.6	2.2
5月末	13,689	36.9	959,167.62	37.1	64.0	35.3	1.6
(期 末)							
2021年6月25日	14,043	40.4	985,265.43	40.8	91.1	7.7	2.4

(注) 騰落率は設定日比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2020年7月29日～2021年6月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は設定時10,000円から当期末14,043円となり、4,043円の値上がりとなりました。

米国株式の市況（S&P500（配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも米国の株価が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移

(2020年7月29日～2021年6月25日)



(注) ベンチマークは設定時の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

米国株式市況

米国の株式市場は、設定時と比較して上昇しました。新型コロナウイルス問題に伴う先行きの不透明感が続くなか、政策当局による大規模な財政・金融支援策に対する期待等から上昇基調で推移しました。低金利環境が相場を下支えたことに加え、新型コロナワクチンの開発・普及に向けた期待や、米大統領選挙の結果判明により景気見通しや政治・政局を巡る不確実性が一定程度緩和されたこと等も追い風となりました。その後、長期金利の上昇により調整する場面も見られましたが、追加的経済対策実現への期待等から経済活動の早期正常化を織り込む動きとなり、上昇基調を維持しました。

為替市況

設定時と比較して、円は米ドルに対し円安となりました。

F R B（米連邦準備制度理事会）が主導する金融緩和策の継続により低金利環境の長期化が見込まれるなか、米国の実質金利低下等を受けて一時102円台まで円高が進みましたが、期末にかけては米国の長期金利上昇に伴う金利差拡大等を背景に円安が進み、米ドルは一時110円台後半をつける場面も見られました。

当ファンドのポートフォリオ

S&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式を主要投資対象とし、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+40.4%となり、ベンチマークの+40.8%を0.4%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

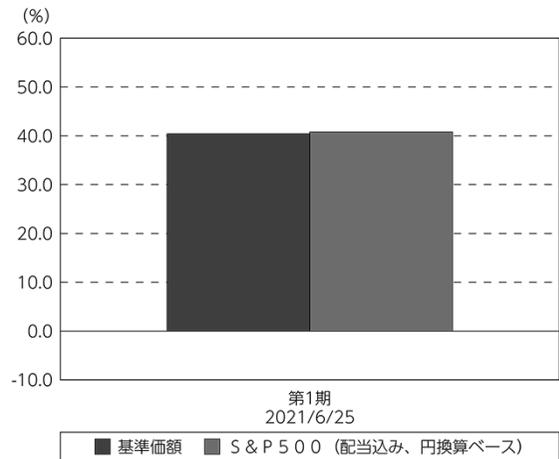
（マイナス要因）

- ・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
- ・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてS&P500（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式に投資し、S&P500（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○1万口当たりの費用明細

(2020年7月29日～2021年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 33 (20) (5) (8)	% 0.282 (0.171) (0.039) (0.072)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	0 (0) (0)	0.001 (0.000) (0.001)	(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)	47 (46) (0)	0.401 (0.398) (0.003)	(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、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	80	0.684	
期中の平均基準価額は、11,645円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年7月29日～2021年6月25日)

株式

外 国	買 付	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル	
	800	9,028	2	14	
	(10)	(2)	(0.23)	(3)	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 1,104	百万円 1,035	百万円 —	百万円 —

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2020年7月29日～2021年6月25日)

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	984,712千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	293,316千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.35

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年6月25日現在)

外国株式

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AES CORP	1	4	533	公益事業
AT&T INC	19	57	6,355	電気通信サービス
ABBVIE INC	4	56	6,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADVANCE AUTO PARTS INC	0.19	3	423	小売
AGILENT TECHNOLOGIES INC	0.85	12	1,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALASKA AIR GROUP INC	0.35	2	246	運輸
ALTRIA GROUP INC	5	24	2,711	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	0.41	4	525	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	0.32	7	871	各種金融
ARISTA NETWORKS INC	0.15	5	605	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	0.17	2	293	保険
BAKER HUGHES COMPANY	2	4	530	エネルギー
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.06	3	420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	0.39	33	3,754	各種金融
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3	17	1,916	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	1	9	1,044	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6	41	4,553	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	0.32	5	569	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0.51	3	419	食品・飲料・タバコ
CBRE GROUP INC - A	0.94	8	915	不動産
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	0.6	3	338	素材
CIGNA CORP	0.96	22	2,501	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	0.81	4	531	公益事業
CSX CORP	2	20	2,228	運輸
ALBEMARLE CORP	0.33	5	607	素材
CVS HEALTH CORP	3	30	3,421	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	1	1	204	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	0.57	2	285	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1	19	2,203	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	0.8	4	498	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	0.46	5	609	小売
CARNIVAL CORP	2	6	682	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	2	10	1,169	資本財
CATALENT INC	0.48	5	582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	1	33	3,724	資本財
CELANESE CORP	0.32	4	532	素材
CENTENE CORP	1	11	1,308	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	1	3	437	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	0.14	5	569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEVRON CORP	5	57	6,409	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.08	11	1,322	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	0.68	5	627	家庭用品・パーソナル用品
CITIGROUP INC	5	41	4,567	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1	5	620	銀行
ALLIANT ENERGY CORP	0.7	3	438	公益事業
CLOROX COMPANY	0.34	5	650	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
COCA-COLA CO/THE	10	58	6,525	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	2	18	2,101	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	0.84	10	1,202	保険
COMERICA INC	0.39	2	313	銀行
CONAGRA BRANDS INC	1	4	526	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	3	23	2,582	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	0.95	6	774	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	0.47	10	1,178	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	0.14	5	606	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	2	8	982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	2	9	1,009	素材
CUMMINS INC	0.41	9	1,088	資本財
DR HORTON INC	0.93	8	921	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	0.54	7	780	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	0.71	2	301	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	1	47	5,281	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	0.71	5	640	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	0.37	5	574	消費者サービス
DAVITA INC	0.12	1	161	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	0.87	30	3,385	資本財
DELTA AIR LINES INC	1	7	887	運輸
DEVON ENERGY CORP	1	4	547	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	5	90	9,992	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	0.85	10	1,138	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	1	11	1,278	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	0.11	2	308	保険
DOLLAR GENERAL CORP	0.67	14	1,590	小売
DOMINION ENERGY INC	2	16	1,863	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	0.11	5	561	消費者サービス
AMERICAN EXPRESS CO	1	30	3,379	各種金融
DOVER CORP	0.4	5	655	資本財
DOW INC	2	13	1,456	素材
DUKE ENERGY CORP	2	21	2,353	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	1	11	1,254	素材
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2	11	1,284	保険
EOG RESOURCES INC	1	14	1,576	エネルギー
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	0.61	5	588	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	0.38	4	494	素材
ECOLAB INC	0.7	14	1,617	素材
EDISON INTERNATIONAL	1	5	650	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1	18	2,004	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	4	55	6,149	ヘルスケア機器・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	1	15	1,767	資本財
ENTERGY CORP	0.56	5	627	公益事業
EQUIFAX INC	0.34	8	902	商業・専門サービス
EVERGY INC	0.64	3	436	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	0.96	7	844	公益事業
EXELON CORP	2	12	1,335	公益事業
EXXON MOBIL CORP	11	76	8,450	エネルギー
FMC CORP	0.36	4	450	素材
AMERICAN WATER WORKS CO INC	0.51	7	876	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AMETEK INC	0.64	8	949	資本財
FEDEX CORP	0.68	20	2,292	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1	25	2,798	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	1	11	1,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	0.49	9	1,007	銀行
FIRSTENERGY CORP	1	5	623	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	0.23	5	655	ソフトウェア・サービス
FORD MOTOR CO	10	16	1,842	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	0.94	6	724	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	0.39	3	422	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	0.76	2	274	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	4	15	1,699	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	0.57	7	887	保険
GAP INC/THE	0.35	1	128	小売
GARTNER INC	0.24	5	634	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	0.69	26	2,897	ヘルスケア機器・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	0.18	7	784	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	0.64	12	1,336	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	24	32	3,574	資本財
GENERAL MILLS INC	1	10	1,116	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	3	21	2,365	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	0.41	5	574	小売
GLOBAL PAYMENTS INC	0.82	15	1,742	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	0.27	2	288	保険
GOLDMAN SACHS GROUP INC	0.95	35	3,888	各種金融
WW GRAINGER INC	0.12	5	588	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1	9	1,068	食品・飲料・タバコ
HCA HEALTHCARE INC	0.73	14	1,656	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	3	9	1,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	2	5	655	エネルギー
HANESBRANDS INC	1	1	219	耐久消費財・アパレル
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1	6	690	保険
HERSHEY CO/THE	0.41	7	784	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	0.76	6	746	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3	5	590	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0.78	9	1,077	消費者サービス
HOME DEPOT INC	2	92	10,244	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1	42	4,687	資本財
HORMEL FOODS CORP	0.78	3	410	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	1	3	418	資本財
HUMANA INC	0.36	15	1,760	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	0.07	1	163	資本財
IDEX CORP	0.21	4	509	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	0.8	17	1,976	資本財
INGERSOLL-RAND INC	1	4	549	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1	18	2,057	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2	36	4,019	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	0.69	10	1,136	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	1	6	735	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1	3	404	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	0.53	12	1,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
JPMORGAN CHASE & CO	8	128	14,286	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	0.36	4	540	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	7	119	13,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	0.92	2	279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	0.25	7	791	運輸
KELLOGG CO	0.7	4	492	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	2	5	634	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	0.51	7	864	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	0.94	12	1,367	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	5	9	1,103	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	0.36	3	389	公益事業
KROGER CO	2	8	916	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	0.66	4	528	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	0.57	12	1,389	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0.28	7	823	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	0.41	3	364	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	0.92	4	530	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	0.65	20	2,227	家庭用品・パーソナル用品
LEGGETT & PLATT INC	0.24	1	135	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	0.37	3	423	商業・専門サービス
LENNAR CORP-A	0.79	7	852	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	2	51	5,740	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	0.06	8	968	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	0.5	3	351	保険
AVERY DENNISON CORP	0.23	4	530	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	0.41	3	418	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	0.68	25	2,850	資本財
LOEWS CORP	0.63	3	385	保険
LOWE'S COS INC	1	37	4,192	小売
LUMEN TECHNOLOGIES INC	2	3	430	電気通信サービス
M & T BANK CORP	0.36	5	590	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1	5	557	消費者サービス
MSCI INC	0.23	12	1,360	各種金融
MARATHON OIL CORP	2	3	350	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	1	11	1,259	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	1	19	2,177	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.18	6	717	素材
MASCO CORP	0.71	4	453	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	2	91	10,148	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	0.69	5	660	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	2	48	5,386	消費者サービス
MCKESSON CORP	0.44	8	922	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	0.92	7	837	素材
MERCK & CO. INC.	7	53	5,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	2	12	1,385	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.06	8	902	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	21	85	9,525	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.18	3	380	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	0.52	2	317	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	0.45	16	1,807	各種金融
MORGAN STANLEY	4	36	4,001	各種金融

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
MOSAIC CO/THE	0.96	2	332	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.47	10	1,119	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	0.68	2	283	公益事業
NVR INC	0.01	4	534	耐久消費財・アパレル
NOV INC	1	1	185	エネルギー
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2	11	1,254	各種金融
NEWELL RUBBERMAID INC	1	2	327	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	2	13	1,541	素材
NEXTERA ENERGY INC	5	39	4,416	公益事業
NIKE INC -CL B	3	47	5,293	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	1	2	300	公益事業
NORFOLK SOUTHERN CORP	0.7	18	2,058	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	0.42	15	1,723	資本財
NUCOR CORP	0.83	8	901	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2	7	824	エネルギー
OMNICOM GROUP	0.61	4	538	メディア・娯楽
ONEOK INC	1	6	769	エネルギー
ORACLE CORP	5	39	4,365	ソフトウェア・サービス
ORGANON & CO	0.42	1	138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTIS WORLDWIDE CORP	1	9	1,011	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1	22	2,498	銀行
PPG INDUSTRIES INC	0.66	11	1,241	素材
PPL CORP	2	5	663	公益事業
PVH CORP	0.22	2	264	耐久消費財・アパレル
PACKAGING CORP OF AMERICA	0.27	3	400	素材
PARKER HANNIFIN CORP	0.36	10	1,194	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	0.14	5	570	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	3	56	6,224	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	0.31	4	521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	15	61	6,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	1	11	1,264	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4	42	4,770	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	1	10	1,214	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	0.31	2	280	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	0.65	10	1,183	エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	0.71	4	495	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6	90	10,068	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	1	15	1,731	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1	11	1,251	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1	8	929	公益事業
PULTEGROUP INC	0.77	4	456	耐久消費財・アパレル
QUANTA SERVICES INC	0.39	3	398	資本財
QUEST DIAGNOSTICS INC	0.36	4	516	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	0.07	0.842	93	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	0.34	4	496	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	4	36	4,067	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	0.81	19	2,156	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	2	5	608	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	0.59	6	709	商業・専門サービス
RESMED INC	0.41	10	1,119	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	0.32	2	317	商業・専門サービス

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
ROCKWELL AUTOMATION INC	0.33	9	1,045	資本財
ROLLINS INC	0.37	1	139	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	0.3	13	1,536	資本財
S&P GLOBAL INC	0.67	27	3,057	各種金融
SALESFORCE.COM INC	2	62	6,980	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	3	13	1,443	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	4	30	3,404	各種金融
SEALED AIR CORP	0.26	1	168	素材
SEMPRA ENERGY	0.88	11	1,323	公益事業
SERVICENOW INC	0.55	30	3,370	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0.67	18	2,008	素材
SMITH (A. O.) CORP	0.38	2	285	資本財
JM SMUCKER CO/THE	0.31	3	442	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	0.15	3	368	資本財
SOUTHERN CO/THE	2	17	1,996	公益事業
WR BERKLEY CORP	0.39	2	320	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	1	9	1,001	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5	145	16,144	各種金融
STANLEY BLACK & DECKER INC	0.45	9	1,011	資本財
STATE STREET CORP	0.97	7	881	各種金融
STRYKER CORP	0.92	24	2,669	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	0.63	7	778	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	1	7	815	各種金融
SYSCO CORP	1	11	1,225	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	3	22	2,519	小売
TAPESTRY INC	0.82	3	391	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	1	33	3,700	小売
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.13	5	611	資本財
TELEFLEX INC	0.13	5	578	ヘルスケア機器・サービス
TEXTRON INC	0.63	4	466	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1	54	6,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	1	31	3,474	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	0.15	10	1,132	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	0.7	10	1,165	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	3	20	2,308	銀行
TWITTER INC	2	15	1,696	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.11	4	544	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	0.82	6	676	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	3	21	2,392	銀行
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	0.34	0.722	80	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	0.14	0.26	28	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	1	40	4,485	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2	41	4,597	運輸
UNITED RENTALS INC	0.2	6	703	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	2	104	11,643	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	0.22	3	364	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	0.57	1	179	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	0.62	17	1,995	素材
VF CORP	0.92	7	830	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	1	9	1,034	エネルギー
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11	64	7,213	電気通信サービス

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
VISA INC-CLASS A SHARES	4	111	12,349	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	0.37	6	722	素材
WEC ENERGY GROUP INC	0.88	7	870	公益事業
WABTEC CORP	0.5	4	463	資本財
WALMART INC	3	52	5,804	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	1	15	1,676	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.17	5	650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & CO	11	52	5,781	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.21	7	838	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN UNION CO	1	2	294	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	0.74	3	438	素材
WHIRLPOOL CORP	0.18	3	429	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	3	9	1,016	エネルギー
BOEING CO/THE	1	38	4,255	資本財
XCEL ENERGY INC	1	9	1,103	公益事業
XYLEM INC	0.5	5	648	資本財
YUM! BRANDS INC	0.83	9	1,077	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0.58	9	1,058	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	1	24	2,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	0.66	3	357	自動車・自動車部品
INVESCO LTD	1	2	316	各種金融
CHUBB LTD	1	20	2,236	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	0.72	7	818	素材
ACCENTURE PLC-CL A	1	51	5,727	ソフトウェア・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	0.92	12	1,364	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	0.75	11	1,291	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	1	16	1,794	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	1	3	353	消費者サービス
ALLEGION PLC	0.25	3	384	資本財
STERIS PLC	0.27	5	611	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	0.37	1	189	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	4	4	549	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	0.67	12	1,337	資本財
AON PLC	0.63	15	1,667	保険
PENTAIR PLC	0.46	3	337	資本財
MEDTRONIC PLC	3	47	5,220	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	1	2	279	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2	13	1,477	資本財
LINDE PLC	1	41	4,588	素材
ABIOMED INC	0.13	4	449	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	2	20	2,228	メディア・娯楽
ADOBE INC	1	76	8,536	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	3	29	3,230	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0.45	5	578	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.2	12	1,370	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	0.79	201	22,320	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	0.84	205	22,841	メディア・娯楽
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1	4	444	運輸
ANSYS INC	0.24	8	909	ソフトウェア・サービス
APA CORP	0.67	1	165	エネルギー
BIOGEN INC	0.42	14	1,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期末			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
BOOKING HOLDINGS INC	0.11	24	2,742	消費者サービス
BROADCOM INC	1	53	5,947	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	0.3	3	403	各種金融
CDW CORP/DE	0.39	6	737	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0.37	3	387	運輸
CME GROUP INC	1	21	2,408	各種金融
CADENCE DESIGN SYS INC	0.78	10	1,168	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	0.58	6	674	消費者サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	0.62	11	1,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	0.84	6	729	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	0.38	27	3,001	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	0.42	4	548	保険
CISCO SYSTEMS INC	11	61	6,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	0.25	9	1,048	商業・専門サービス
CITRIX SYSTEMS INC	0.35	4	444	ソフトウェア・サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1	10	1,139	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	12	71	7,951	メディア・娯楽
COPART INC	0.58	7	845	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	1	48	5,352	食品・生活必需品小売り
AMAZON.COM INC	1	410	45,554	小売
DENTSPLY SIRONA INC	0.61	3	431	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	0.27	11	1,273	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	0.5	4	523	エネルギー
DISCOVERY INC - A	0.37	1	124	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	0.85	2	270	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	0.7	2	320	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	0.65	6	716	小売
EBAY INC	1	12	1,344	小売
ELECTRONIC ARTS INC	0.8	11	1,231	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	0.38	6	720	半導体・半導体製造装置
ETSY INC	0.36	6	725	小売
EXPEDIA GROUP INC	0.4	6	754	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	0.47	5	652	運輸
FACEBOOK INC-A	6	229	25,443	メディア・娯楽
AMGEN INC	1	38	4,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	1	8	917	資本財
F5 NETWORKS INC	0.17	3	353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIFTH THIRD BANCORP	1	7	843	銀行
ANALOG DEVICES INC	1	17	1,909	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	1	18	1,999	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	0.38	9	1,012	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	0.93	3	395	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	0.43	1	173	メディア・娯楽
GILEAD SCIENCES INC	3	23	2,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	43	582	64,692	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	2	35	3,913	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	0.38	3	392	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	0.21	3	383	ソフトウェア・サービス
HOLOGIC INC	0.71	4	512	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	0.23	3	409	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4	5	654	銀行

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価	額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
IPG PHOTONICS CORP	0.1	2	233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEXX LABORATORIES INC	0.24	14	1,638	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	0.41	19	2,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	0.52	4	497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	11	63	6,994	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	0.76	36	4,071	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	0.33	29	3,313	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	0.43	13	1,507	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	1	7	811	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	0.79	3	432	小売
LAM RESEARCH CORP	0.4	25	2,819	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	0.61	17	1,942	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1	23	2,589	ソフトウェア・サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.11	5	562	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	0.75	10	1,171	消費者サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	0.75	7	853	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	20	559	62,100	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	0.76	11	1,257	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	3	25	2,790	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	3	24	2,718	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	0.12	4	478	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	1	9	1,030	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	0.32	5	631	各種金融
NETAPP INC	0.62	5	557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	1	64	7,129	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS A	1	2	315	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	0.09	0.217	24	メディア・娯楽
NORTHERN TRUST CORP	0.58	6	735	各種金融
NORTONLIFELOCK INC	1	4	491	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	1	132	14,750	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.2	10	1,220	小売
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.27	6	755	運輸
PTC INC	0.29	3	443	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	0.97	8	952	資本財
PAYCHEX INC	0.89	9	1,030	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	3	95	10,641	ソフトウェア・サービス
PENN NATIONAL GAMING INC	0.42	3	356	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	0.74	1	143	銀行
POOL CORP	0.11	5	560	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	0.63	12	1,364	各種金融
QORVO INC	0.31	5	629	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	3	43	4,806	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	0.29	15	1,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	1	12	1,380	小売
SVB FINANCIAL GROUP	0.15	8	934	銀行
HENRY SCHEIN INC	0.39	2	325	ヘルスケア機器・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	0.46	8	907	半導体・半導体製造装置
STARBUCKS CORP	3	36	4,089	消費者サービス
SYNOPSIS INC	0.43	11	1,306	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	1	23	2,634	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0.33	5	641	メディア・娯楽

銘 柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
TERADYNE INC	0.46	6	666	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	2	146	16,222	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	2	48	5,379	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	0.33	5	662	小売
TRIMBLE INC	0.7	5	625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ULTA BEAUTY INC	0.16	5	624	小売
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	0.9	4	542	運輸
VERISIGN INC	0.28	6	713	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	0.46	7	884	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	0.72	13	1,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOMCBS INC - CLASS B	1	7	808	メディア・娯楽
VIATRIS INC	3	4	538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2	10	1,156	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	0.85	5	658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	0.3	3	413	消費者サービス
XILINX INC	0.68	9	1,009	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.15	7	849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	0.46	2	276	銀行
GARMIN LTD	0.43	6	682	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	0.77	15	1,741	半導体・半導体製造装置
IHS MARKIT LTD	1	12	1,333	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	0.36	8	929	保険
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	0.56	4	536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
合 計	株 数	金 額		
	銘 柄 数 < 比 率 >			
	808	9,792	1,086,909	
	477	—	<91.1%>	

(注) 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) 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	口数	当 期 末		比 率
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	千米ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	38	6	775	0.1
AMERICAN TOWER CORP	127	33	3,723	0.3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	39	8	917	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	40	4	528	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	121	23	2,631	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	79	11	1,315	0.1
DUKE REALTY CORP	105	5	557	0.0
EQUINIX INC	25	19	2,162	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	96	7	836	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18	5	611	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	37	6	672	0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	20	2	261	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	152	5	571	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	199	3	389	0.0
IRON MOUNTAIN INC	81	3	389	0.0
KIMCO REALTY CORP	121	2	277	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	32	5	602	0.1
PROLOGIS INC	207	25	2,786	0.2
PUBLIC STORAGE	43	12	1,440	0.1
REALTY INCOME CORP	104	6	773	0.1
REGENCY CENTERS CORP	44	2	315	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	31	9	1,086	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	92	12	1,333	0.1
UDR INC	83	4	457	0.0
VENTAS INC	105	6	675	0.1
VORNADO REALTY TRUST	28	1	148	0.0
WELLTOWER INC	116	9	1,074	0.1
WEYERHAEUSER CO	209	7	794	0.1
合 計	口 数 ・ 金 額	2,392	253	28,109
	銘柄 数 < 比 率 >	28	—	< 2.4% >

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	百万円	百万円
	SP500MIC2109	92	—

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,086,909	87.7
投資証券	28,109	2.3
コール・ローン等、その他	123,800	10.0
投資信託財産総額	1,238,818	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産 (1,220,464千円) の投資信託財産総額 (1,238,818千円) に対する比率は98.5%です。

(注) 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。1米ドル=110.99円。

○特定資産の価格等の調査

(2020年7月29日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	1,316,576,047	
コール・ローン等	87,553,567	
株式(評価額)	1,086,909,227	
投資証券(評価額)	28,109,517	
未収入金	78,312,773	
未収配当金	630,665	
差入委託証拠金	35,060,298	
(B) 負債	123,228,997	
未払金	77,758,948	
未払解約金	45,470,000	
未払利息	49	
(C) 純資産総額(A-B)	1,193,347,050	
元本	849,751,254	
次期繰越損益金	343,595,796	
(D) 受益権総口数	849,751,254口	
1万口当たり基準価額(C/D)	14,043円	

(注) 当ファンドの設定時元本額は200,800,000円、期中追加設定元本額は687,578,126円、期中一部解約元本額は38,626,872円です。

(注) 2021年6月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・Smart-i S&P500インデックス 849,751,254円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.4043円です。

○損益の状況 (2020年7月29日～2021年6月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	4,272,880	
受取配当金	4,280,934	
支払利息	△ 8,054	
(B) 有価証券売買損益	107,395,252	
売買益	117,334,854	
売買損	△ 9,939,602	
(C) 先物取引等取引損益	19,994,793	
取引益	21,574,236	
取引損	△ 1,579,443	
(D) 保管費用等	△ 1,385,875	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	130,277,050	
(F) 追加信託差損益金	227,331,874	
(G) 解約差損益金	△ 14,013,128	
(H) 計(E+F+G)	343,595,796	
次期繰越損益金(H)	343,595,796	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

○お知らせ

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)