

## SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド （円ヘッジなし）

第2期（決算日 2023年10月2日）

### ■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	
信託期間	2021年9月30日から2031年9月30日まで	
運用方針	<p>①SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド（以下「親投資信託」といいます。）受益証券を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>②親投資信託の組入比率は、原則として高位を基本とします。</p> <p>③親投資信託における株式等の運用指図に関する権限をアルジェブリス・インベストメンツ（US）インクに委託します。</p> <p>④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p>	
主要投資対象	<p>SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）</p> <p>SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド</p>	<p>SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド受益証券</p> <p>日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式</p>
主な組入制限	<p>SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）</p> <p>SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド</p>	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）」は、このたび第2期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率			株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税金	分配	騰落			
(設定日)	円	円	%	%	%	百万円	
2021年9月30日	10,000	—	—	—	—	81	
1期(2022年9月30日)	11,288	0	12.9	76.1	0.7	577	
2期(2023年10月2日)	14,839	0	31.5	79.3	0.9	342	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり（以下同じ）。

(注3) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		株式組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落	率		
(期首)	円	%	%	%	%
2022年9月30日	11,288	—	—	76.1	0.7
10月末	12,696	12.5	77.4	0.9	—
11月末	12,625	11.8	72.2	0.5	—
12月末	12,083	7.0	80.0	—	—
2023年1月末	13,080	15.9	83.2	—	—
2月末	13,821	22.4	74.9	—	—
3月末	12,194	8.0	84.8	—	—
4月末	12,544	11.1	69.8	—	—
5月末	12,914	14.4	80.8	0.4	—
6月末	13,854	22.7	86.7	—	—
7月末	14,582	29.2	78.3	0.9	—
8月末	14,806	31.2	78.0	1.6	—
9月末	14,774	30.9	79.5	0.9	—
(期末)					
2023年10月2日	14,839	31.5	79.3	0.9	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## 運用経過

## ● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2022年9月30日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。
- 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、ファンドの購入金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。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）

当期は、投資しているSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドが上昇したことにより、当ファンドの基準価額も上昇しました。

### SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

期中の騰落率は+35.3%となりました。

金利上昇を背景に金融株式が堅調に推移したことに加え、円安が進行したことなどがプラスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

## ● 投資環境

### ○株式市場

株式市場は期初より緩やかな上昇基調となりました。2023年3月には、米シリコンバレー銀行など米国銀行の破綻をきっかけに、米中堅銀行に対する経営不安が高まったことに加え、スイス金融大手のクレディ・スイス・グループが経営危機に陥ったことなどを背景に、金融セクター主導で一時、株式市場が調整する局面もありましたが、その後、各国の金融当局が迅速に対応したことで投資家心理が改善したほか、米半導体大手エヌビディアの好決算によるAI関連銘柄への期待、米国の債務上限を巡る不透明感の後退などが好感され、株式市場は期を通じて、概ね堅調に推移しました。

### ○為替市場

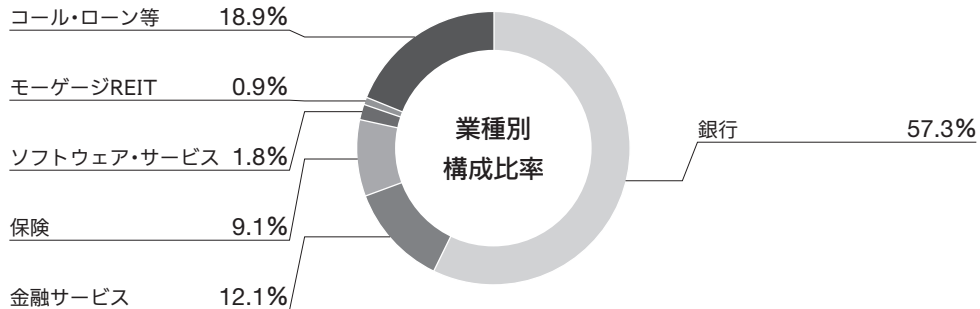
2022年12月において日銀が10年物国債の変動許容幅拡大を決定したことなどにより、日銀の金融政策正常化観測が高まり、一時ドル円が130円を割り込むまで円高ドル安が進行しました。しかしその後は、日銀の金融政策正常化期待が後退したほか、米国景気の見通し改善による米国の金融引き締め期間の長期化観測などを受けて、米国金利が上昇する一方、国内金利は日銀の国債買い入れへの警戒感などから上昇基調が抑制され、日米の金利差や金融政策格差を背景に円安ドル高が進行しました。

## ● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通してSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

### SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

期を通して株式および外国投資証券の組入比率を高位に維持しました。



注1. 比率は、第2期末における純資産総額に対する割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比率が100%にならない場合があります。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳（単位：円、1万口当たり・税引前）

項目	第2期 2022.10.1~2023.10.2
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	4,838

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 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。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

## ● 今後の運用方針

### SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）

今後も、SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

### SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

世界の金利上昇局面などにおいて良好なパフォーマンスが期待される世界の金融セクターの株式に分散投資を行います。また、破綻した米中堅銀行が発端となった世界的な金融システム不安や景気後退懸念についても、今後も注意深くモニタリングを行います。他方で、金融引き締めによる利上げもしくは高金利環境の維持は、金融機関にとって好ましい収益環境になると考えています。また、自社株買いなど株主還元も充実しており、割安な株価、コスト削減効果の継続が想定されることなど、金融株式には引き続き魅力的な投資機会が存在していると考えています。

## ● 1万口当たりの費用明細

項目	第2期 2022.10.1~2023.10.2		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	264円	2.002%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率（年率） × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,173円です。
（投信会社）	(154)	(1.172)	ファンドの運用の対価
（販売会社）	(105)	(0.796)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(4)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	28	0.215	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(28)	(0.213)	
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	31	0.232	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(31)	(0.232)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	194	1.474	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（保管費用）	(191)	(1.453)	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
（監査費用）	(2)	(0.014)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	(1)	(0.007)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	517	3.923	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の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. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

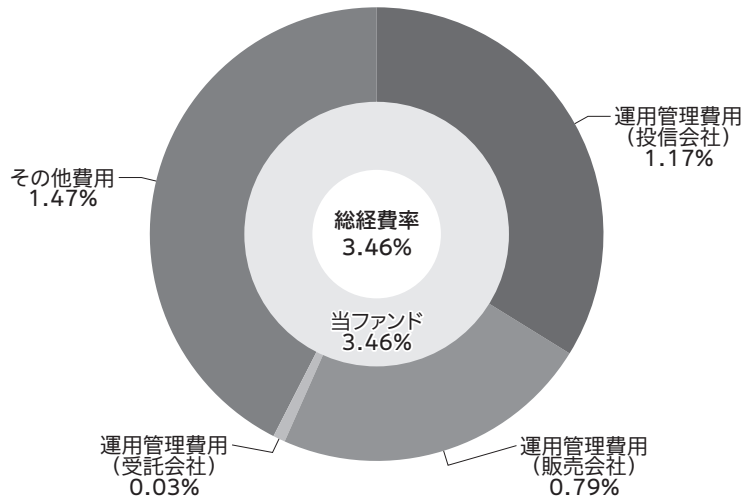
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（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3.46%**です。



注1. 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. 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5. 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10月1日～2023年10月2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
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	82,679 千口	106,000 千円	343,270 千口	461,000 千円

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

## ○株式売買比率

(2022年10月1日～2023年10月2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
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,739,802千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,756千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.49

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、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、邦貨換算したものです。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年10月1日～2023年10月2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。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年10月1日～2023年10月2日)

期首残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取引の理由
万円 1,000	万円 -	万円 -	万円 1,000	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2023年10月2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
		千口	千口	千円
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド		477,225	216,634	338,166

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入はありません。

## ○投資信託財産の構成

(2023年10月2日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	千円 338,166	% 97.4
コール・ローン等、その他	9,090	2.6
投資信託財産総額	347,256	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(329,827千円)の投資信託財産総額(340,304千円)に対する比率は、96.9%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、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.79円、1ユーロ=158.27円、1イギリス・ポンド=182.64円、1韓国・ウォン=0.111円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年10月2日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	347,256,643
コール・ローン等	9,089,888
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式会社マザーファンド(詳細額)	338,166,755
(B) 負債	4,835,056
未払解約金	937,420
未払信託報酬	3,867,970
その他未払費用	29,666
(C) 純資産総額(A－B)	342,421,587
元本	230,761,530
次期繰越損益金	111,660,057
(D) 受益権総口数	230,761,530口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,839円

(注1) 信託財産に係る期首元本額511,700,353円、期中追加設定元本額269,265,960円、期中一部解約元本額550,204,783円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.4839円

## ○損益の状況（2022年10月1日～2023年10月2日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,968
支払利息	△ 3,968
(B) 有価証券売買損益	69,683,642
売買益	119,131,726
売買損	△ 49,448,084
(C) 信託報酬等	△ 8,302,228
(D) 当期損益金(A+B+C)	61,377,446
(E) 前期繰越損益金	5,974,326
(F) 追加信託差損益金	44,308,285
(配当等相当額)	( 9,268,160)
(売買損益相当額)	( 35,040,125)
(G) 計(D+E+F)	111,660,057
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	111,660,057
追加信託差損益金	44,308,285
(配当等相当額)	( 10,102,350)
(売買損益相当額)	( 34,205,935)
分配準備積立金	67,351,772

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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) SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式会社マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の72の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程（2022年10月1日～2023年10月2日）は以下の通りです。

項 目	2022年10月1日～ 2023年10月2日
a. 配当等収益(費用控除後)	7,907,528円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	53,469,918円
c. 信託約款に規定する収益調整金	44,308,285円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	5,974,326円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	111,660,057円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,838円
g. 分配金	0円

## ○お知らせ

- ・実態に即した記載とするとともに、新NISA制度の成長投資枠の対象商品に係る法令上の要件を満たすため、投資信託約款に所要の変更（デリバティブ取引等の利用を価格等の変動リスクのヘッジと現物投資の代替に限定）を致しました（2023年9月29日）。

# SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

## 運用報告書

第2期（決算日 2023年10月2日）

<計算期間 2022年10月1日～2023年10月2日>

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの第2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	無期限
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。
主要投資対象	日本を含む世界の金融機関の株式
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。

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	%	%	%	百万円
2021年9月30日	10,000	—	—	—	78
1期(2022年9月30日)	11,538	15.4	79.8	0.8	550
2期(2023年10月2日)	15,610	35.3	80.3	0.9	338

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基 準	価 額		株 組	入 比	式 率	投 証 組	資 入 比	信 託 券 率
				騰 落	率						
	(期 首)		円	%				%			%
	2022年	9月30日	11,538	—				79.8			0.8
	10月末		13,050	13.1				79.4			0.9
	11月末		13,004	12.7				74.4			0.5
	12月末		12,450	7.9				81.9			—
	2023年	1月末	13,527	17.2				86.3			—
	2月末		14,355	24.4				77.6			—
	3月末		12,615	9.3				89.7			—
	4月末		13,034	13.0				72.7			—
	5月末		13,456	16.6				83.5			0.5
	6月末		14,493	25.6				90.4			—
	7月末		15,288	32.5				82.8			1.0
	8月末		15,549	34.8				80.7			1.6
	9月末		15,538	34.7				80.5			0.9
	(期 末)										
	2023年	10月2日	15,610	35.3				80.3			0.9

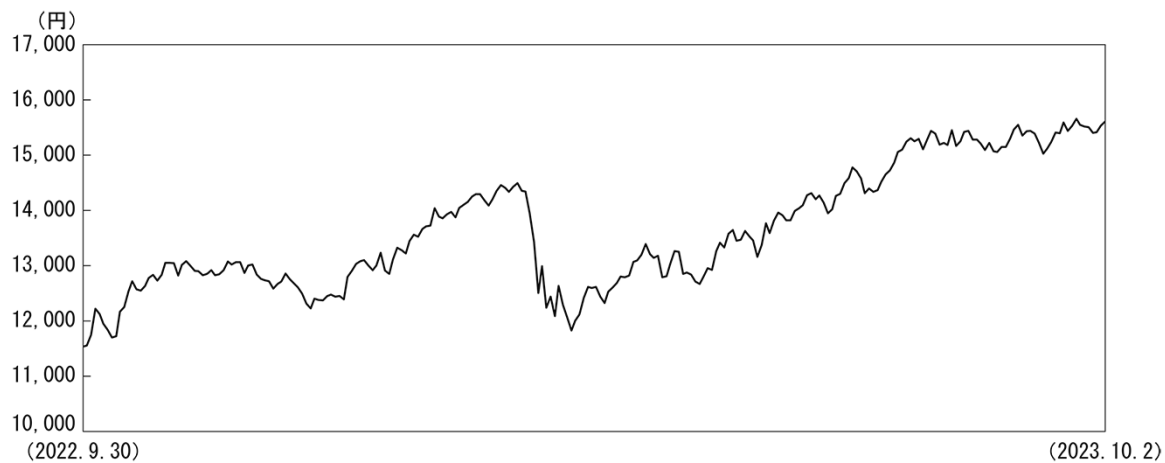
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○運用経過

(2022年10月1日～2023年10月2日)

## ■基準価額の推移



期首 : 11,538円  
期末 : 15,610円  
騰落率 : 35.3%

P 2 ～ P 6 をご参照下さい。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年10月1日~2023年10月2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)	円 30 (30) (0)	% 0.223 (0.220) (0.002)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 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)	33 (33) (0)	0.240 (0.240) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 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)	206 (206) (0)	1.506 (1.503) (0.003)	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	269	1.969	
期中の平均基準価額は13,684円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## ○売買及び取引の状況

(2022年10月1日～2023年10月2日)

## 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 7	千円 7,082	千株 7	千円 9,170
外	アメリカ	百株 822 ( - )	千アメリカ・ドル 2,528 (△0.093)	百株 1,097	千アメリカ・ドル 3,577
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	144	196	312	378
	イタリア	1,106	367	1,404	548
	フランス	71	168	108	293
	オランダ	92	112	168	188
	スペイン	1,818	366	2,632	509
	オーストリア	16 ( - )	61 (△ 2)	16	61
	アイルランド	137	91	381	185
	ギリシャ	467	112	319	98
	イギリス	3,045 ( 14)	千イギリス・ボンド 709 ( 2)	4,141	千イギリス・ボンド 744
	スイス	53	千スイス・フラン 90	53	千スイス・フラン 98
	スウェーデン	-	千スウェーデン・クローナ -	28	千スウェーデン・クローナ 291
	香港	746	千香港・ドル 377	798	千香港・ドル 667
韓国	-	千韓国・ウォン -	46	千韓国・ウォン 204,192	

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ( )内は増資割当、株式転換、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。

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	アメリカ	口	千アメリカ・ドル	口	千アメリカ・ドル
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	2,295	45	1,239	25
	RITHM CAPITAL CORP	47	0.47	47	0.481
	AGNC INVESTMENT CORP	2,258	20	5,687	55
小計	4,600	67	6,973	82	

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ○株式売買比率

(2022年10月1日～2023年10月2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	1,739,802千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,756千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.49

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、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、邦貨換算したものです。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年10月1日～2023年10月2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。

## ○組入資産の明細

(2023年10月2日現在)

## 外国株式

銘柄	株数	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	百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMERICAN INTERNATIONAL GP	10	—	—	—	保険	
BANK OF NEW YORK CO INC	—	6	29	4,452	金融サービス	
SLM CORP	16	—	—	—	金融サービス	
JP MORGAN CHASE & CO	13	—	—	—	銀行	
COMERICA INC	9	—	—	—	銀行	
FEDERATED HERMES INC	—	11	38	5,803	金融サービス	
BANK OF AMERICA CORP	25	—	—	—	銀行	
CITIGROUP INC	11	17	70	10,633	銀行	
M & T BANK CORP	—	2	29	4,413	銀行	
FIRST HORIZON CORP	—	16	18	2,761	銀行	
UNUM GROUP	—	11	54	8,112	保険	
EVEREST GROUP LTD	—	0.43	15	2,393	保険	
WELLS FARGO COMPANY	28	5	20	3,072	銀行	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	—	1	19	2,964	保険	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
WEBSTER FINANCIAL CORP	20	10	42	6,418	銀行	
LAZARD LTD-CL A	2	—	—	—	金融サービス	
KKR & CO INC	9	—	—	—	金融サービス	
SCULPTOR CAPITAL MANAGEMENT	34	—	—	—	金融サービス	
Q2 HOLDINGS INC	19	12	41	6,201	ソフトウェア・サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	39	18	53	7,939	金融サービス	
CADENCE BANK	24	—	—	—	銀行	
GUILD HOLDINGS CO - CLASS A	24	15	17	2,588	金融サービス	
STELLAR BANCORP INC	—	8	18	2,791	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28	14	39	5,860	銀行	
FIRST BANCSHARES INC/MS	15	3	10	1,510	銀行	
FIFTH THIRD BANCORP	20	—	—	—	銀行	
BANNER CORPORATION	—	3	13	2,005	銀行	
HANCOCK WHITNEY CORP	7	—	—	—	銀行	
POPULAR INC	7	5	33	5,011	銀行	
SEACOAST BANKING CORP/FL	6	5	11	1,720	銀行	
CARLYLE GROUP INC/THE	40	—	—	—	金融サービス	
PERELLA WEINBERG PARTNERS	21	—	—	—	金融サービス	
JAMES RIVER GROUP HOLDINGS L	17	11	18	2,715	保険	
小 計	株数・金額	457	182	596	89,372	
	銘柄数<比率>	25	20	—	<26.4%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	155	51	53	8,458	金融サービス	
COMMERZBANK AG	91	28	31	4,913	銀行	
小 計	株数・金額	247	79	84	13,371	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<4.0%>	
(ユーロ…イタリア)						
INTESA SANPAOLO	—	103	25	3,979	銀行	
BPER BANCA	318	—	—	—	銀行	
BFF BANK SPA	27	—	—	—	金融サービス	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	—	166	40	6,357	銀行	
ANIMA HOLDING SPA	—	67	26	4,227	金融サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア) BANCO BPM SPA UNICREDIT SPA EUR	百株 226 89	百株 — 27	千ユーロ — 61	千円 — 9,767	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	662 4	363 4	153 —	24,331 <7.2%>	
(ユーロ…フランス) SOCIETE GENERALE-A BNP PARIBAS	51 23	22 15	52 94	8,235 14,958	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	75 2	38 2	146 —	23,194 <6.9%>	
(ユーロ…オランダ) ABN AMRO BANK NV-CVA ING GROEP N.V.	— 143	33 34	44 43	7,049 6,882	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	143 1	67 2	88 —	13,931 <4.1%>	
(ユーロ…スペイン) BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA BANCO SANTANDER SA BANCO DE SABADELL SA	— 774 846	45 230 530	35 83 58	5,543 13,205 9,246	銀行 銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,621 2	806 3	176 —	27,996 <8.3%>	
(ユーロ…アイルランド) BANK OF IRELAND GROUP PLC AIB GROUP PLC	122 211	39 49	37 21	5,871 3,350	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	334 2	89 2	58 —	9,221 <2.7%>	
(ユーロ…ギリシャ) NATIONAL BANK OF GREECE ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	— —	28 119	15 14	2,398 2,372	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	— —	147 2	30 —	4,771 <1.4%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,084 13	1,593 17	738 —	116,817 <34.5%>	
(イギリス) STANDARD CHARTERED PLC GBP HSBC HOLDINGS PLC LLOYDS BANKING GROUP PLC BARCLAYS PLC LANCASHIRE HOLDINGS LTD NATWEST GROUP PLC MAN GROUP PLC/JERSEY M&G PLC CONDUIT HOLDINGS LTD BEAZLEY PLC	63 — 1,277 691 — 265 — — — — —	68 48 210 439 60 108 73 125 15 65	千イギリス・ポンド 51 31 9 69 35 25 16 24 7 36	9,472 5,727 1,704 12,770 6,530 4,673 2,980 4,505 1,300 6,602	銀行 銀行 銀行 銀行 保険 銀行 金融サービス 金融サービス 保険 保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,296 4	1,215 10	308 —	56,266 <16.6%>	
(スウェーデン) NORDEA BANK	28	—	千スウェーデン・クローナ —	—	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	28 1	— —	— —	— <—%>	
(香港) PING AN INSURANCE GROUP CO-H	51	—	千香港・ドル —	—	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	51 1	— —	— —	— <—%>	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(韓国) HANA FINANCIAL GROUP INC KB FINANCIAL GROUP INC	百株 35 27	百株 7 9	千韓国・ウォン 30,054 50,765	千円 3,336 5,634	銀行 銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	62	16	80,820	8,971	
	銘柄数 < 比率 >	2	2	—	< 2.7% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	5,980	3,007	—	271,428	
	銘柄数 < 比率 >	46	49	—	< 80.3% >	

(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) 邦貨換算金額の< >内は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

## 外国投資信託証券

銘柄	口数	当 期 末		比 率		
		口 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(アメリカ) ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN AGNC INVESTMENT CORP	口 — 3,429	口 1,056 —	千アメリカ・ドル 19 —	千円 2,975 —	% 0.9 —	
合 計	口 数 ・ 金 額	3,429	1,056	19	2,975	
	銘柄数 < 比率 >	1	1	—	< 0.9% >	

(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) 比率は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2023年10月2日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 271,428	% 79.8
投資証券	2,975	0.9
コール・ローン等、その他	65,901	19.3
投資信託財産総額	340,304	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(329,827千円)の投資信託財産総額(340,304千円)に対する比率は、96.9%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、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.79円、1ユーロ=158.27円、1イギリス・ポンド=182.64円、1韓国・ウォン=0.111円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月2日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	340,304,996	
コール・ローン等	62,937,220	
株式(評価額)	271,428,369	
投資証券(評価額)	2,975,332	
未収入金	2,555,039	
未収配当金	409,036	
(B) 負債	2,139,423	
未払金	2,138,815	
その他未払費用	608	
(C) 純資産総額(A-B)	338,165,573	
元本	216,634,693	
次期繰越損益金	121,530,880	
(D) 受益権総口数	216,634,693口	
1万口当たり基準価額(C/D)	15,610円	

(注1) 信託財産に係る期首元本額477,225,880円、期中追加設定元本額82,679,087円、期中一部解約元本額343,270,274円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド(円ヘッジなし) 216,634,693円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.5610円

## ○損益の状況 (2022年10月1日~2023年10月2日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	11,774,470	
受取配当金	11,778,977	
その他収益金	764	
支払利息	△ 5,271	
(B) 有価証券売買損益	136,893,348	
売買益	177,788,583	
売買損	△ 40,895,235	
(C) 保管費用等	△ 6,145,828	
(D) 当期損益金(A+B+C)	142,521,990	
(E) 前期繰越損益金	73,417,703	
(F) 追加信託差損益金	23,320,913	
(G) 解約差損益金	△117,729,726	
(H) 計(D+E+F+G)	121,530,880	
次期繰越損益金(H)	121,530,880	

(注1) 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) 追加信託差損益金とは、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3) 解約差損益金とは、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

- ・実態に即した記載とするとともに、新NISA制度の成長投資枠の対象商品に係る法令上の要件を満たすため、投資信託約款に所要の変更(デリバティブ取引等の利用を価格等の変動リスクのヘッジと現物投資の代替に限定)を致しました(2023年9月29日)。