

# Smart-i S&P500インデックス

## 運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2023年6月26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、2023年6月26日に第3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	Smart-i S&P500インデックス	・RM S&P500マザーファンドの受益証券
	RM S&P500マザーファンド	・米国の金融商品取引所に上場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
主な投資制限	Smart-i S&P500インデックス	・株式への実質投資割合には、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。
	RM S&P500マザーファンド	・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。
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 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 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
2期(2022年6月27日)	15,692	0	12.0	1,111,572.08	12.8	88.2	9.3	2.6	5,102
3期(2023年6月26日)	18,785	0	19.7	1,340,029.49	20.6	93.6	4.3	2.2	7,773

(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<sup>®</sup>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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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、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 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2022年6月27日	15,692	—	1,111,572.08	—	88.2	9.3	2.6
6月末	15,556	△ 0.9	1,102,012.05	△ 0.9	88.5	8.8	2.6
7月末	16,347	4.2	1,158,621.14	4.2	89.7	7.5	2.6
8月末	16,497	5.1	1,169,855.16	5.2	89.9	8.1	2.6
9月末	15,755	0.4	1,117,801.57	0.6	81.4	17.3	2.2
10月末	17,290	10.2	1,227,608.56	10.4	87.3	10.2	2.3
11月末	16,448	4.8	1,168,628.01	5.1	83.6	14.2	2.3
12月末	15,303	△ 2.5	1,087,921.77	△ 2.1	88.5	8.9	2.4
2023年1月末	15,706	0.1	1,117,642.04	0.5	86.2	11.2	2.4
2月末	16,283	3.8	1,159,454.51	4.3	86.9	11.2	2.3
3月末	16,242	3.5	1,157,130.51	4.1	91.7	5.6	2.3
4月末	16,666	6.2	1,187,629.96	6.8	95.8	1.7	2.4
5月末	17,681	12.7	1,260,780.20	13.4	94.9	3.0	2.3
(期 末)							
2023年6月26日	18,785	19.7	1,340,029.49	20.6	93.6	4.3	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

(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。

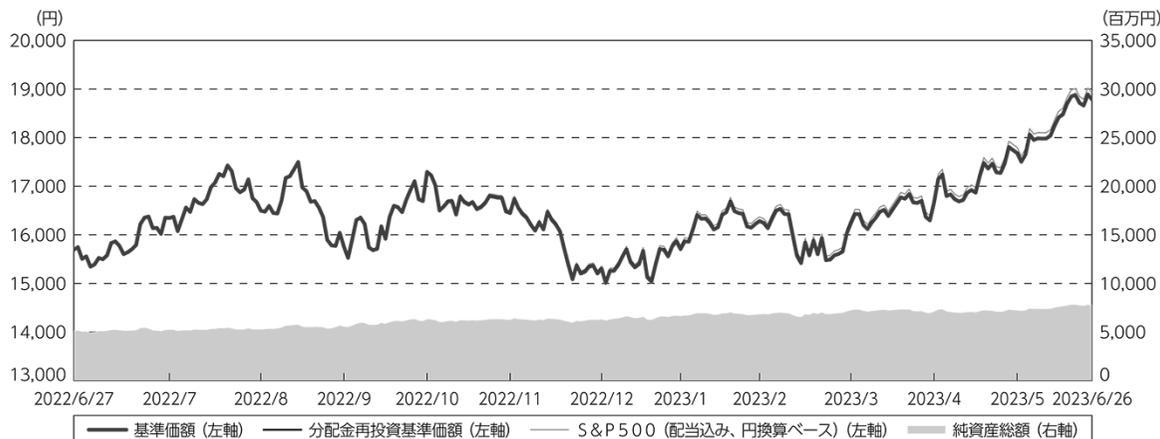
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2022年6月28日～2023年6月26日)

## 期中の基準価額等の推移



期首：15,692円

期末：18,785円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：19.7% (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) 分配金再投資基準価額およびS&P500(配当込み、円換算ベース)は、期首(2022年6月27日)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&P500(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&P500(配当込み、円換算ベース)は、S&P500(配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S&P500®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&P500は、S&P Globalの一部である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。

## ○基準価額の変動要因

ベンチマークであるS&amp;P500(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

## 投資環境

### 米国株式市況

米国の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、FRB（米連邦準備制度理事会）による大幅利上げや物価高によるコスト増加懸念などから、企業業績の先行き不透明感が強まり、米国の株式市場は不安定化する場面もみられました。期後半は、米国の一部の中堅銀行の破綻などをきっかけに米欧金融システム不安が強まり、米国の株式市場は下落する場面がみられました。その後、金融システム不安が小康状態入りするなか、FRBによる利上げ最終局面入りや米債務上限問題の解決などが投資家心理の改善に繋がり、米国の株式市場は上昇しました。

### 為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円安となりました。

米ドルに対して、米国ではインフレ抑制を目指すFRBにより、大幅利上げが急速に進められた一方、国内では日銀による大規模な金融緩和策が維持されました。内外金利差拡大などを背景に円安米ドル高が急速に進行し、一時1米ドル=151円を付ける場面もみられました。

## 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。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+19.7%となり、ベンチマークの+20.6%を0.8%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

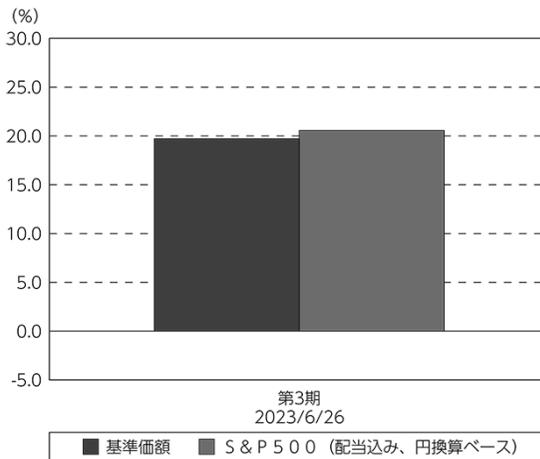
### (マイナス要因)

- ・ 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3期
	2022年6月28日～ 2023年6月26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	8,784

(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

(2022年6月28日～2023年6月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	39	0.241	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.110)	ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(18)	(0.110)	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 ）	(4)	(0.022)	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	2	0.013	(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 ）	(1)	(0.006)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.006)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(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)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	8	0.046	(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 ）	(6)	(0.039)	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)	(0.007)	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)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	49	0.300	
期中の平均基準価額は、16,314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。

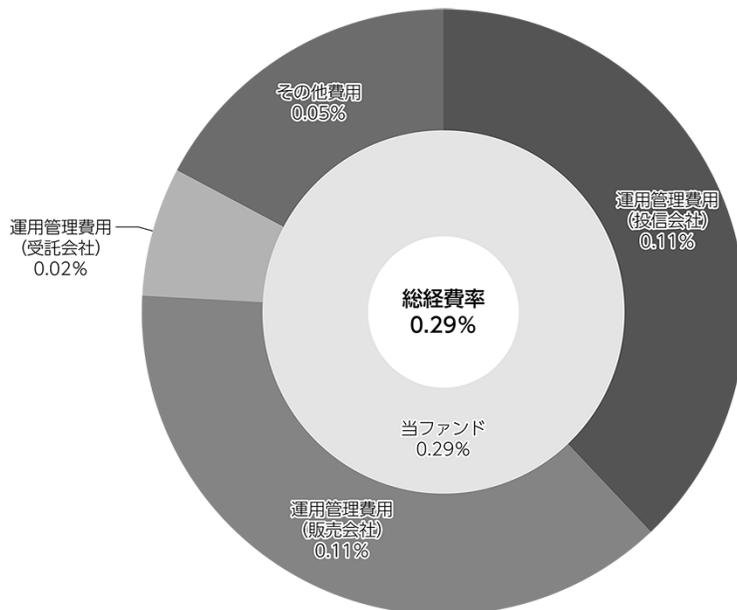
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.29%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

(2022年6月28日～2023年6月26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	1,991,641 千口	3,234,770 千円	1,124,174 千口	1,876,860 千円

## ○株式売買比率

(2022年6月28日～2023年6月26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	2,421,059千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,549,983千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.43	

(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

(2022年6月28日～2023年6月26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 (2022年6月28日～2023年6月26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

(2022年6月28日～2023年6月26日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2023年6月26日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
RM S&P500マザーファンド	千口 3,232,725	千口 4,100,192	千円 7,763,305

## ○投資信託財産の構成

(2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM S&P500マザーファンド	千円 7,763,305	% 99.2
コール・ローン等、その他	62,183	0.8
投資信託財産総額	7,825,488	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&amp;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(7,734,769千円)の投資信託財産総額(7,764,020千円)に対する比率は99.6%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=143.49円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2022年6月28日～2023年6月26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 (2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,825,488,067
コール・ローン等	62,073,016
RM S&P500マザーファンド(評価額)	7,763,305,051
未収入金	110,000
(B) 負債	51,716,466
未払解約金	43,121,258
未払信託報酬	8,363,239
未払利息	168
その他未払費用	231,801
(C) 純資産総額(A-B)	7,773,771,601
元本	4,138,303,854
次期繰越損益金	3,635,467,747
(D) 受益権総口数	4,138,303,854口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,785円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,251,697,508円、期中追加設定元本額は3,711,470,788円、期中一部解約元本額は2,824,864,442円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.8785円です。

## ○損益の状況 (2022年6月28日～2023年6月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 24,924
支払利息	△ 24,924
(B) 有価証券売買損益	1,097,677,248
売買益	1,307,284,970
売買損	△ 209,607,722
(C) 信託報酬等	△ 15,696,022
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,081,956,302
(E) 前期繰越損益金	71,219,087
(F) 追加信託差損益金	2,482,292,358
(配当等相当額)	( 623,357,353)
(売買損益相当額)	( 1,858,935,005)
(G) 計(D+E+F)	3,635,467,747
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,635,467,747
追加信託差損益金	2,482,292,358
(配当等相当額)	( 630,960,641)
(売買損益相当額)	( 1,851,331,717)
分配準備積立金	1,153,175,389

(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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(96,182,701円)、費用控除後の有価証券等損益額(985,773,601円)、信託約款に規定する収益調整金(2,482,292,358円)および分配準備積立金(71,219,087円)より分配対象収益は3,635,467,747円(1万口当たり8,784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

該当事項はございません。

# RM S & P 5 0 0 マザーファンド

## 運用報告書

第3期（決算日 2023年6月26日）  
（2022年6月28日～2023年6月26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 &amp; P 5 0 0（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 &amp; P 5 0 0（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 &amp; P 5 0 0（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、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも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 &amp; P 5 0 0（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)		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
2期(2022年6月27日)	15,772	12.3	1,111,572.08	12.8	88.3	9.3	2.6	5,098
3期(2023年6月26日)	18,934	20.0	1,340,029.49	20.6	93.8	4.3	2.2	7,763

(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<sup>®</sup>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（「SPDJJI」）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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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SPDJJI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、SPDJJI、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 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2022年6月27日	15,772	—	1,111,572.08	—	88.3	9.3	2.6
6月末	15,636	△ 0.9	1,102,012.05	△ 0.9	88.6	8.8	2.6
7月末	16,435	4.2	1,158,621.14	4.2	89.8	7.5	2.6
8月末	16,590	5.2	1,169,855.16	5.2	90.1	8.2	2.6
9月末	15,846	0.5	1,117,801.57	0.6	81.4	17.3	2.2
10月末	17,397	10.3	1,227,608.56	10.4	87.4	10.2	2.3
11月末	16,552	4.9	1,168,628.01	5.1	83.7	14.3	2.3
12月末	15,401	△ 2.4	1,087,921.77	△ 2.1	88.6	8.9	2.4
2023年1月末	15,811	0.2	1,117,642.04	0.5	86.3	11.2	2.4
2月末	16,396	4.0	1,159,454.51	4.3	87.0	11.3	2.3
3月末	16,358	3.7	1,157,130.51	4.1	91.8	5.6	2.3
4月末	16,788	6.4	1,187,629.96	6.8	96.0	1.7	2.4
5月末	17,817	13.0	1,260,780.20	13.4	95.0	3.0	2.3
(期 末)							
2023年6月26日	18,934	20.0	1,340,029.49	20.6	93.8	4.3	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2022年6月28日～2023年6月26日)

## 期中の基準価額等の推移

## ○基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS & P 5 0 0（配当込み、円換算ベース）の動きを反映して、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首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、前期末と比較して上昇しました。期前半は、FRB（米連邦準備制度理事会）による大幅利上げや物価高によるコスト増加懸念などから、企業業績の先行き不透明感が強まり、米国の株式市場は不安定化する場面もみられました。期後半は、米国の一部の中堅銀行の破綻などをきっかけに米欧金融システム不安が強まり、米国の株式市場は下落する場面がみられました。その後、金融システム不安が小康状態入りするなか、FRBによる利上げ最終局面入りや米債務上限問題の解決などが投資家心理の改善に繋がり、米国の株式市場は上昇しました。

## 為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円安となりました。

米ドルに対して、米国ではインフレ抑制を目指すFRBにより、大幅利上げが急速に進められた一方、国内では日銀による大規模な金融緩和策が維持されました。内外金利差拡大などを背景に円安米ドル高が急速に進行し、一時1米ドル＝151円を付ける場面もみられました。

## 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。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っていません。

## 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+20.0%となり、ベンチマークの+20.6%を0.5%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

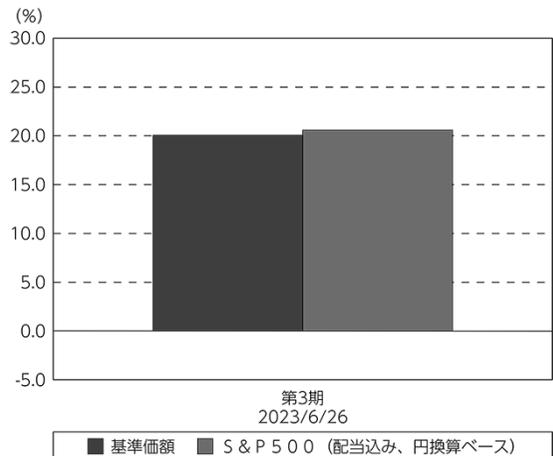
（マイナス要因）

- ・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

(2022年6月28日～2023年6月26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)	2 (1) (0) (1)	0.013 (0.006) (0.000) (0.006)	(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)	0.000 (0.000) (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)	6 (6) (0)	0.039 (0.039) (0.000)	(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	8	0.052	
期中の平均基準価額は、16,418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

(2022年6月28日～2023年6月26日)

## 株式

外 国	買 付 株 数	金 額	売 付	
			株 数	金 額
アメリカ	百株 1,408 ( 160)	千米ドル 14,619 ( 239)	百株 270 ( 8)	千米ドル 2,993 ( 242)

(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 5,659	百万円 5,838	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

(2022年6月28日～2023年6月26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	2,421,059千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,549,983千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.43

(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

(2022年6月28日～2023年6月26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 (2022年6月28日～2023年6月26日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2023年6月26日現在)

## 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	千米ドル	千円	
AES CORP	5	9	18	2,691	公益事業
AT&T INC	74	101	157	22,563	電気通信サービス
ABBVIE INC	18	25	342	49,167	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADVANCE AUTO PARTS INC	0.53	0.76	4	716	一般消費財・サービス流通・小売り
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3	4	53	7,711	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALASKA AIR GROUP INC	0.82	1	9	1,356	運輸
ALTRIA GROUP INC	18	25	109	15,744	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	1	2	46	6,678	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1	1	45	6,595	金融サービス
ARISTA NETWORKS INC	2	3	51	7,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	0.6	0.6	7	1,065	保険
BAKER HUGHES COMPANY	9	15	45	6,535	エネルギー
BATH & BODY WORKS INC	2	3	13	1,879	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.18	0.3	10	1,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	1	2	144	20,699	金融サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15	20	109	15,712	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	6	7	52	7,581	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22	30	196	28,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1	1	25	3,650	商業・専門サービス
BROWN & BROWN INC	2	2	18	2,726	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1	2	14	2,099	食品・飲料・タバコ
CBRE GROUP INC - A	3	4	32	4,620	不動産管理・開発
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2	2	19	2,743	素材
CIGNA GROUP/THE	3	4	116	16,682	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	3	4	23	3,362	公益事業
CSX CORP	22	29	96	13,849	運輸
ALBEMARLE CORP	1	1	39	5,686	素材
CVS HEALTH CORP	13	18	126	18,186	ヘルスケア機器・サービス
COTERRA ENERGY INC	8	10	25	3,682	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	2	3	14	2,047	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4	5	56	8,168	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	2	3	36	5,238	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	1	2	21	3,018	一般消費財・サービス流通・小売り
CARNIVAL CORP	6	12	19	2,797	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	8	12	60	8,749	資本財
CATALENT INC	1	2	12	1,770	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	5	7	173	24,826	資本財
CELANESE CORP	0.93	1	15	2,198	素材
CENTENE CORP	6	7	51	7,366	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	6	8	24	3,533	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1	1	11	1,711	商業・専門サービス
CHARLES RIVER LABORATORIES	0.42	0.62	12	1,848	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEVRON CORP	20	24	375	53,815	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.3	0.39	79	11,436	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	2	3	36	5,198	家庭用品・パーソナル用品
CITIGROUP INC	20	27	126	18,212	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5	6	17	2,485	銀行
ALLIANT ENERGY CORP	2	3	20	2,893	公益事業
CLOROX COMPANY	1	1	26	3,763	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	40	55	339	48,649	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	8	11	91	13,122	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	2	4	43	6,248	保険
COMERICA INC	1	1	6	961	銀行
CONAGRA BRANDS INC	4	7	25	3,605	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	13	17	174	25,024	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	3	4	44	6,379	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1	2	55	7,894	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	0.53	0.68	25	3,637	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	8	11	39	5,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	7	9	57	8,179	素材
CUMMINS INC	1	2	49	7,157	資本財
DR HORTON INC	3	4	53	7,670	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	2	2	32	4,687	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	2	2	6	986	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	6	9	222	31,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMEREN CORPORATION	2	3	32	4,592	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	1	1	27	3,980	消費者サービス
DAVITA INC	0.55	0.55	5	771	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	2	3	154	22,227	資本財
DELTA AIR LINES INC	6	9	42	6,088	運輸
DEVON ENERGY CORP	6	8	41	5,913	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	19	25	228	32,842	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2	3	40	5,813	金融サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	5	7	59	8,577	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	0.34	0.62	21	3,075	保険
DOLLAR GENERAL CORP	2	3	53	7,662	生活必需品流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	8	11	60	8,625	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	0.4	0.55	17	2,500	消費者サービス
AMERICAN EXPRESS CO	6	8	141	20,330	金融サービス
DOVER CORP	1	1	27	3,888	資本財
DOW INC	7	9	50	7,244	素材
DUKE ENERGY CORP	8	10	97	13,942	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	5	6	45	6,594	素材
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8	10	57	8,287	保険
EOG RESOURCES INC	6	8	88	12,706	エネルギー
EQT CORP	—	4	17	2,518	エネルギー
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1	3	33	4,791	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	1	1	13	1,893	素材
ECOLAB INC	2	3	61	8,870	素材
BUNGE LTD	—	2	18	2,698	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	4	5	35	5,085	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6	8	78	11,316	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	18	24	268	38,481	ヘルスケア機器・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	6	8	69	9,975	資本財
ENTERGY CORP	2	3	30	4,348	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	0.62	0.78	16	2,395	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	1	1	42	6,043	商業・専門サービス

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	千米ドル	千円	
EVERGY INC	1	3	20	2,919	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	3	5	37	5,322	公益事業
EXELON CORP	10	13	55	7,894	公益事業
EXXON MOBIL CORP	43	57	589	84,648	エネルギー
FMC CORP	1	1	20	2,988	素材
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.32	0.6	23	3,392	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	—	0.39	30	4,342	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1	2	42	6,149	公益事業
AMETEK INC	2	3	54	7,837	資本財
FEDEX CORP	2	3	75	10,801	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6	9	47	6,834	金融サービス
AMPHENOL CORP-CL A	6	8	66	9,550	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1	—	—	—	銀行
FISERV INC	—	8	108	15,508	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	6	8	32	4,595	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	0.69	1	27	3,902	金融サービス
FORD MOTOR CO	41	55	77	11,140	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	3	5	38	5,513	資本財
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	1	—	—	—	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	3	4	11	1,637	金融サービス
FREEMPORT-MCMORAN INC	15	20	76	11,044	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2	2	63	9,115	保険
GARTNER INC	0.86	1	40	5,871	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	2	3	152	21,908	ヘルスケア機器・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	0.69	0.69	8	1,277	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	2	3	67	9,630	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	11	15	160	22,992	資本財
GENERAL MILLS INC	6	8	67	9,684	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	15	19	71	10,237	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	1	1	30	4,444	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBAL PAYMENTS INC	2	3	36	5,204	金融サービス
GLOBE LIFE INC	1	1	10	1,525	保険
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3	4	151	21,675	金融サービス
WW GRAINGER INC	0.45	0.62	45	6,564	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5	7	55	8,023	食品・飲料・タバコ
HCA HEALTHCARE INC	2	3	88	12,716	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	11	13	39	5,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	9	13	42	6,094	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3	4	31	4,459	保険
HERSHEY CO/THE	1	2	53	7,658	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	2	3	51	7,327	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	13	17	29	4,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2	3	50	7,259	消費者サービス
HOME DEPOT INC	10	14	436	62,629	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7	9	189	27,217	資本財
HORMEL FOODS CORP	3	4	16	2,363	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	3	5	26	3,797	資本財
HUMANA INC	1	1	78	11,326	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	0.34	0.55	11	1,712	資本財
IDEX CORP	0.83	1	20	3,000	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	2	3	94	13,591	資本財

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	千米ドル	千円	
INGERSOLL-RAND INC	4	6	39	5,646	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5	7	87	12,545	金融サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9	12	166	23,846	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	3	29	4,255	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	3	4	14	2,019	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3	6	23	3,346	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	2	2	60	8,661	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	30	41	581	83,380	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1	—	—	—	商業・専門サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	—	1	20	2,924	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	27	37	617	88,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	2	4	13	1,974	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLOGG CO	2	3	23	3,328	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	7	12	40	5,807	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	9	12	12	1,738	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1	2	43	6,211	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	3	4	65	9,394	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	20	30	49	7,032	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	1	1	22	3,168	公益事業
KROGER CO	6	9	45	6,481	生活必需品流通・小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2	2	51	7,324	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0.99	1	28	4,077	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1	2	25	3,686	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	2	5	29	4,167	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2	3	62	9,033	家庭用品・パーソナル用品
LEIDOS HOLDINGS INC	1	2	18	2,589	商業・専門サービス
LENNAR CORP-A	2	3	44	6,317	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	8	11	515	74,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	0.21	0.26	63	9,042	一般消費財・サービス流通・小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	1	1	4	607	保険
AVERY DENNISON CORP	0.71	1	21	3,058	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1	2	19	2,795	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	2	3	147	21,224	資本財
LOEWS CORP	1	2	14	2,043	保険
LOWE'S COS INC	6	8	184	26,465	一般消費財・サービス流通・小売り
LUMEN TECHNOLOGIES INC	9	—	—	—	電気通信サービス
M & T BANK CORP	1	2	30	4,405	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3	4	18	2,701	消費者サービス
MSCI INC	0.86	1	52	7,475	金融サービス
MARATHON OIL CORP	6	8	17	2,576	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	5	5	65	9,419	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	5	7	128	18,507	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.67	0.86	38	5,459	素材
MASCO CORP	2	3	17	2,473	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	8	12	456	65,507	金融サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2	3	32	4,656	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	7	10	302	43,387	消費者サービス
MCKESSON CORP	1	1	80	11,513	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	3	4	24	3,491	素材
MERCK & CO. INC.	26	36	414	59,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	7	9	49	7,086	保険

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	千米ドル	千円	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.24	0.34	43	6,284	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	74	99	276	39,627	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.57	0.57	5	800	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	0.64	0.8	23	3,305	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2	2	19	2,782	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	1	2	74	10,695	金融サービス
MORGAN STANLEY	14	18	154	22,210	金融サービス
MOSAIC CO/THE	3	5	18	2,611	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1	2	65	9,354	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	2	3	12	1,777	公益事業
NVR INC	0.03	0.05	30	4,419	耐久消費財・アパレル
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	7	9	42	6,122	金融サービス
NEWELL RUBBERMAID INC	3	3	3	448	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	8	11	46	6,610	素材
NEXTERA ENERGY INC	20	29	216	31,076	公益事業
NIKE INC -CL B	13	17	194	27,909	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	3	5	13	1,963	公益事業
NORFOLK SOUTHERN CORP	2	3	69	9,916	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	1	2	92	13,225	資本財
NUCOR CORP	2	3	54	7,767	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9	10	57	8,198	エネルギー
OMNICOM GROUP	1	3	29	4,184	メディア・娯楽
ONEOK INC	4	6	39	5,628	エネルギー
ORACLE CORP	16	21	259	37,213	ソフトウェア・サービス
ORGANON & CO	2	2	4	609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OTIS WORLDWIDE CORP	4	5	50	7,175	資本財
P G & E CORP	—	24	41	5,959	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4	5	70	10,044	銀行
PPG INDUSTRIES INC	2	3	45	6,516	素材
PPL CORP	7	10	26	3,819	公益事業
PVH CORP	0.47	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PACKAGING CORP OF AMERICA	1	1	18	2,680	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	—	4	106	15,296	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	1	1	66	9,559	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	0.41	0.67	20	2,943	商業・専門サービス
PEPSICO INC	14	19	364	52,357	食品・飲料・タバコ
REVVITY INC	1	1	20	2,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	58	79	306	43,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	5	7	35	5,028	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16	22	212	30,427	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	5	6	59	8,513	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	1	1	14	2,029	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2	3	66	9,520	エネルギー
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2	3	25	3,708	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	25	33	499	71,682	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	6	8	110	15,793	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3	5	47	6,813	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5	6	42	6,053	公益事業
PULTEGROUP INC	2	3	23	3,392	耐久消費財・アパレル
QUANTA SERVICES INC	1	2	40	5,864	資本財
QUEST DIAGNOSTICS INC	1	1	24	3,492	ヘルスケア機器・サービス

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	千米ドル	千円	
RALPH LAUREN CORP	0.51	0.51	6	875	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2	2	25	3,667	金融サービス
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	15	20	201	28,923	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	3	4	103	14,798	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	9	12	21	3,132	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	2	3	46	6,602	商業・専門サービス
RESMED INC	1	2	48	6,919	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	0.93	1	9	1,416	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	1	1	54	7,866	資本財
ROLLINS INC	1	2	12	1,757	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	1	69	9,918	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	3	4	182	26,157	金融サービス
SALESFORCE INC	10	14	299	42,927	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	14	20	93	13,383	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	15	21	114	16,441	金融サービス
SEALED AIR CORP	1	1	6	862	素材
SEMPRA ENERGY	3	4	62	9,034	公益事業
SERVICENOW INC	2	2	156	22,439	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2	3	81	11,733	素材
SMITH (A. O.) CORP	1	1	9	1,415	資本財
JM SMUCKER CO/THE	0.94	1	24	3,558	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	0.45	0.67	18	2,630	資本財
SOUTHERN CO/THE	11	15	107	15,486	公益事業
WR BERKLEY CORP	2	3	18	2,697	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	6	8	27	4,006	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	18	25	853	122,475	金融サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	1	2	20	2,897	資本財
STATE STREET CORP	3	4	35	5,058	金融サービス
STRYKER CORP	3	4	142	20,431	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	1	3	23	3,440	一般消費財・サービス流通・小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	4	5	19	2,805	金融サービス
SYSCO CORP	5	7	55	7,932	生活必需品流通・小売り
TJX COMPANIES INC	12	16	134	19,228	一般消費財・サービス流通・小売り
TAPESTRY INC	2	3	14	2,148	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	4	6	85	12,257	生活必需品流通・小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	3	24	3,491	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.5	0.65	25	3,722	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	0.39	0.58	13	1,974	ヘルスケア機器・サービス
TEXTRON INC	1	3	21	3,017	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4	5	293	42,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	5	7	78	11,200	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	0.55	0.73	62	8,906	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	2	3	56	8,126	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	13	18	55	7,950	銀行
TWITTER INC	8	—	—	—	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.35	0.64	25	3,645	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	3	4	19	2,855	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	14	19	63	9,048	銀行
UNION PACIFIC CORP	6	8	172	24,810	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7	10	174	25,068	運輸
UNITED RENTALS INC	0.77	1	42	6,150	資本財

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	千米ドル	千円	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9	13	635	91,168	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	0.61	1	15	2,172	ヘルスケア機器・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2	3	89	12,856	素材
VF CORP	3	5	9	1,425	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	4	5	60	8,624	エネルギー
VERIZON COMMUNICATIONS INC	43	59	212	30,556	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	17	23	531	76,251	金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	1	2	43	6,307	素材
WEC ENERGY GROUP INC	3	4	38	5,461	公益事業
WABTEC CORP	1	2	25	3,655	資本財
WALMART INC	14	19	309	44,435	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	4	5	86	12,426	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.65	0.81	21	3,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & CO	39	54	220	31,647	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.79	1	41	5,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTROCK CO	2	2	7	1,078	素材
WHIRLPOOL CORP	0.53	0.83	11	1,674	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	12	17	52	7,466	エネルギー
BOEING CO/THE	5	7	163	23,491	資本財
XCEL ENERGY INC	5	7	47	6,745	公益事業
XYLEM INC	1	3	38	5,512	資本財
YUM! BRANDS INC	3	3	53	7,646	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2	2	40	5,847	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	4	6	111	15,993	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	2	3	14	2,076	自動車・自動車部品
INVESCO LTD	2	4	7	1,038	金融サービス
CHUBB LTD	4	5	113	16,331	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2	3	34	4,968	素材
ACCENTURE PLC-CL A	6	8	267	38,368	ソフトウェア・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	3	4	58	8,403	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	2	4	39	5,730	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	4	5	109	15,653	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4	4	8	1,283	消費者サービス
ALLEGION PLC	0.96	1	15	2,270	資本財
STERIS PLC	1	1	28	4,113	ヘルスケア機器・サービス
AMCOR PLC	16	20	20	2,921	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2	3	59	8,574	資本財
AON PLC	2	2	96	13,839	保険
PENTAIR PLC	1	2	15	2,208	資本財
LINDE PLC	—	7	259	37,223	素材
MEDTRONIC PLC	14	18	165	23,724	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	3	—	—	—	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7	9	62	8,980	資本財
LINDE PLC	5	—	—	—	素材
ABIOMED INC	0.38	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	8	10	82	11,787	メディア・娯楽
ADOBE INC	4	6	315	45,278	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	16	22	252	36,195	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1	2	21	3,090	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.79	1	36	5,237	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL C	2	72	896	128,648	メディア・娯楽

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	千米ドル	千円	
ALPHABET INC-CL A	3	84	1,039	149,090	メディア・娯楽
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	7	10	16	2,396	運輸
ANSYS INC	0.93	1	42	6,098	ソフトウェア・サービス
APA CORP	3	4	14	2,085	エネルギー
AXON ENTERPRISE INC	—	1	18	2,707	資本財
BIOGEN INC	1	2	58	8,328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	0.33	1	14	2,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	0.43	0.52	136	19,578	消費者サービス
BROADCOM INC	4	5	489	70,192	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	0.9	1	22	3,223	金融サービス
CDW CORP/DE	1	2	37	5,320	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1	1	14	2,037	運輸
CME GROUP INC	3	5	92	13,216	金融サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	2	3	87	12,544	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	1	3	13	1,985	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1	1	47	6,882	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1	2	21	3,035	保険
CISCO SYSTEMS INC	43	58	293	42,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	0.93	1	58	8,378	商業・専門サービス
CITRIX SYSTEMS INC	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5	7	48	6,899	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	46	59	239	34,394	メディア・娯楽
CONSTELLATION ENERGY	3	5	45	6,482	公益事業
COPART INC	2	5	53	7,640	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	4	6	330	47,483	生活必需品流通・小売り
COSTAR GROUP INC	—	6	53	7,742	商業・専門サービス
AMAZON.COM INC	91	127	1,644	235,977	一般消費財・サービス流通・小売り
DENTSPLY SIRONA INC	1	2	10	1,478	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	4	5	69	9,912	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	1	2	35	5,038	エネルギー
DISH NETWORK CORP-A	1	—	—	—	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	2	2	41	5,916	生活必需品流通・小売り
ARCH CAPITAL GROUP LTD	—	5	41	5,953	保険
EBAY INC	5	7	32	4,648	一般消費財・サービス流通・小売り
ELECTRONIC ARTS INC	2	3	44	6,362	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	1	2	32	4,713	半導体・半導体製造装置
ETSY INC	1	1	17	2,475	一般消費財・サービス流通・小売り
EXPEDIA GROUP INC	1	2	22	3,217	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	1	2	22	3,284	運輸
META PLATFORMS INC-CLASS A	23	31	916	131,456	メディア・娯楽
AMGEN INC	5	7	172	24,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	6	8	49	7,110	資本財
F5 INC	0.51	0.75	10	1,554	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIFTH THIRD BANCORP	7	10	27	3,961	銀行
ANALOG DEVICES INC	5	7	133	19,183	半導体・半導体製造装置
FIRST SOLAR INC	—	1	24	3,574	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	6	—	—	—	金融サービス
FORTINET INC	7	9	65	9,378	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	3	4	15	2,170	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	1	1	5	760	メディア・娯楽
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES I	—	5	44	6,356	ヘルスケア機器・サービス

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	千米ドル	千円	
GILEAD SCIENCES INC	13	17	137	19,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	160	211	3,945	566,083	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	9	11	162	23,371	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	1	1	9	1,429	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	0.63	1	18	2,639	金融サービス
HOLOGIC INC	2	3	27	3,985	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	0.92	1	20	2,940	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	15	19	20	2,912	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	0.89	1	57	8,189	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	1	2	48	6,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	1	2	17	2,571	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	—	1	30	4,419	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	42	58	194	27,852	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	2	3	180	25,917	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	3	4	162	23,385	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	1	1	89	12,851	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	7	12	43	6,265	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	2	3	21	3,053	一般消費財・サービス流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	1	1	116	16,684	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	2	3	61	8,811	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4	5	125	17,979	商業・専門サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.32	0.51	13	1,924	金融サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2	3	64	9,323	消費者サービス
MATCH GROUP INC	3	4	16	2,402	メディア・娯楽
MICROSOFT CORP	78	106	3,559	510,765	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	8	67	9,750	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	11	15	100	14,472	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	3	4	55	7,940	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	14	19	141	20,275	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	0.46	0.68	34	4,937	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	3	10	63	9,075	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	1	4	22	3,276	金融サービス
NETAPP INC	2	3	22	3,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	4	6	268	38,513	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS A	3	3	6	944	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	0.74	0.74	1	201	メディア・娯楽
NORDSON CORP	0.46	0.68	16	2,300	資本財
NORTHERN TRUST CORP	2	2	20	2,894	金融サービス
GEN DIGITAL INC	4	7	12	1,834	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	26	35	1,494	214,463	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.7	0.88	81	11,677	一般消費財・サービス流通・小売り
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.99	1	44	6,420	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	4	6	57	8,238	半導体・半導体製造装置
PTC INC	1	1	23	3,334	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	3	7	57	8,216	資本財
PAYCHEX INC	3	4	47	6,858	商業・専門サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	12	16	107	15,368	金融サービス
PENN ENTERTAINMENT INC	1	—	—	—	消費者サービス
POOL CORP	0.44	0.6	21	3,033	一般消費財・サービス流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	2	3	36	5,263	金融サービス
QORVO INC	0.92	1	13	1,941	半導体・半導体製造装置

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	千米ドル	千円		
QUALCOMM INC	11	15	179	25,797	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1	1	119	17,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROSS STORES INC	3	4	52	7,468	一般消費財・サービス流通・小売り	
SVB FINANCIAL GROUP	0.62	—	—	—	銀行	
HENRY SCHEIN INC	1	1	14	2,117	ヘルスケア機器・サービス	
SIGNATURE BANK	0.5	—	—	—	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1	2	22	3,205	半導体・半導体製造装置	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	0.59	0.76	18	2,657	半導体・半導体製造装置	
STARBUCKS CORP	12	16	160	23,042	消費者サービス	
STEEL DYNAMICS INC	—	2	26	3,830	素材	
SYNOPSYS INC	1	2	90	12,943	ソフトウェア・サービス	
T-MOBILE US INC	6	8	112	16,120	電気通信サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1	2	31	4,559	メディア・娯楽	
TERADYNE INC	1	2	25	3,606	半導体・半導体製造装置	
TESLA INC	8	38	989	141,976	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9	12	216	31,013	半導体・半導体製造装置	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1	1	31	4,518	一般消費財・サービス流通・小売り	
TRIMBLE INC	2	3	17	2,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ULTA BEAUTY INC	0.56	0.77	34	5,010	一般消費財・サービス流通・小売り	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2	5	26	3,837	運輸	
VERISIGN INC	1	1	27	4,001	ソフトウェア・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	1	2	48	7,017	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2	3	126	18,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARAMOUNT GLOBAL	6	7	12	1,736	メディア・娯楽	
VIATRIS INC	13	18	18	2,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7	10	33	4,843	生活必需品流通・小売り	
WARNER BROS DISCOVERY INC	23	33	39	5,709	メディア・娯楽	
WESTERN DIGITAL CORP	3	5	19	2,737	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WYNN RESORTS LTD	1	1	16	2,392	消費者サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.56	0.81	21	3,072	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZIONS BANCORPORATION	1	1	3	496	銀行	
GARMIN LTD	1	2	22	3,191	耐久消費財・アパレル	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2	3	68	9,882	半導体・半導体製造装置	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1	1	38	5,505	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	1	2	14	2,137	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
合 計	株 数	金 額	3,058	4,348	50,735	7,280,031
	銘柄 数	< 比 率 >	473	474	—	< 93.8% >

(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	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	159	245	26	3,834	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	487	658	122	17,564	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	149	216	39	5,621	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	120	182	9	1,344	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	115	174	18	2,643	0.0	
CROWN CASTLE INC	455	606	66	9,516	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	301	442	46	6,605	0.1	
DUKE REALTY CORP	411	—	—	—	—	
EQUINIX INC	96	130	96	13,917	0.2	
EQUITY RESIDENTIAL	364	529	32	4,733	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	70	91	20	2,872	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	143	208	29	4,236	0.1	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	77	77	6	995	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	454	864	16	2,389	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	603	913	14	2,127	0.0	
INVITATION HOMES INC	—	804	26	3,777	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	314	405	21	3,136	0.0	
KIMCO REALTY CORP	521	789	14	2,085	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	124	160	23	3,343	0.0	
PROLOGIS INC	777	1,307	152	21,923	0.3	
PUBLIC STORAGE	161	221	62	8,992	0.1	
REALTY INCOME CORP	636	976	57	8,229	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	130	216	12	1,797	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	114	166	37	5,313	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	348	454	48	7,018	0.1	
UDR INC	324	489	19	2,822	0.0	
VENTAS INC	427	554	24	3,535	0.0	
VICI PROPERTIES INC	1,022	1,390	42	6,109	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	134	—	—	—	—	
WELLTOWER INC	480	721	54	7,891	0.1	
WEYERHAEUSER CO	792	1,135	34	4,952	0.1	
合 計	口 数 ・ 金 額	10,308	15,122	1,180	169,332	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	29	—	<2.2%>	

(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	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	SP500MIN2309	220	—
		SP500MIC2309	113	—
			百万円	百万円

(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

(2023年6月26日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
株式	7,280,031	93.8
投資証券	169,332	2.2
コール・ローン等、その他	314,657	4.0
投資信託財産総額	7,764,020	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 (7,734,769千円) の投資信託財産総額 (7,764,020千円) に対する比率は99.6%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=143.49円。

## ○特定資産の価格等の調査

(2022年6月28日～2023年6月26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 (2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,813,511,887
コール・ローン等	214,821,378
株式(評価額)	7,280,031,390
投資証券(評価額)	169,332,409
未収入金	49,724,377
未収配当金	7,441,830
差入委託証拠金	92,160,503
(B) 負債	50,306,291
未払金	50,196,214
未払解約金	110,000
未払利息	77
(C) 純資産総額(A-B)	7,763,205,596
元本	4,100,192,802
次期繰越損益金	3,663,012,794
(D) 受益権総口数	4,100,192,802口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,934円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,232,725,132円、期中追加設定元本額は1,991,641,894円、期中一部解約元本額は1,124,174,224円です。

(注) 2023年6月26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 4,100,192,802円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.8934円です。

## ○損益の状況 (2022年6月28日～2023年6月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	100,952,083
受取配当金	93,776,347
受取利息	3,703,140
その他収益金	3,504,519
支払利息	△ 31,923
(B) 有価証券売買損益	1,159,770,987
売買益	1,444,090,216
売買損	△ 284,319,229
(C) 先物取引等取引損益	48,392,515
取引益	150,823,487
取引損	△ 102,430,972
(D) 保管費用等	△ 2,453,262
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,306,662,323
(F) 前期繰越損益金	1,865,908,141
(G) 追加信託差損益金	1,243,128,106
(H) 解約差損益金	△ 752,685,776
(I) 計(E+F+G+H)	3,663,012,794
次期繰越損益金(I)	3,663,012,794

(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(G)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(H)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

該当事項はございません。