

## ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略 ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

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	
信託期間	2027年5月28日まで(設定日:2017年5月22日)	
決算日	3月20日および9月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド受益証券(以下「親投資信託」といいます。)への投資を通じて、主として、米国の小型株式に投資し、信託財産の成長を図ることを目標として積極的な運用を行います。</p> <p>②主として、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルを活用しながら、企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。</p> <p>【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)】</p> <p>③実質外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。</p> <p>【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)】</p> <p>③実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④親投資信託の受益証券を通じて、効率的な運用や組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等へ投資する場合があります。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に外国株式等(短期金融商品を含みます。)にかかる運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要投資対象	子投資信託	【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)】 親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	【米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド】 米国の小型株式を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年2回の毎決算時(原則として3月20日と9月20日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないこともあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>	

## 第13期 運用報告書(全体版)

(決算日:2023年9月20日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

## ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するご問い合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

[www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

## CONTENTS

子投資信託(決算日:2023年9月20日)

「ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド  
(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2023年9月20日)

「米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況

## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(税引後 配当込み、 円ヘッジ円ベース)	期中 騰落率				
9期(2021年9月21日)	円 15,511	円 0	% △ 3.5	2,797.12	% △ 4.5	% 92.9	% 2.1	% 4.7	百万円 10,200
10期(2022年3月22日)	14,694	0	△ 5.3	2,655.58	△ 5.1	95.3	2.3	6.2	8,473
11期(2022年9月20日)	12,620	0	△14.1	2,284.70	△14.0	96.2	2.5	5.1	6,788
12期(2023年3月20日)	11,983	0	△ 5.0	2,144.28	△ 6.1	89.9	2.2	5.1	5,800
13期(2023年9月20日)	12,105	0	1.0	2,213.27	3.2	94.0	2.2	5.1	5,468

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰落率		(税引後 配当込み、 円ヘッジ円ベース)	騰落率			
(期首) 2023年3月20日	円 11,983	% -	2,144.28	% -	% 89.9	% 2.2	% 5.1
3月末	12,234	2.1	2,191.55	2.2	90.3	2.3	5.6
4月末	11,950	△0.3	2,161.10	0.8	93.2	2.0	5.7
5月末	11,864	△1.0	2,172.94	1.3	96.4	2.3	6.4
6月末	12,649	5.6	2,310.04	7.7	95.3	2.4	6.8
7月末	13,149	9.7	2,420.21	12.9	90.5	2.1	5.8
8月末	12,663	5.7	2,313.36	7.9	97.1	2.3	5.6
(期末) 2023年9月20日	12,105	1.0	2,213.27	3.2	94.0	2.2	5.1

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	期 中 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
9期(2021年9月21日)	16,246	0	△ 2.9	343,189.42	△ 3.7	93.0	2.1	4.7	13,695
10期(2022年3月22日)	16,860	0	3.8	357,401.04	4.1	91.7	2.2	6.0	13,362
11期(2022年9月20日)	17,609	0	4.4	376,191.20	5.3	92.7	2.4	4.9	12,776
12期(2023年3月20日)	15,803	0	△10.3	333,541.42	△11.3	92.4	2.3	5.3	10,190
13期(2023年9月20日)	18,396	0	16.4	395,538.46	18.6	92.7	2.2	5.1	10,620

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰 落 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	騰 落 率				
(期首) 2023年3月20日	円	%		%	%	%	%
	15,803	-	333,541.42	-	92.4	2.3	5.3
3月末	16,277	3.0	344,113.67	3.2	92.0	2.3	5.7
4月末	16,044	1.5	342,467.41	2.7	92.4	2.0	5.7
5月末	16,701	5.7	360,523.13	8.1	91.9	2.2	6.1
6月末	18,519	17.2	398,715.22	19.5	91.6	2.3	6.5
7月末	18,879	19.5	408,415.89	22.4	92.4	2.2	5.9
8月末	18,977	20.1	407,268.62	22.1	93.0	2.2	5.4
(期末) 2023年9月20日	18,396	16.4	395,538.46	18.6	92.7	2.2	5.1

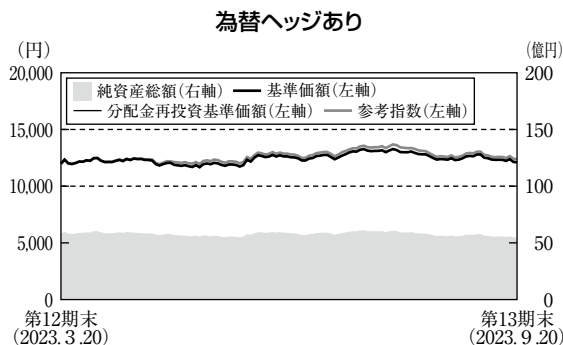
(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## ■当期中の基準価額等の推移について(第13期:2023年3月21日~2023年9月20日)

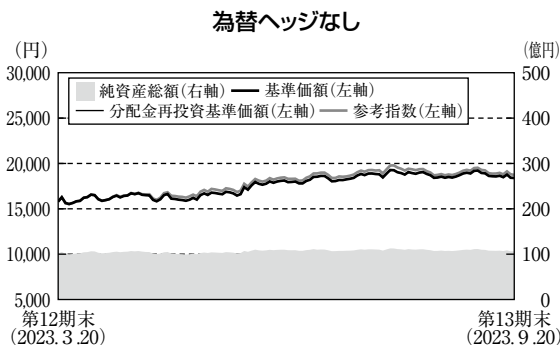


第13期首：11,983円  
 第13期末：12,105円(既払分配金0円)  
 騰落率：1.0%(分配金再投資ベース)

- \* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- \* 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)です。
- \* 分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント  
投資環境について

当期(2023年3月21日から2023年9月20日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで上昇しました。当期の株式市場は、米国の金融政策の動向に加え、米地銀の破綻やA I関連銘柄への買いの集中など様々な影響を受けました。米国金融政策のインフレ抑制重視が継続する中でI S M等の景況感が悪化すると、金融引き締めによる景気鈍化懸念が強まるなどしました。また金融引き締めの影響もあり、地銀が破綻すると市場参加者のリスクテイク姿勢が悪化し、市場では質への逃避も発生しました。このように経済先行き見通しの不透明感が強い中で、明るいニュースとしてA I関連への期待が強まると、半導体等A I関連銘柄への買いが集中する一方で、それ以外の銘柄群には業績期待が高かったとしても買いが入りにくいなど二極化した市場環境となる場面もありまし



第13期首：15,803円  
 第13期末：18,396円(既払分配金0円)  
 騰落率：16.4%(分配金再投資ベース)

- \* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- \* 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)です。
- \* 分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

た。

## ポートフォリオについて

## ＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)＞

当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組み入れた運用を行いました。また、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りました。

## ＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)＞

当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組み入れた運用を行いました。

ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

**<米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド>**

当期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに苦戦しました。当期は、様々なイベントの影響から市場参加者のリスクテイク姿勢が変化するとともに、市場での銘柄選択トレンドが変化しました。各種イベントの影響が大きくなり、個別銘柄の業績などの企業ファンダメンタルズを度外視する動きもありました。このような市場環境に於いてファンダメンタルズでは、バリュエーション(割安・割高度合い)に着目する投資アイデアが有効性を発揮したものの、財務や企業体質等に着目した投資アイデアは苦戦しました。特に金利が上昇するなかで割高銘柄が売られ割安銘柄が好まれるような動きをバリュエーションに着目する投資アイデアが上手く捉えました。しかし、従業員満足度や企業が従業員に提供する福利厚生に着目する投資アイデアなどが苦戦しました。センチメントでは主に今後の業績期待に着目する投資アイデアが苦戦しました。決算発表時の経営陣のコメントを機械学習により分析し、経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア、決算サプライズに着目した投資アイデア、そしてインターネット上の検索動向に着目した投資アイデアなどが苦戦しました。

**基準価額の主な変動要因****<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>**

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+1.0%となりました。「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」が上昇したことが当ファンドのプラス要因となりましたが、為替市場での円安進展のなかで、為替ヘッジが当ファンドのマイナス要因となりました。

**■組入ファンドの当期間中の騰落率**

組入ファンド	騰落率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	17.3%

**<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>**

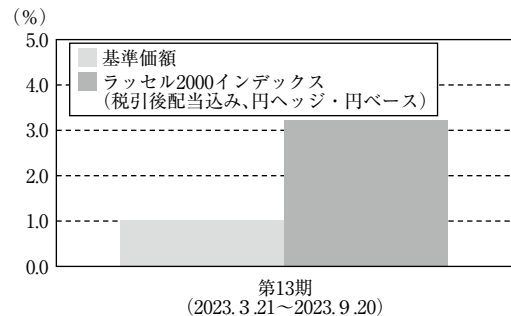
当ファンドの基準価額の期中騰落率は+16.4%となりました。当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」が上昇したことが当ファンドのプラス要因となりました。

**■組入ファンドの当期間中の騰落率**

組入ファンド	騰落率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	17.3%

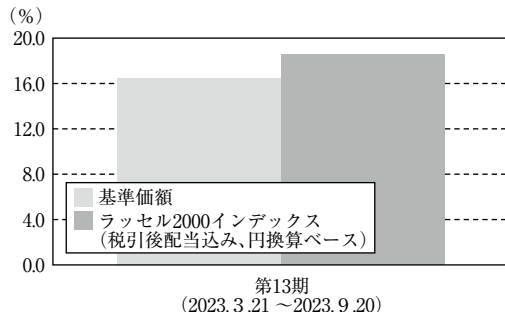
**ベンチマークとの差異について****<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>**

当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。後記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

**【基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)】****<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>**

当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。後記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

## 【基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)】



## 分配金について

### <ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>

収益分配につきましては、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

## ■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2023年3月21日 ~2023年9月20日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	5,971

- (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却等損益」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(税込み)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(税込み)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。

### <ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>

収益分配につきましては、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

## ■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2023年3月21日 ~2023年9月20日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	8,396

- (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(税込み)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(税込み)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。

## 今後の運用方針について

### <ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>

引き続き、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組入れた運用を行う方針です。また、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図る方針です。

### <ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>

引き続き、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組入れた運用を行う方針です。

### <米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド>

当ファンドでは、引き続き、ビッグデータ等を活用し、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルにより企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。また、有望な銘柄の選定のみならず、取引コスト、市場環境に応じた取るべきリスク量も勘案して運用を行っていく方針です。

## ◇ファンド状況

## ■ 1万口当りの費用明細

項目	第13期		項目の概要
	(2023. 3. 21～2023. 9. 20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 99	% 0.799	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,424円です。
(投信会社)	( 48)	(0.387)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	( 48)	(0.387)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	( 3)	(0.025)	受託銀行分は、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	8	0.067	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)	( 8)	(0.061)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資証券)	( 1)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	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)	(0.001)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	5	0.042	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)	( 4)	(0.029)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(印刷費用・監査費用等)	( 2)	(0.013)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	( 0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	113	0.908	

(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。

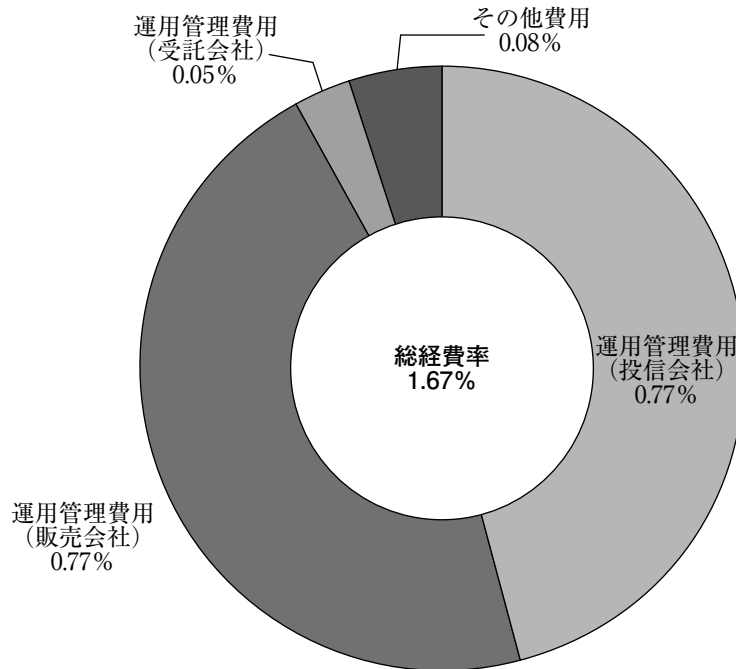
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



## (参考情報)

## ■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.67%です。

(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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。

### ■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 209,348	千円 404,232	千口 743,761	千円 1,444,674

(注) 単位未満は切捨て。

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,887,478千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,285,224千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.36

(注1) (b)は親投資信託の各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 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

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 3,276,348	千口 2,741,934	千円 5,590,530

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は7,993,167千口です。

## ■ 1万口当りの費用明細

項目	第13期		項目の概要
	(2023. 3. 21～2023. 9. 20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 141	% 0.799	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 期中の平均基準価額は17,602円です。
( 投信会社)	( 68)	(0.387)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
( 販売会社)	( 68)	(0.387)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
( 受託銀行)	( 4)	(0.025)	受託銀行分は、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	12	0.066	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)	( 11)	(0.060)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資証券)	( 1)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	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)	(0.001)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	6	0.036	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)	( 5)	(0.028)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(印刷費用・監査費用等)	( 1)	(0.008)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	( 0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	159	0.902	

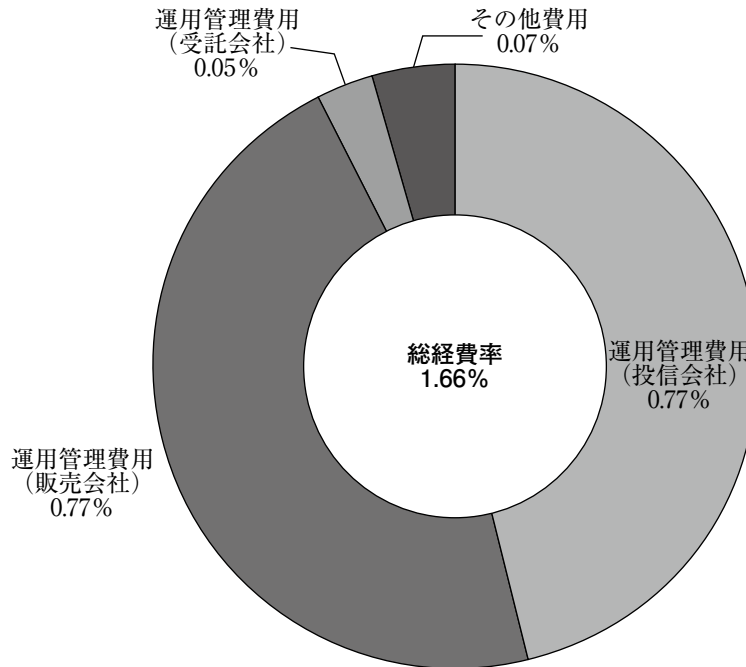
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

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

## (参考情報)

## ■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.66%です。

(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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。

### ■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 25,759	千円 49,264	千口 692,512	千円 1,317,226

(注) 単位未満は切捨て。

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,887,478千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,285,224千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.36

(注1) (b)は親投資信託の各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況(2023年3月21日から2023年9月20日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 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

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 5,917,985	千口 5,251,232	千円 10,706,738

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は7,993,167千口です。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千円 5,590,530	% 100.0
コーラル・ローン等、その他	573	0.0
投資信託財産総額	5,591,103	100.0

(注1) 米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(16,288,575千円)の投資信託財産総額(16,461,586千円)に対する比率は、98.9%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=147.84円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	11,098,007,062円
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド(評価額)	5,590,530,482
未 収 入 金	5,507,476,580
(B) 負 債	5,629,278,242
未 払 金	5,581,683,113
未 払 解 約 金	573,239
未 払 信 託 報 酬	46,263,330
そ の 他 未 払 費 用	758,560
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,468,728,820
元 本	4,517,612,044
次 期 繰 越 損 益 金	951,116,776
(D) 受 益 権 総 口 数	4,517,612,044口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	12,105円

<注記事項>

期首元本額	4,840,468,094円
期中追加設定元本額	141,972,503円
期中一部解約元本額	464,828,553円

## ■損益の状況

自2023年3月21日 至2023年9月20日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	97,744,123円
売 買 益	1,420,717,532
売 買 損	△1,322,973,409
(B) 信 託 報 酬 等	△ 47,049,391
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	50,694,732
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	456,674,093
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	443,747,951
( 配 当 等 相 当 額 )	( 410,545,830)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 33,202,121)
(F) 合 計(C+D+E)	951,116,776
次 期 繰 越 損 益 金(F)	951,116,776
追 加 信 託 差 損 益 金	443,747,951
( 配 当 等 相 当 額 )	( 410,705,732)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 33,042,219)
分 配 準 備 積 立 金	2,253,935,538
繰 越 損 益 金	△1,746,566,713

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(注4) 親投資信託の投資信託財産の運用指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額は、11,236,315円です。

## ■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第13期計算期末における、費用控除後の配当等収益(19,099,639円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(33,042,219円)、収益調整金(その他収益調整金)(410,705,732円)、分配準備積立金(2,234,835,899円)により、分配対象収益は2,697,683,489円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

## ■投資信託財産の構成

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千円 10,706,738	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	15,294	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	10,722,033	100.0

(注1) 米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(16,288,575千円)の投資信託財産総額(16,461,586千円)に対する比率は、98.9%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=147.84円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,722,033,034円
米国小型株式 ビッグデータ戦略 マザーファンド(評価額)	10,706,738,354
未 収 入 金	15,294,680
(B) 負 債	101,234,790
未 払 解 約 金	15,294,680
未 払 信 託 報 酬	85,042,070
そ の 他 未 払 費 用	898,040
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,620,798,244
元 本	5,773,318,679
次 期 繰 越 損 益 金	4,847,479,565
(D) 受 益 権 総 口 数	5,773,318,679口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	18,396円

&lt;注記事項&gt;

期首元本額	6,448,944,881円
期中追加設定元本額	28,422,644円
期中一部解約元本額	704,048,846円

## ■損益の状況

自2023年3月21日 至2023年9月20日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,577,363,264円
売 買 益	1,689,320,910
売 買 損	△ 111,957,646
(B) 信 託 報 酬 等	△ 85,940,110
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	1,491,423,154
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	2,546,925,126
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	809,131,285
(配 当 等 相 当 額)	( 668,557,460)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 140,573,825)
(F) 合 計(C+D+E)	4,847,479,565
次 期 繰 越 損 益 金(F)	4,847,479,565
追 加 信 託 差 損 益 金	809,131,285
(配 当 等 相 当 額)	( 668,600,339)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 140,530,946)
分 配 準 備 積 立 金	4,038,348,280

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(注4) 親投資信託の投資信託財産の運用指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額は、20,654,823円です。

## ■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第13期計算期末における、費用控除後の配当等収益(62,553,620円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(390,017,817円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(140,530,946円)、収益調整金(その他収益調整金)(668,600,339円)、分配準備積立金(3,585,776,843円)により、分配対象収益は4,847,479,565円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

## 運用報告書

- 第7期 - 決算日 2023年9月20日  
 計算期間(2022年9月21日～2023年9月20日)

### 米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

決 算 日	9月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)
運 用 方 針	<p>①米国の小型株式に投資を行います。</p> <p>②主として、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルを活用しながら、企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④効率的な運用や組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等へ投資する場合があります。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に外国株式等(短期金融商品を含みます。)にかかる運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>
主 要 運 用 対 象	米国の小型株式を主要投資対象とします。
組 入 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>



## ◇基準価額の推移

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	期 騰 落	中 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	期 騰 落				
	円	%		%	%	%	%	百万円
3期(2019年9月20日)	11,720	△7.5	238,000.43	△10.9	88.4	2.1	8.6	35,884
4期(2020年9月23日)	11,335	△3.3	224,301.76	△5.8	90.9	3.2	5.0	21,650
5期(2021年9月21日)	17,439	53.9	343,189.42	53.0	92.3	2.1	4.7	24,083
6期(2022年9月20日)	19,198	10.1	376,191.20	9.6	92.0	2.3	4.9	19,977
7期(2023年9月20日)	20,389	6.2	395,538.46	5.1	92.0	2.2	5.0	16,297

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注4) 純資産総額の単位未満は切捨て。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰 落	率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	騰 落			
(期首) 2022年9月20日	円	%		%	%	%	%
	19,198	-	376,191.20	-	92.0	2.3	4.9
9月末	17,971	△6.4	351,455.95	△6.6	93.2	2.3	4.5
10月末	20,331	5.9	396,964.74	5.5	93.7	2.1	4.1
11月末	19,205	0.0	370,163.46	△1.6	93.2	2.1	4.6
12月末	17,776	△7.4	340,613.79	△9.5	93.1	2.2	4.7
2023年1月末	18,629	△3.0	357,679.82	△4.9	92.3	2.2	5.5
2月末	19,686	2.5	376,119.02	△0.0	92.0	2.5	5.4
3月末	17,911	△6.7	344,113.67	△8.5	92.0	2.3	5.7
4月末	17,676	△7.9	342,467.41	△9.0	92.3	2.0	5.7
5月末	18,425	△4.0	360,523.13	△4.2	91.6	2.2	6.1
6月末	20,450	6.5	398,715.22	6.0	91.2	2.3	6.5
7月末	20,873	8.7	408,415.89	8.6	91.9	2.1	5.9
8月末	21,009	9.4	407,268.62	8.3	92.4	2.2	5.4
(期末) 2023年9月20日	20,389	6.2	395,538.46	5.1	92.0	2.2	5.0

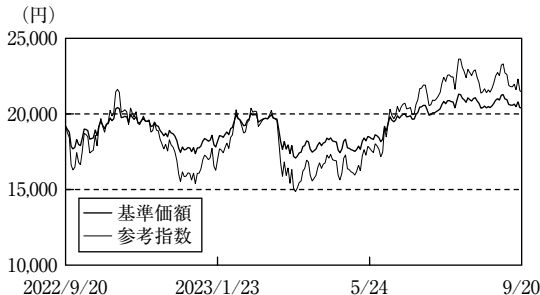
(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## ■基準価額の推移

(2022年9月20日～2023年9月20日)



(注1) 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)です。

(注2) 参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

## ◇運用担当者コメント

通期では、当ファンドの基準価額は6.2%の上昇となりました。

## <上半期(2022年9月21日～2023年3月20日)>

### 投資環境について

当上半期(2022年9月21日から2023年3月20日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで下落しました。当上半期の株式市場は、米国の金融政策の動向などマクロ面の動向が株式市場に影響を与えました。米国では引き続き高水準のインフレが継続し、それに対する金融政策当局の対応が注目点となっていました。そのためFRB(米連邦準備制度理事会)が市場想定以上にタカ派姿勢を示すと市場は急速にリスク回避的になる場面がありました。また2022年末に向けては金融引き締めの結果としての経済減速懸念が意識され市場参加者のリスクテイク姿勢の重石となりました。2023年に入ると中国経済再開期待に加え、米国のインフレ鈍化やパウエルFRB議長のディスインフレ発言によるFRBのタカ派姿勢緩和期待などが市場参加者のセンチメントを下支えしました。3月にはシリコンバレーバンクの破綻により金融システム不安から市場参加者は急速にリスク回避的となりました。

## ポートフォリオについて

当上半期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに有効性を発揮しました。当上半期は、金融政策動向や金融システム不安により市場参加者のリスクテイク姿勢の変化が大きくなりました。その変化に応じて市場参加者の銘柄選択トレンドも変化しました。このような市場環境において様々な観点で個別銘柄を評価することの有効性が発揮されました。ファンダメンタルズでは、バリュエーション(割安・割高度合い)や、財務体質等に着目した投資アイデアなどが有効性を発揮しました。特に市場参加者がリスクテイク姿勢を強めたときに割安銘柄が好まれる動きをバリュエーション関連の投資アイデアが上手く捉えました。また、市場参加者がリスク回避的となり財務体質が良好な銘柄を好む場面では、株式希薄化の有無など財務面に着目した投資アイデアなどがこのような動きを上手く捉えました。センチメントでは今後の業績期待や需給動向に着目する投資アイデアが有効性を発揮しました。業績関連では機械学習やビッグデータを活用した投資アイデアが有効性を発揮しました。具体的には、決算発表時の経営陣のコメントを機械学習により分析し、経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア等が有効性を発揮しました。需給面では社債の空売り動向に着目した投資アイデア等が有効性を発揮しました。

## <下半期(2023年3月21日～2023年9月20日)>

### 投資環境について

当下半期(2023年3月21日から2023年9月20日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで上昇しました。当下半期の株式市場は、米国の金融政策の動向に加え、米地銀の破綻やAI関連銘柄への買いの集中など様々な影響を受けました。米国金融政策のインフレ抑制重視が継続する中でISM等の景況感が悪化すると、金融引き締めによる景気鈍化懸念が強まるなどしました。また金融引き締めの影響もあり、地銀が破綻すると市場参加者のリスクテイク姿勢が悪化し、市場では質への逃避も発生しました。このように経済先行き見通しの不透明感が強い中で、明るいニュースとしてAI関連への期待が強まると、半導体等AI関連銘柄への買いが集中する一方で、それ

以外の銘柄群には業績期待が高かったとしても買いが入りにくいなど二極化した市場環境となる場面もありました。

### **ポートフォリオについて**

当下半期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに苦戦しました。当下半期は、様々なイベントの影響から市場参加者のリスクテイク姿勢が変化するとともに、市場での銘柄選択トレンドが変化しました。各種イベントの影響が大きくなり、個別銘柄の業績などの企業ファンダメンタルズを度外視する動きもありました。このような市場環境に於いてファンダメンタルズでは、バリュエーション(割安・割高度合)に着目する投資アイデアが有効性を発揮したものの、財務や企業体質等に着目した投資アイデアは苦戦しました。特に金利が上昇するなかで割高銘柄が売られ割安銘柄が好まれるような動きをバリュエーションに着目する投資アイデアが上手く捉えました。しかし、従業員満足度や企業が従業員に提供する福利厚生に着目する投資アイデアなどが苦戦しました。センチメントでは主に今後の業績期待に着目する投資アイデアが苦戦しました。決算発表時の経営陣のコメントを機械学習により分析し、経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア、決算サプライズに着目した投資アイデア、そしてインターネット上の検索動向に着目した投資アイデアなどが苦戦しました。

### **今後の運用方針について**

当ファンドでは、引き続き、ビッグデータ等を活用し、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルにより企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。また、有望な銘柄の選定のみならず、取引コスト、市場環境に応じた取るべきリスク量も勘案して運用を行っていく方針です。

## ◇ファンド状況

## ■1万口当りの費用明細

項 目	当 期
	円
(a) 売買委託手数料	22
(株式)	(20)
(先物・オプション)	(0)
(投資証券)	(2)
(b) 有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(投資証券)	(0)
(c) その他費用	9
(保管費用)	(9)
(その他)	(0)
合 計	31

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加、解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(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

(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

(c) その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

## ◇運用内容

## ■売買及び取引の状況(2022年9月21日から2023年9月20日まで)

## (1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 58,106 (△ 1,956)	千米・ドル 136,953 (△ 2,487)	百株 64,379	千米・ドル 164,088

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(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含まれていません。

## (2) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
ACADIA REALTY TRUST	-	-	5	88
ALEXANDER & BALDWIN INC	3	62	6	125
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30	783	11	282
APPLE HOSPITALITY REIT INC	13	237	-	-
ARBOR REALTY TRUST INC	33	456	67	968
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	-	-	4	48
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	-	-	84	347
BRANDYWINE REALTY TRUST	9	61	1	5
CHATHAM LODGING TRUST	24	241	2	26
COPT DEFENSE PROPERTIES	28	683	21	517
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	11	23	0.595	1
EASTGROUP PROPERTIES INC	-	-	1	182
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6	43	6	49
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	0.758	18	12	306
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	-	-	11	613
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	-	-	1	49
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	5	154	0.727	21
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14	118	18	173
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	22	97	1	8
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28	499	-	-
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	24	72	4	18
INVENTRUST PROPERTIES CORP	0.556	12	0.556	12
KITE REALTY GROUP TRUST	49	1,039	28	596
LADDER CAPITAL CORP-REIT	9	92	2	23
MACERICH CO/THE	2	30	12	124
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	-	-	2	86
NEXPOINT RESIDENTIAL	5	230	1	70
NEXPOINT REAL ESTATE FINANCE	-	-	0.086	1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6	75	4	49
OUTFRONT MEDIA INC	-	-	65	1,115
PARAMOUNT GROUP INC	90	578	81	374
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15	444	18	571
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	26	219	2	21
RLJ LODGING TRUST	96	1,026	0.846	8
RPT REALTY	3	38	1	10
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3	287	4	388

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
SITE CENTERS CORP	-	-	2	31
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	-	-	6	120
TERRENO REALTY CORP	1	68	12	746
WASHINGTON REIT	4	87	0.565	9

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

### (3) 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		百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引		5,414	5,513	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2022年9月21日から2023年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	41,966,519千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	16,246,909千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.58

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄(2022年9月21日から2023年9月20日まで)

## (1) 株式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
NEW JERSEY RESOURCES CORP	27	185,112	6,666	ESSENT GROUP LTD	48	284,320	5,818
COMMERCIAL METALS CO	27	181,301	6,538	SILICON LABORATORIES INC	11	231,320	19,355
MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	57	177,632	3,065	WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	8	191,132	22,279
BOISE CASCADE CO	11	172,527	14,766	RUSH ENTERPRISES INC-CL A	24	182,911	7,608
PRESTIGE CONSUMER HEALTHCARE	18	153,040	8,187	INSIGHT ENTERPRISES INC	10	170,300	15,941
SHUTTERSTOCK INC	15	141,584	9,023	TEXAS ROADHOUSE INC	10	162,308	14,968
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	4	141,545	28,606	INSPERITY INC	10	161,632	16,025
HILTON GRAND VACATIONS INC	24	141,528	5,727	ELF BEAUTY INC	15	161,058	10,348
HOULIHAN LOKEY INC	11	140,512	12,462	HILTON GRAND VACATIONS INC	25	160,135	6,241
MGP INGREDIENTS INC	10	137,636	13,747	TEREX CORP	28	158,993	5,605

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## (2) 投資証券

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
RLJ LODGING TRUST	96	143,267	1,482	OUTFRONT MEDIA INC	65	151,596	2,305
KITE REALTY GROUP TRUST	49	136,397	2,766	ARBOR REALTY TRUST INC	67	141,127	2,093
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30	107,074	3,535	TERRENO REALTY CORP	12	109,791	8,757
COPT DEFENSE PROPERTIES	28	95,473	3,312	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	11	86,261	7,398
PARAMOUNT GROUP INC	90	80,114	885	KITE REALTY GROUP TRUST	28	84,658	2,971
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28	70,791	2,486	PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	18	77,536	4,262
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15	65,251	4,250	COPT DEFENSE PROPERTIES	21	76,148	3,579
ARBOR REALTY TRUST INC	33	60,692	1,792	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4	55,720	13,024
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3	38,501	11,527	PARAMOUNT GROUP INC	81	53,331	656
APPLE HOSPITALITY REIT INC	13	32,572	2,347	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	84	48,755	578

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産の明細

## (1) 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	
AAON INC	—	13	82	12,191	資本財
ADMA BIOLOGICS INC	—	58	21	3,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALX ONCOLOGY HOLDINGS INC	—	11	5	818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMN HEALTHCARE SERVICES INC	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ANI PHARMACEUTICALS INC	—	18	112	16,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASGN INC	41	—	—	—	商業・専門サービス
AARON'S INC	88	146	142	21,119	一般消費財・サービス流通・小売り
ABCELLERA BIOLOGICS INC	111	92	46	6,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	—	34	172	25,431	一般消費財・サービス流通・小売り
ACADEMY SPORTS & OUTDOORS IN	9	18	89	13,171	一般消費財・サービス流通・小売り
ACADIA PHARMACEUTICALS INC	76	22	55	8,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCEL ENTERTAINMENT INC	41	69	77	11,395	消費者サービス
ACCOLADE INC	43	67	79	11,699	ヘルスケア機器・サービス
ACCURAY INC	226	186	52	7,794	ヘルスケア機器・サービス
ACI WORLDWIDE INC	197	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ACLARIS THERAPEUTICS INC	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADAPTIVE BIOTECHNOLOGIES	268	209	113	16,840	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADAPTHEALTH CORP	—	27	25	3,828	ヘルスケア機器・サービス
ADDUS HOMECARE CORP	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AERIE PHARMACEUTICALS INC	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADVANSIX INC	18	—	—	—	素材
AEROJET ROCKETDYNE HOLDINGS	55	—	—	—	資本財
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES	—	21	219	32,456	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AGENUS INC	422	236	29	4,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGIOS PHARMACEUTICALS INC	56	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AKERO THERAPEUTICS INC	11	3	15	2,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALARM.COM HOLDINGS INC	23	24	146	21,618	ソフトウェア・サービス
ALBANY INTL CORP-CL A	—	1	9	1,368	資本財
ALECTOR INC	126	260	171	25,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGNMENT HEALTHCARE INC	52	74	47	7,076	ヘルスケア機器・サービス
ALLIENT INC	—	13	42	6,334	資本財
ALLOGENE THERAPEUTICS INC	158	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLOVIR INC	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERADIGM INC	339	0.27	0	51	ヘルスケア機器・サービス
ALTRA INDUSTRIAL MOTION CORP	140	—	—	—	資本財
AMALGAMATED FINANCIAL CORP	0.98	73	126	18,684	銀行
AMBAC FINANCIAL GROUP INC	48	52	67	10,039	保険
AMERESCO INC-CL A	45	—	—	—	資本財
AMERICAN WELL CORP-CLASS A	516	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN WOODMARK CORP	—	33	250	37,098	資本財
AMERIS BANCORP	24	8	32	4,864	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 千米・ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
AMICUS THERAPEUTICS INC	96	44	57	8,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMKOR TECHNOLOGY INC	93	91	208	30,800	半導体・半導体製造装置
AMNEAL PHARMACEUTICALS INC	61	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHASTAR PHARMACEUTICALS IN	119	14	66	9,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANDERSONS INC/THE	60	34	177	26,238	生活必需品流通・小売り
ANGIODYNAMICS INC	-	125	93	13,851	ヘルスケア機器・サービス
ANIKA THERAPEUTICS INC	-	53	95	14,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APELLIS PHARMACEUTICALS INC	68	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APOGEE ENTERPRISES INC	7	19	96	14,200	資本財
APIAN CORP	15	-	-	-	ソフトウェア・サービス
APPFOLIO INC - A	-	20	372	55,086	ソフトウェア・サービス
APPLIED INDUSTRIAL TECH INC	113	39	605	89,481	資本財
APPLIED MOLECULAR TRANSPORT	32	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCBEST CORP	13	-	-	-	運輸
ARCHAEA ENERGY INC	1	-	-	-	エネルギー
ARCHROCK INC	289	146	180	26,669	エネルギー
ARCOSA INC	-	11	84	12,563	資本財
ARCUS BIOSCIENCES INC	27	39	80	11,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCUTIS BIOTHERAPEUTICS INC	32	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCTURUS THERAPEUTICS HOLDIN	49	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARROWHEAD PHARMACEUTICALS IN	2	14	39	5,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARVINAS INC	31	73	179	26,553	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASANA INC - CL A	92	90	159	23,627	ソフトウェア・サービス
ASSOCIATED BANC-CORP	119	-	-	-	銀行
ASTEC INDUSTRIES INC	32	35	175	26,015	資本財
ASTRONICS CORP	90	-	-	-	資本財
ATARA BIOTHERAPEUTICS INC	179	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATEA PHARMACEUTICALS INC	137	77	25	3,732	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATKORE INC	58	71	1,066	157,722	資本財
ATOSSA THERAPEUTICS INC	194	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATRICURE INC	21	19	85	12,610	ヘルスケア機器・サービス
ATRECA INC - A	103	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATRION CORPORATION	3	0.84	37	5,587	ヘルスケア機器・サービス
AURORA INNOVATION INC	-	108	32	4,825	ソフトウェア・サービス
AVIENT CORP	266	-	-	-	素材
AVIDXCHANGE HOLDINGS INC	7	-	-	-	金融サービス
AVIDITY BIOSCIENCES INC	33	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXCELIS TECHNOLOGIES INC	10	47	798	118,067	半導体・半導体製造装置
AXOGEN INC	-	56	29	4,414	ヘルスケア機器・サービス
AXSOME THERAPEUTICS INC	-	1	8	1,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXOS FINANCIAL INC	-	25	100	14,860	銀行
AXONICS INC	-	11	65	9,665	ヘルスケア機器・サービス
BACKBLAZE INC-A	-	5	3	550	ソフトウェア・サービス
BADGER METER INC	-	1	31	4,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	
BALLY'S CORP	-	52	83	12,287	消費者サービス
BANDWIDTH INC-CLASS A	171	54	67	9,948	電気通信サービス
BASSETT FURNITURE INDS	-	1	2	365	耐久消費財・アパレル
BEAM THERAPEUTICS INC	43	106	260	38,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEAZER HOMES USA INC	-	7	19	2,907	耐久消費財・アパレル
BELLRING BRANDS INC	-	39	160	23,686	家庭用品・パーソナル用品
BENCHMARK ELECTRONICS INC	10	23	56	8,377	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHENOMEX INC	107	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIG LOTS INC	22	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
BIOCRIST PHARMACEUTICALS INC	-	101	77	11,448	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMEA FUSION INC	2	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BJ'S RESTAURANTS INC	102	5	14	2,151	消費者サービス
BLACK DIAMOND THERAPEUTICS I	82	7	2	408	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK HILLS CORP	138	-	-	-	公益事業
BLACKLINE INC	-	56	308	45,625	ソフトウェア・サービス
BLEND LABS INC-A	56	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BLOOM ENERGY CORP	225	-	-	-	資本財
BLUEBIRD BIO INC	32	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLUELINX HOLDINGS INC	-	1	9	1,387	資本財
BLUEPRINT MEDICINES CORP	72	67	346	51,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOISE CASCADE CO	-	105	1,068	158,031	資本財
BOOT BARN HOLDINGS INC	-	6	56	8,426	一般消費財・サービス流通・小売り
BOX INC - CLASS A	271	137	336	49,749	ソフトウェア・サービス
BRAZE INC-A	-	3	14	2,110	ソフトウェア・サービス
BRIDGEBIO PHARMA INC	143	15	42	6,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRIGHTCOVE	-	89	31	4,688	ソフトウェア・サービス
BROOKDALE SENIOR LIVING INC	49	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
BROOKFIELD INFRASTRUCTUR-A	144	-	-	-	公益事業
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	84	45	125	18,517	公益事業
BTRS HOLDINGS INC	75	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	47	16	215	31,867	資本財
BUMBLE INC-A	21	253	387	57,267	メディア・娯楽
C3.AI INC-A	67	9	24	3,636	ソフトウェア・サービス
C4 THERAPEUTICS INC	-	164	36	5,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CNO FINANCIAL GROUP INC	32	75	180	26,677	保険
CSG SYSTEMS INTL INC	104	-	-	-	商業・専門サービス
CNX RESOURCES CORP	93	-	-	-	エネルギー
CVB FINANCIAL CORP	-	62	105	15,641	銀行
CVR ENERGY INC	-	99	334	49,425	エネルギー
CABOT CORP	94	29	206	30,460	素材
CAL-MAINE FOODS INC	18	59	280	41,415	食品・飲料・タバコ
CALIFORNIA RESOURCES CORP	-	19	111	16,479	エネルギー
CALIX INC	89	100	464	68,681	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TOPGOLF CALLAWAY BRANDS CORP	29	-	-	-	耐久消費財・アパレル

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	
CALLON PETROLEUM CO	-	2	10	1,539	エネルギー
CAPITAL CITY BANK GROUP INC	79	79	231	34,231	銀行
CARDIOVASCULAR SYSTEMS INC	69	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CARDLYTICS INC	43	-	-	-	メディア・娯楽
CAREDX INC	20	108	86	12,821	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CARGURUS INC	33	123	221	32,775	メディア・娯楽
CARRIAGE SERVICES INC	3	-	-	-	消費者サービス
CARPARTS.COM INC	-	146	58	8,633	一般消費財・サービス流通・小売り
CARROLS RESTAURANT GROUP INC	-	175	108	16,062	消費者サービス
CARVANA CO	-	25	120	17,850	一般消費財・サービス流通・小売り
CENTRAL GARDEN & PET CO	6	4	21	3,194	家庭用品・パーソナル用品
CENTRAL GARDEN AND PET CO-A	133	41	173	25,659	家庭用品・パーソナル用品
CENTURY COMMUNITIES INC	-	47	337	49,870	耐久消費財・アパレル
CERUS CORP	141	141	22	3,273	ヘルスケア機器・サービス
CHAMPIONX CORP	130	33	123	18,215	エネルギー
CHART INDUSTRIES INC	9	-	-	-	資本財
CHEESECAKE FACTORY INC/THE	24	-	-	-	消費者サービス
CHEGG INC	41	110	105	15,586	消費者サービス
CHEMOCENTRYX INC	1	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	18	-	-	-	エネルギー
CHICO'S FAS INC	58	135	61	9,096	一般消費財・サービス流通・小売り
CHUY'S HOLDINGS INC	-	20	73	10,926	消費者サービス
CINEMARK HOLDINGS INC	126	27	48	7,124	メディア・娯楽
CIRCOR INTERNATIONAL INC	-	8	47	6,984	資本財
CIRRUS LOGIC INC	4	2	21	3,181	半導体・半導体製造装置
CITI TRENDS INC	-	21	46	6,932	一般消費財・サービス流通・小売り
CIVISTA BANCSHARES INC	-	0.65	1	159	銀行
CLEANSARK INC	-	28	12	1,861	ソフトウェア・サービス
CLEAR SECURE INC -CLASS A	32	24	49	7,385	ソフトウェア・サービス
CLEARWAY ENERGY INC-A	205	303	716	105,909	公益事業
CLEARWAY ENERGY INC-C	276	138	346	51,172	公益事業
CLOVER HEALTH INVESTMENTS CO	198	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
COCA-COLA CONSOLIDATED INC	5	-	-	-	食品・飲料・タバコ
CODEXIS INC	115	343	60	8,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COEUR MINING INC	302	646	143	21,212	素材
COGENT COMMUNICATIONS HOLDIN	-	6	42	6,346	電気通信サービス
COHERUS BIOSCIENCES INC	211	307	141	20,954	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COHU INC	-	8	30	4,573	半導体・半導体製造装置
COLLEGIUM PHARMACEUTICAL INC	17	108	245	36,274	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMFORT SYSTEMS USA INC	-	33	609	90,058	資本財
COMMERCIAL METALS CO	-	243	1,259	186,181	素材
COMMUNITY TRUST BANCORP INC	-	0.71	2	360	銀行
COMMVAULT SYSTEMS INC	2	38	264	39,121	ソフトウェア・サービス
COMPASS MINERALS INTERNATION	-	2	6	1,005	素材

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	
	百株	百株	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
COMPASS INC - CLASS A	96	-	-	-	不動産管理・開発
COMSTOCK RESOURCES INC	30	-	-	-	エネルギー
CONCERT PHARMACEUTICALS INC	7	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONDUENT INC	204	-	-	-	商業・専門サービス
CONNECTONE BANCORP INC	6	51	92	13,736	銀行
CONN'S INC	133	144	58	8,602	一般消費財・サービス流通・小売り
CONSTRUCTION PARTNERS INC-A	-	33	116	17,233	資本財
CONTAINER STORE GROUP INC/TH	11	55	11	1,757	一般消費財・サービス流通・小売り
CONTEXTLOGIC INC - A	417	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
COOPER-STANDARD HOLDING	-	21	33	4,932	自動車・自動車部品
CORCEPT THERAPEUTICS INC	184	177	585	86,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CORE MOLDING TECHNOLOGIES IN	-	2	7	1,039	素材
CORECIVIC INC	-	93	96	14,325	商業・専門サービス
COVENANT LOGISTICS GROUP INC	109	27	122	18,137	運輸
COWEN INC - A	17	-	-	-	金融サービス
CRAWFORD & COMPANY -CL A	37	43	43	6,410	保険
CROCS INC	58	35	313	46,404	耐久消費財・アパレル
CROSS COUNTRY HEALTHCARE INC	37	34	82	12,189	ヘルスケア機器・サービス
ARTIVION INC	80	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CULLINAN ONCOLOGY INC	21	43	44	6,585	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CUSTOMERS BANCORP INC	18	-	-	-	銀行
CYTOKINETICS INC	7	70	232	34,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DHI GROUP INC	-	24	7	1,075	メディア・娯楽
DANA INC	15	216	323	47,870	自動車・自動車部品
DAVE & BUSTER'S ENTERTAINMEN	25	-	-	-	消費者サービス
DAY ONE BIOPHARMACEUTICALS I	6	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DECIPHERA PHARMACEUTICALS IN	169	92	129	19,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DELEK US HOLDINGS INC	51	-	-	-	エネルギー
DENBURY INC	1	-	-	-	エネルギー
DENALI THERAPEUTICS INC	119	141	311	46,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIAMOND OFFSHORE DRILLING IN	156	-	-	-	エネルギー
DIGITAL TURBINE INC	95	-	-	-	ソフトウェア・サービス
DIGITALBRIDGE GROUP INC	22	-	-	-	不動産管理・開発
DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	-	16	38	5,679	ソフトウェア・サービス
DILLARDS INC-CL A	6	0.39	12	1,801	一般消費財・サービス流通・小売り
DIODES INC	-	2	19	2,904	半導体・半導体製造装置
DOMO INC - CLASS B	139	31	29	4,428	ソフトウェア・サービス
DONEGAL GROUP INC-CL A	29	3	4	732	保険
DUCOMMUN INC	-	44	198	29,324	資本財
DULUTH HOLDINGS INC - CL B	-	79	44	6,565	一般消費財・サービス流通・小売り
DUOLINGO	14	4	64	9,600	消費者サービス
DYNAVAX TECHNOLOGIES CORP	-	165	226	33,500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNE THERAPEUTICS INC	10	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELF BEAUTY INC	142	26	295	43,651	家庭用品・パーソナル用品

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	
EL POLLO LOCO HOLDINGS INC	-	92	83	12,283	消費者サービス
EAGLE PHARMACEUTICALS INC	4	9	15	2,264	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ECHOSTAR CORPORATION - A	35	157	293	43,430	電気通信サービス
ECOVYST INC	105	-	-	-	素材
EDITAS MEDICINE INC	138	15	12	1,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EHEALTH INC	22	67	45	6,716	保険
8X8 INC	-	317	79	11,746	ソフトウェア・サービス
EMBECTA CORP	-	2	3	587	ヘルスケア機器・サービス
EMCOR GROUP INC	80	50	1,084	160,319	資本財
EMERGENT BIOSOLUTIONS INC	78	313	117	17,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENANTA PHARMACEUTICALS INC	36	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENCORE CAPITAL GROUP INC	33	-	-	-	金融サービス
ENCORE WIRE CORP	11	30	551	81,591	資本財
ENCORE ENERGY CORP	-	82	25	3,833	エネルギー
ENERGY FUELS INC	50	-	-	-	エネルギー
ENERSYS	-	43	425	62,905	資本財
ENGAGESMART INC	65	202	364	53,929	ソフトウェア・サービス
ENOVA INTERNATIONAL INC	103	122	608	90,003	金融サービス
ENSIGN GROUP INC/THE	111	65	605	89,487	ヘルスケア機器・サービス
ENTEGRIS INC	7	-	-	-	半導体・半導体製造装置
ENTERPRISE BANCORP INC	-	8	22	3,371	銀行
ENTERPRISE FINANCIAL SERVICE	-	106	405	59,963	銀行
ENTRAVISION COMMUNICATIONS-A	69	46	17	2,565	メディア・娯楽
EPLUS INC	0.09	59	373	55,254	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESPERION THERAPEUTICS INC	60	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ETHAN ALLEN INTERIORS INC	31	7	22	3,334	耐久消費財・アパレル
EVENTBRITE INC-CLASS A	174	-	-	-	メディア・娯楽
EVERBRIDGE INC	-	47	111	16,513	ソフトウェア・サービス
EVERI HOLDINGS INC	3	163	233	34,556	消費者サービス
EVERQUOTE INC - CLASS A	12	-	-	-	メディア・娯楽
EVOLENT HEALTH INC - A	237	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
EXLSERVICE HOLDINGS INC	4	291	847	125,342	商業・専門サービス
EXP WORLD HOLDINGS INC	3	8	14	2,168	不動産管理・開発
EXPONENT INC	-	39	360	53,345	商業・専門サービス
EXPENSIFY INC - A	-	92	30	4,579	ソフトウェア・サービス
EXTREME NETWORKS INC	-	68	167	24,730	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EZCORP INC-CL A	15	670	527	78,018	金融サービス
FLYWIRE CORP-VOTING	20	-	-	-	金融サービス
FB FINANCIAL CORP	115	-	-	-	銀行
FIGS INC-CLASS A	-	91	53	7,835	耐久消費財・アパレル
FS BANCORP INC	5	7	23	3,451	銀行
FARMERS NATL BANC CORP	3	-	-	-	銀行
FASTLY INC - CLASS A	-	83	163	24,151	ソフトウェア・サービス
FATE THERAPEUTICS INC	139	456	107	15,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
FEDERAL AGRIC MTG CORP-CL C	76	-	-	-	-	金融サービス
FEDERAL SIGNAL CORP	-	31	186	27,512	-	資本財
FEDERATED HERMES INC	-	37	130	19,358	-	金融サービス
FIBROGEN INC	82	-	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FINANCIAL INSTITUTIONS INC	-	28	48	7,169	-	銀行
FIRST ADVANTAGE CORP	35	-	-	-	-	商業・専門サービス
FIRST BANCSHARES INC/MS	6	-	-	-	-	銀行
FIRST BANK/HAMILTON NJ	-	59	66	9,775	-	銀行
FIRST BUSINESS FINANCIAL SER	12	12	37	5,544	-	銀行
FIRST COMMONWEALTH FINL CORP	47	-	-	-	-	銀行
FIRST COMMUNITY BANKSHARES	32	-	-	-	-	銀行
FIRST FINL BANKSHARES INC	22	-	-	-	-	銀行
FIRST FINANCIAL NORTHWEST	174	134	169	25,042	-	銀行
FIRST FOUNDATION INC	18	-	-	-	-	銀行
FIRST INTERNET BANCORP	-	21	36	5,403	-	銀行
FIRST INTERSTATE BANCYSYS-A	-	96	241	35,718	-	銀行
FIRST MERCHANTS CORP	-	12	35	5,201	-	銀行
1ST SOURCE CORP	7	-	-	-	-	銀行
FIRSTCASH HOLDINGS INC	-	38	372	55,140	-	金融サービス
FLAGSTAR BANCORP INC	29	-	-	-	-	銀行
FLUOR CORP	74	86	330	48,811	-	資本財
FOOT LOCKER INC	7	-	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
FORMA THERAPEUTICS HOLDINGS	154	-	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORMFACTOR INC	-	40	137	20,300	-	半導体・半導体製造装置
FORWARD AIR CORP	8	-	-	-	-	運輸
FOSSIL GROUP INC	-	15	3	475	-	耐久消費財・アパレル
4D MOLECULAR THERAPEUTICS IN	6	-	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FOX FACTORY HOLDING CORP	8	1	14	2,142	-	自動車・自動車部品
FRANKLIN ELECTRIC CO INC	143	28	263	38,968	-	資本財
FRESHWORKS INC-CL A	-	43	87	12,982	-	ソフトウェア・サービス
FRONTDOOR INC	-	131	409	60,485	-	消費者サービス
H.B. FULLER CO.	91	-	-	-	-	素材
FULTON FINANCIAL CORP	397	-	-	-	-	銀行
GATX CORP	6	25	289	42,870	-	資本財
G1 THERAPEUTICS INC	57	-	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
G-III APPAREL GROUP LTD	57	-	-	-	-	耐久消費財・アパレル
GMS INC	34	49	317	46,932	-	資本財
GAIA INC	61	3	0	121	-	メディア・娯楽
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	121	-	-	-	-	保険
GENTHERM INC	-	36	210	31,075	-	自動車・自動車部品
GIBRALTAR INDUSTRIES INC	10	61	432	63,924	-	資本財
GLAUKOS CORP	4	8	65	9,667	-	ヘルスケア機器・サービス
GLOBAL BLOOD THERAPEUTICS IN	18	-	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL INDUSTRIAL CO	-	31	103	15,249	-	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		
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	52	83	104	15,407	自動車・自動車部品	
GOOSEHEAD INSURANCE INC -A	28	-	-	-	保険	
GOPRO INC-CLASS A	302	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
GOSSAMER BIO INC	91	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GRAY TELEVISION INC	-	8	5	881	メディア・娯楽	
GREIF INC-CL A	15	-	-	-	素材	
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	10	41	1,103	163,119	一般消費財・サービス流通・小売り	
GUARDANT HEALTH INC	-	84	233	34,585	ヘルスケア機器・サービス	
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	-	30	129	19,162	資本財	
HBT FINANCIAL INC/DE	175	154	279	41,295	銀行	
HACKETT GROUP INC/THE	74	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
HAIN CELESTIAL GROUP INC	53	-	-	-	食品・飲料・タバコ	
HALOZYME THERAPEUTICS INC	73	78	310	45,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAMILTON LANE INC-CLASS A	48	21	195	28,895	金融サービス	
HANCOCK WHITNEY CORP	276	205	772	114,205	銀行	
HANGER INC	13	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	32	95	350	51,852	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENVIRI CORP	-	35	26	3,925	商業・専門サービス	
HAVERTY FURNITURE	34	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り	
HEALTHCARE SERVICES GROUP	-	207	225	33,276	商業・専門サービス	
HEALTHSTREAM INC	-	26	56	8,324	ヘルスケア機器・サービス	
HEALTH CATALYST INC	102	58	60	8,985	ヘルスケア機器・サービス	
HEALTH EQUITY INC	75	17	124	18,366	ヘルスケア機器・サービス	
HEARTLAND FINANCIAL USA INC	211	347	1,030	152,420	銀行	
HEIDRICK & STRUGGLES INTL	5	-	-	-	商業・専門サービス	
HELIX ENERGY SOLUTIONS GROUP	108	251	268	39,748	エネルギー	
HELMERICH & PAYNE	22	83	374	55,329	エネルギー	
HERITAGE COMMERCE CORP	-	483	410	60,673	銀行	
HERC HOLDINGS INC	7	22	273	40,500	資本財	
HERITAGE FINANCIAL CORP	-	2	3	555	銀行	
HERON THERAPEUTICS INC	271	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HESKA CORP	22	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
HILTON GRAND VACATIONS INC	17	8	34	5,044	消費者サービス	
HIMS & HERS HEALTH INC	-	153	95	14,156	ヘルスケア機器・サービス	
HOMETRUST BANCSHARES INC	1	91	202	29,985	銀行	
HOOVER FURNISHINGS CORP	18	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
HORIZON BANCORP INC/IN	119	506	537	79,523	銀行	
HOSTESS BRANDS INC	276	61	205	30,404	食品・飲料・タバコ	
HOULIHAN LOKEY INC	75	93	1,021	151,025	金融サービス	
HUB GROUP INC-CL A	123	-	-	-	運輸	
HURON CONSULTING GROUP INC	-	16	170	25,235	商業・専門サービス	
IDT CORP-CLASS B	28	-	-	-	電気通信サービス	
HYLIION HOLDINGS CORP	156	-	-	-	資本財	
I-80 GOLD CORP	-	264	47	7,045	素材	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額 千米・ドル	邦貨換算金額 千円		
(アメリカ)	百株	百株				
IRHYTHM TECHNOLOGIES INC	10	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
IDEAYA BIOSCIENCES INC	—	21	62	9,267	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IHEARTMEDIA INC - CLASS A	60	—	—	—	—	メディア・娯楽
IKENA ONCOLOGY INC	4	4	2	318	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IMMUNOGEN INC	40	50	78	11,587	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INARI MEDICAL INC	—	19	127	18,852	—	ヘルスケア機器・サービス
INDEPENDENT BANK CORP - MICH	132	115	211	31,249	—	銀行
INDEPENDENT BANK GROUP INC	—	16	68	10,128	—	銀行
INFORMATION SERVICES GROUP	—	4	2	300	—	ソフトウェア・サービス
INGEVITY CORP	54	—	—	—	—	素材
INHIBRX INC	31	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSIGHT ENTERPRISES INC	64	26	399	59,077	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INSMED INC	87	19	52	7,732	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC	11	7	150	22,271	—	ヘルスケア機器・サービス
INOVIO PHARMACEUTICALS INC	308	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPERITY INC	140	95	910	134,662	—	商業・専門サービス
INSTALLED BUILDING PRODUCTS	13	16	210	31,184	—	耐久消費財・アパレル
INOZYME PHARMA INC	5	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTELLIA THERAPEUTICS INC	39	92	316	46,762	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTAPP INC	—	26	92	13,698	—	ソフトウェア・サービス
INTEGRAL AD SCIENCE HOLDING	—	40	49	7,333	—	メディア・娯楽
INTERCEPT PHARMACEUTICALS INC	81	81	89	13,257	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTERDIGITAL INC	—	0.01	0	12	—	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL MONEY EXPRESS	36	—	—	—	—	金融サービス
INTRA-CELLULAR THERAPIES INC	48	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INVESTAR HOLDING CORP	12	11	13	2,021	—	銀行
INVESTORS TITLE CO	2	2	39	5,793	—	保険
INVITAE CORP	212	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IRADIMED CORP	—	34	155	23,010	—	ヘルスケア機器・サービス
IRIDIUM COMMUNICATIONS INC	152	14	74	11,020	—	電気通信サービス
IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	243	304	281	41,690	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITEOS THERAPEUTICS INC	20	111	139	20,697	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITRON INC	34	55	345	51,119	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JANUS INTERNATIONAL GROUP IN	—	293	301	44,647	—	資本財
JELD-WEN HOLDING INC	91	271	371	54,980	—	資本財
JETBLUE AIRWAYS CORP	—	689	320	47,404	—	運輸
JOINT CORP/THE	—	13	13	1,965	—	ヘルスケア機器・サービス
KBR INC	62	47	287	42,560	—	商業・専門サービス
KAISER ALUMINUM CORP	—	9	73	10,907	—	素材
KALEYRA INC	11	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KARUNA THERAPEUTICS INC	8	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KARYOPHARM THERAPEUTICS INC	272	233	27	4,102	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KB HOME	—	29	142	21,105	—	耐久消費財・アパレル
KENNAMETAL INC	150	88	221	32,734	—	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	
	百株	百株	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
KENNEDY-WILSON HOLDINGS INC	171	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
KFORCE INC	78	—	—	—	商業・専門サービス
KIMBALL ELECTRONICS INC	—	118	331	48,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINSALE CAPITAL GROUP INC	11	15	654	96,729	保険
KNOWLES CORP	83	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KODIAK GAS SERVICES INC	—	65	114	16,957	エネルギー
KODIAK SCIENCES INC	150	194	40	6,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KONTOOR BRANDS INC	12	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KORN FERRY	17	14	70	10,477	商業・専門サービス
KRATOS DEFENSE AND SECURITY	86	—	—	—	資本財
KRONOS BIO INC	58	123	16	2,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KRYSTAL BIOTECH INC	—	1	17	2,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KULICKE & SOFFA INDUSTRIES	—	18	89	13,291	半導体・半導体製造装置
KURA ONCOLOGY INC	—	157	151	22,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KYMERA THERAPEUTICS INC	51	26	48	7,221	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LHC GROUP INC	16	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LGI HOMES INC	—	1	17	2,650	耐久消費財・アパレル
LCI INDUSTRIES	26	—	—	—	自動車・自動車部品
LI-CYCLE HOLDINGS CORP	—	7	3	481	商業・専門サービス
LSB INDUSTRIES INC	58	—	—	—	素材
LSI INDUSTRIES INC	54	—	—	—	資本財
LAKELAND BANCORP INC	136	136	174	25,843	銀行
LANCASTER COLONY CORP	19	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LANDS' END INC	—	34	23	3,517	一般消費財・サービス流通・小売り
LANTHEUS HOLDINGS INC	43	11	69	10,309	ヘルスケア機器・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	91	47	406	60,161	半導体・半導体製造装置
LAUREATE EDUCATION INC-A	367	674	938	138,745	消費者サービス
LEMAITRE VASCULAR INC	—	1	7	1,182	ヘルスケア機器・サービス
LENDINGCLUB CORP	68	—	—	—	金融サービス
LENDINGTREE INC	44	65	104	15,493	金融サービス
LIBERTY ENERGY INC	428	—	—	—	エネルギー
LIGAND PHARMACEUTICALS	—	11	75	11,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIONS GATE ENTERTAINMENT-A	16	54	46	6,837	メディア・娯楽
LIONS GATE ENTERTAINMENT-B	—	91	72	10,723	メディア・娯楽
LIVEPERSON INC	331	180	81	11,985	ソフトウェア・サービス
LIVENT CORP	112	—	—	—	素材
LIVERAMP HOLDINGS INC	124	35	108	15,986	ソフトウェア・サービス
MDC HOLDINGS INC	276	43	187	27,705	耐久消費財・アパレル
MGP INGREDIENTS INC	4	9	95	14,172	食品・飲料・タバコ
MRC GLOBAL INC	52	—	—	—	資本財
MVB FINANCIAL CORP	—	1	3	477	銀行
MYR GROUP INC/DELAWARE	14	44	610	90,206	資本財
MACROGENICS INC	199	54	25	3,701	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MACY'S INC	131	17	19	2,843	一般消費財・サービス流通・小売り

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	
	百株	百株	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
STEVEN MADDEN LTD	24	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MADRIGAL PHARMACEUTICALS INC	11	0.7	11	1,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	—	250	571	84,487	エネルギー
MANITOWOC COMPANY INC	151	182	277	41,053	資本財
MARCUS & MILLICHAP INC	180	—	—	—	不動産管理・開発
MARINEMAX INC	78	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MARQETA INC-A	286	169	105	15,569	金融サービス
MASONITE INTERNATIONAL CORP	6	—	—	—	資本財
MASTEC INC	28	—	—	—	資本財
MASTERCRAFT BOAT HOLDINGS IN	—	1	2	323	耐久消費財・アパレル
MATADOR RESOURCES CO	50	69	416	61,520	エネルギー
MATERION CORP	2	8	92	13,720	素材
MATRIX SERVICE CO	89	—	—	—	資本財
MATSON INC	54	54	473	70,053	運輸
MATTERPORT INC	203	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MAXLINEAR INC-CLASS A	63	142	308	45,542	半導体・半導体製造装置
MAYVILLE ENGINEERING CO INC	13	—	—	—	資本財
MCGRATH RENTCORP	—	34	351	51,970	資本財
MEDIFAST INC	16	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
MEDPACE HOLDINGS INC	2	4	109	16,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MERCANTILE BANK CORP	16	11	34	5,079	銀行
MERCHANTS BANCORP/IN	29	—	—	—	銀行
MERCURY GENERAL CORP	69	155	440	65,065	保険
MERIT MEDICAL SYSTEMS INC	93	125	867	128,253	ヘルスケア機器・サービス
MICROSTRATEGY INC-CL A	—	2	93	13,792	ソフトウェア・サービス
MIDLAND STATES BANCORP INC	71	173	362	53,651	銀行
MIDWESTONE FINANCIAL GROUP I	4	23	47	7,012	銀行
MIMEDX GROUP INC	—	84	66	9,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MIRUM PHARMACEUTICALS INC	41	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MISTRAS GROUP INC	4	8	4	668	商業・専門サービス
MODEL N INC	98	74	195	28,854	ソフトウェア・サービス
MODINE MANUFACTURING CO	68	53	239	35,361	自動車・自動車部品
MOELIS & CO - CLASS A	97	—	—	—	金融サービス
MOMENTIVE GLOBAL INC	71	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MONARCH CASINO & RESORT INC	—	42	275	40,724	消費者サービス
MOOG INC-CLASS A	74	—	—	—	資本財
MOTORCAR PARTS OF AMERICA IN	—	25	19	2,916	自動車・自動車部品
MUELLER INDUSTRIES INC	—	38	285	42,277	資本財
MULTIPLAN CORP	129	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MURPHY OIL CORP	142	321	1,452	214,707	エネルギー
MURPHY USA INC	39	15	539	79,771	一般消費財・サービス流通・小売り
MYRIAD GENETICS INC	46	5	10	1,521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NMI HOLDINGS INC-CLASS A	154	51	145	21,561	金融サービス
NGM BIOPHARMACEUTICALS INC	146	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期		業種等	
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千米・ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
NANOSTRING TECHNOLOGIES INC	62	49	7	1,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NATERA INC	18	4	24	3,630	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NATIONAL BANK HOLD-CL A	-	18	54	8,085	銀行
NATIONAL BEVERAGE CORP	-	13	62	9,195	食品・飲料・タバコ
NAVIENT CORP	274	-	-	-	金融サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	430	213	14	2,136	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEOGEN CORP	-	40	81	12,010	ヘルスケア機器・サービス
NEOGENOMICS INC	115	34	44	6,515	ヘルスケア機器・サービス
NETGEAR INC	-	46	58	8,656	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEUROPACE INC	2	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
NEVRO CORP	43	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
NEW JERSEY RESOURCES CORP	-	160	680	100,594	公益事業
NEXTIER OILFIELD SOLUTIONS I	59	-	-	-	エネルギー
NI HOLDINGS INC	-	16	21	3,192	保険
NEXTGEN HEALTHCARE INC	26	25	59	8,825	ヘルスケア機器・サービス
NEXTCURE INC	98	73	9	1,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NIOCORP DEVELOPMENTS LTD	-	5	2	362	素材
NKARTA INC	-	102	16	2,459	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHTRIM BANCORP INC	24	24	96	14,279	銀行
NORTHWESTERN CORP	69	-	-	-	公益事業
NOVAGOLD RESOURCES INC	144	353	145	21,458	素材
NOW INC	-	5	6	911	資本財
NUVASIVE INC	55	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
NURIX THERAPEUTICS INC	24	55	51	7,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NUVATION BIO INC	42	440	58	8,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OSI SYSTEMS INC	98	15	185	27,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHORD ENERGY CORP	31	7	109	16,225	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	340	-	-	-	エネルギー
OCEANFIRST FINANCIAL CORP	240	433	649	96,051	銀行
OIL-DRI CORP OF AMERICA	7	5	37	5,581	家庭用品・パーソナル用品
OIL STATES INTERNATIONAL INC	340	218	181	26,903	エネルギー
OLD NATIONAL BANCORP	100	-	-	-	銀行
OLEMA PHARMACEUTICALS INC	45	18	23	3,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OLYMPIC STEEL INC	64	26	136	20,188	素材
OMNICELL INC	-	34	190	28,224	ヘルスケア機器・サービス
ONE GAS INC	57	13	101	15,062	公益事業
1-800-FLOWERS.COM INC-CL A	123	232	152	22,474	一般消費財・サービス流通・小売り
ILIFE HEALTHCARE INC	102	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
OOMA INC	302	266	350	51,808	電気通信サービス
OPENDOOR TECHNOLOGIES INC	-	143	45	6,785	不動産管理・開発
OPEN LENDING CORP - CL A	264	-	-	-	金融サービス
OPORTUN FINANCIAL CORP	-	77	59	8,728	金融サービス
OPTION CARE HEALTH INC	265	67	230	34,150	ヘルスケア機器・サービス
ORASURE TECHNOLOGIES INC	241	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千米・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)	百株	百株			
ORIGIN BANCORP INC	47	-	-	-	銀行
ORTHOFIX MEDICAL INC	30	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
OSCAR HEALTH INC - CLASS A	262	192	117	17,439	保険
OVERSTOCK.COM INC	182	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
OVINTIV INC	101	52	248	36,684	エネルギー
PBF ENERGY INC-CLASS A	160	51	271	40,116	エネルギー
PC CONNECTION INC	95	71	382	56,502	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PGT INNOVATIONS INC	101	-	-	-	資本財
PNM RESOURCES INC	43	-	-	-	公益事業
PMV PHARMACEUTICALS INC	-	168	101	15,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRA GROUP INC	57	-	-	-	金融サービス
PTC THERAPEUTICS INC	78	66	171	25,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACIFIC BIOSCIENCES OF CALIF	160	196	184	27,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PACIRA BIOSCIENCES INC	-	58	196	29,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PAGERDUTY INC	212	-	-	-	ソフトウェア・サービス
PALOMAR HOLDINGS INC	-	8	46	6,910	保険
PAPA JOHN'S INTL INC	108	11	82	12,188	消費者サービス
PAR PACIFIC HOLDINGS INC	-	34	117	17,424	エネルギー
PARSONS CORP	81	-	-	-	資本財
PATRICK INDUSTRIES INC	24	-	-	-	自動車・自動車部品
PATTERSON COS INC	57	40	117	17,367	ヘルスケア機器・サービス
PATTERSON-UTI ENERGY INC	343	357	542	80,179	エネルギー
PAYLOCITY HOLDING CORP	4	-	-	-	商業・専門サービス
PEAPACK GLADSTONE FINL CORP	29	-	-	-	銀行
PERMIAN RESOURCES CORP	143	-	-	-	エネルギー
PERPETUA RESOURCES CORP	6	6	2	343	素材
PERSONALIS INC	383	510	66	9,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PETIQ INC	-	108	205	30,385	ヘルスケア機器・サービス
PHOTRONICS INC	179	100	198	29,369	半導体・半導体製造装置
PHREESIA INC	100	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
PIPER SANDLER COS	25	-	-	-	金融サービス
PLAYAGS INC	29	29	20	3,050	消費者サービス
PLEXUS CORP	-	0.94	8	1,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PLIANT THERAPEUTICS INC	50	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POINT BIOPHARMA GLOBAL INC	-	4	3	500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POLYMET MINING CORP	5	115	24	3,550	素材
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	172	60	265	39,312	公益事業
POSEIDA THERAPEUTICS INC	-	68	13	1,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POWER INTEGRATIONS INC	-	5	45	6,656	半導体・半導体製造装置
PREMIER FINANCIAL CORP	174	59	101	15,041	銀行
PRELUDE THERAPEUTICS INC	-	42	13	1,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRESTIGE CONSUMER HEALTHCARE	-	131	764	112,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRICESMART INC	-	0.77	5	879	生活必需品流通・小売り
PRIMORIS SERVICES CORP	-	46	155	22,964	資本財

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		
PRIMO WATER CORP	537	565	829	122,627	食品・飲料・タバコ	
PRIVIA HEALTH GROUP INC	1	64	146	21,618	ヘルスケア機器・サービス	
PROG HOLDINGS INC	44	67	217	32,157	金融サービス	
PROGRESS SOFTWARE CORP	45	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
PROGYNY INC	67	175	608	90,028	ヘルスケア機器・サービス	
PROS HOLDINGS INC	88	17	59	8,834	ソフトウェア・サービス	
PROPETRO HOLDING CORP	570	227	235	34,769	エネルギー	
PROTAGONIST THERAPEUTICS INC	-	3	6	1,027	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PROTO LABS INC	48	-	-	-	資本財	
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	108	94	28	4,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
QUAKER HOUGHTON	13	28	474	70,152	素材	
Q2 HOLDINGS INC	74	286	928	137,224	ソフトウェア・サービス	
QUALYS INC	8	14	220	32,648	ソフトウェア・サービス	
QUANEX BUILDING PRODUCTS	13	-	-	-	資本財	
QUINSTREET INC	58	40	35	5,270	メディア・娯楽	
RPC INC	-	52	46	6,916	エネルギー	
RMR GROUP INC/THE - A	64	2	7	1,064	不動産管理・開発	
RADIAN GROUP INC	156	25	68	10,062	金融サービス	
RADNET INC	-	74	210	31,103	ヘルスケア機器・サービス	
RAPID7 INC	118	91	423	62,549	ソフトウェア・サービス	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	-	-	-	金融サービス	
RAYONIER ADVANCED MATERIALS	-	57	16	2,468	素材	
ANYWHERE REAL ESTATE INC	105	252	192	28,474	不動産管理・開発	
REATA PHARMACEUTICALS INC-A	32	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RECURSION PHARMACEUTICALS-A	84	52	44	6,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGENXBIO INC	41	127	228	33,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGIONAL MANAGEMENT CORP	67	99	269	39,884	金融サービス	
RELAY THERAPEUTICS INC	88	91	84	12,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RELMADA THERAPEUTICS INC	10	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REMITLY GLOBAL INC	-	15	41	6,172	金融サービス	
REPLIGEN CORP	4	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UPBOUND GROUP INC	-	36	106	15,767	一般消費財・サービス流通・小売り	
REPAY HOLDINGS CORP	17	-	-	-	金融サービス	
REPLIMUNE GROUP INC	-	60	107	15,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REPUBLIC FIRST BANCORP INC	1,137	-	-	-	銀行	
RESOLUTE FOREST PRODUCTS	26	-	-	-	素材	
REVANCE THERAPEUTICS INC	108	9	12	1,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVOLUTION MEDICINES INC	27	13	42	6,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVOLVE GROUP INC	-	191	245	36,266	一般消費財・サービス流通・小売り	
REX AMERICAN RESOURCES CORP	-	11	45	6,791	エネルギー	
RIGEL PHARMACEUTICALS INC	699	626	68	10,189	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5	5	14	2,185	ソフトウェア・サービス	
RIVERVIEW BANCORP INC	803	582	338	50,097	銀行	
ROCKET PHARMACEUTICALS INC	111	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

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		
ROVER GROUP INC	-	53	33	4,945	消費者サービス	
RUSH ENTERPRISES INC-CL A	297	125	505	74,698	資本財	
RYERSON HOLDING CORP	-	45	136	20,189	素材	
SM ENERGY CO	156	201	790	116,921	エネルギー	
SPS COMMERCE INC	7	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
SPX TECHNOLOGIES INC	-	8	68	10,073	資本財	
SABRE CORP	45	-	-	-	消費者サービス	
SAIA INC	5	-	-	-	運輸	
SANA BIOTECHNOLOGY INC	69	8	3	534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SANDRIDGE ENERGY INC	15	-	-	-	エネルギー	
SANDY SPRING BANCORP INC	214	67	143	21,264	銀行	
SANGAMO BIOSCIENCES INC	403	640	54	8,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SANMINA CORP	90	176	936	138,511	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SATSUMA PHARMACEUTICALS INC	9	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCANSOURCE INC	198	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SCHNITZER STEEL INDS INC-A	37	93	263	38,903	素材	
SCHOLASTIC CORP	9	-	-	-	メディア・娯楽	
SCHOLAR ROCK HOLDING CORP	32	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHRODINGER INC	15	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
CONTRA SCILEX HOLDING CO	-	110	20	3,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCIPLAY CORP-CLASS A	-	0.42	0	141	メディア・娯楽	
EW SCRIPPS CO/THE-A	74	124	82	12,266	メディア・娯楽	
SEACOAST BANKING CORP/FL	-	29	66	9,902	銀行	
SEASPINE HOLDINGS CORP	7	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
SEER INC	-	320	77	11,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SELECTIVE INSURANCE GROUP	101	34	357	52,882	保険	
SELECTQUOTE INC	-	47	5	862	保険	
SEMTECH CORP	144	-	-	-	半導体・半導体製造装置	
SEMURUSH HOLDINGS INC-A	-	183	156	23,205	ソフトウェア・サービス	
SENSIENT TECHNOLOGIES CORP	33	-	-	-	素材	
SERES THERAPEUTICS INC	129	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHAKE SHACK INC - CLASS A	86	-	-	-	消費者サービス	
SHATTUCK LABS INC	6	6	1	164	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHOCKWAVE MEDICAL INC	29	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
SHORE BANCSHARES INC	-	64	69	10,319	銀行	
SHUTTERSTOCK INC	-	52	205	30,314	メディア・娯楽	
SHUTTLE PHARMACEUTICALS HOLD	10	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHYFT GROUP INC/THE	20	-	-	-	資本財	
SI-BONE INC	9	46	105	15,582	ヘルスケア機器・サービス	
SIERRA BANCORP	144	-	-	-	銀行	
SILICON LABORATORIES INC	106	15	178	26,461	半導体・半導体製造装置	
SILK ROAD MEDICAL INC	6	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
SIMPLY GOOD FOODS CO/THE	81	-	-	-	食品・飲料・タバコ	
SIMPSON MANUFACTURING CO INC	4	-	-	-	資本財	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千米・ドル	千円		
(アメリカ)						
SINCLAIR BROADCAST GROUP -A	29	—	—	—	—	メディア・娯楽
SINGULAR GENOMICS SYSTEMS IN	11	11	0	66	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SITEONE LANDSCAPE SUPPLY INC	26	—	—	—	—	資本財
SKYWEST INC	—	11	46	6,882	—	運輸
SOLARIS OILFIELD INFRAST-A	36	—	—	—	—	エネルギー
SOLID BIOSCIENCES INC	332	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOMALOGIC INC	—	92	21	3,136	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONIC AUTOMOTIVE INC-CLASS A	42	—	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
SORRENTO THERAPEUTICS INC	1,082	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTH PLAINS FINANCIAL INC	32	21	57	8,532	—	銀行
SOUTHERN FIRST BANCSHARES	—	43	116	17,257	—	銀行
SOUTHERN MISSOURI BANCORP	19	—	—	—	—	銀行
SOUTHWESTERN ENERGY CO	32	28	17	2,605	—	エネルギー
SOVOS BRANDS INC	—	18	41	6,173	—	食品・飲料・タバコ
SPARTANNASH CO	—	40	85	12,597	—	生活必需品流通・小売り
SPECTRUM PHARMACEUTICALS INC	607	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPIRIT AIRLINES INC	61	50	76	11,314	—	運輸
SPIRE INC	2	—	—	—	—	公益事業
SPRINGWORKS THERAPEUTICS INC	44	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPROUTS FARMERS MARKET INC	67	—	—	—	—	生活必需品流通・小売り
SPRINKLR INC-A	—	54	80	11,910	—	ソフトウェア・サービス
SPROUT SOCIAL INC - CLASS A	31	27	135	20,024	—	ソフトウェア・サービス
SQUARESPACE INC - CLASS A	—	63	185	27,354	—	ソフトウェア・サービス
STAAR SURGICAL CO	—	53	222	32,899	—	ヘルスケア機器・サービス
STANDARD MOTOR PRODS	—	2	9	1,396	—	自動車・自動車部品
STANDEX INTERNATIONAL CORP	7	—	—	—	—	資本財
STAR HOLDINGS	—	14	18	2,683	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
STEELCASE INC-CL A	200	131	115	17,087	—	商業・専門サービス
STEPAN CO	10	—	—	—	—	素材
STERLING INFRASTRUCTURE INC	—	15	114	16,999	—	資本財
STIFEL FINANCIAL CORP	161	—	—	—	—	金融サービス
STITCH FIX INC-CLASS A	133	191	65	9,665	—	一般消費財・サービス流通・小売り
STRATEGIC EDUCATION INC	14	—	—	—	—	消費者サービス
STRIDE INC	—	11	52	7,739	—	消費者サービス
SUMMIT FINANCIAL GROUP INC	1	3	8	1,195	—	銀行
SUMMIT MATERIALS INC -CL A	113	99	319	47,242	—	素材
SUMO LOGIC INC	24	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SUNCOKE ENERGY INC	72	—	—	—	—	素材
SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL	103	—	—	—	—	公益事業
SUNPOWER CORP	94	—	—	—	—	資本財
SUNOPTA INC	—	222	81	11,977	—	食品・飲料・タバコ
SUNRUN INC	18	—	—	—	—	資本財
SUPER MICRO COMPUTER INC	45	24	598	88,488	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC	88	176	501	74,172	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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		
SUTRO BIOPHARMA INC	85	191	71	10,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SYNAPTICS INC	17	20	175	25,895	半導体・半導体製造装置	
SYNDAX PHARMACEUTICALS INC	-	100	171	25,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRI POINTE HOMES INC	75	165	479	70,867	耐久消費財・アパレル	
TPI COMPOSITES INC	5	-	-	-	資本財	
TACTILE SYSTEMS TECHNOLOGY I	90	49	70	10,450	ヘルスケア機器・サービス	
TALOS ENERGY INC	80	-	-	-	エネルギー	
TARSUS PHARMACEUTICALS INC	9	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TAYLOR MORRISON HOME CORP-A	72	175	786	116,270	耐久消費財・アパレル	
TEGNA INC	127	93	141	20,921	メディア・娯楽	
TELADOC HEALTH INC	5	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	-	47	85	12,697	電気通信サービス	
TENAYA THERAPEUTICS INC	7	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TENABLE HOLDINGS INC	98	67	310	45,884	ソフトウェア・サービス	
TENNANT CO	13	28	217	32,139	資本財	
TEREX CORP	336	103	606	89,678	資本財	
TETRA TECH INC	15	-	-	-	商業・専門サービス	
TEXAS CAPITAL BANCSHARES INC	11	-	-	-	銀行	
TEXAS ROADHOUSE INC	82	47	478	70,697	消費者サービス	
TG THERAPEUTICS INC	-	25	24	3,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ODP CORP/THE	-	43	202	30,006	一般消費財・サービス流通・小売り	
THERMON GROUP HOLDINGS INC	-	69	192	28,453	資本財	
THRYV HOLDINGS INC	-	146	277	41,005	メディア・娯楽	
TIPTREE INC	-	57	94	13,998	保険	
TITAN INTERNATIONAL INC	42	-	-	-	資本財	
TONIX PHARMACEUTICALS HOLDIN	-	0.01	0	0	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TONIX PHARMACEUTICALS HOLDIN	0.01	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TOWNE BANK	94	7	16	2,481	銀行	
TRAVERE THERAPEUTICS INC	33	179	236	35,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TREEHOUSE FOODS INC	12	-	-	-	食品・飲料・タバコ	
TRICIDA INC	90	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRINET GROUP INC	12	5	63	9,404	商業・専門サービス	
TRINITY INDUSTRIES INC	-	19	47	7,066	資本財	
TRUECAR INC	240	240	57	8,534	メディア・娯楽	
TTEC HOLDINGS INC	-	10	26	3,883	商業・専門サービス	
TURNING POINT BRANDS INC	50	-	-	-	食品・飲料・タバコ	
2SEVENTY BIO INC	-	42	15	2,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TWIST BIOSCIENCE CORP	49	108	220	32,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
2U INC	148	86	23	3,421	消費者サービス	
UMB FINANCIAL CORP	23	13	80	11,917	銀行	
UFP INDUSTRIES INC	133	58	594	87,826	資本財	
USANA HEALTH SCIENCES INC	14	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品	
US SILICA HOLDINGS INC	-	212	294	43,541	エネルギー	
ULTRA CLEAN HOLDINGS	20	-	-	-	半導体・半導体製造装置	



銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額 千米・ドル	邦貨換算金額 千円		
(アメリカ)	百株	百株				
ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL INC	23	18	66	9,866		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIFI INC	-	1	1	192		耐久消費財・アパレル
UNISYS CORP	29	71	23	3,527		ソフトウェア・サービス
UNITED BANKSHARES INC	-	47	130	19,317		銀行
UNITED FIRE GROUP INC	3	-	-	-		保険
US CELLULAR CORP	7	24	101	15,015		電気通信サービス
UNIVEST FINANCIAL CORP	95	97	166	24,565		銀行
UPLAND SOFTWARE INC	-	89	36	5,327		ソフトウェア・サービス
URBAN OUTFITTERS INC	189	121	394	58,256		一般消費財・サービス流通・小売り
VANDA PHARMACEUTICALS INC	-	117	51	7,623		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VAREX IMAGING CORP	72	125	233	34,456		ヘルスケア機器・サービス
VARONIS SYSTEMS INC	267	135	425	62,882		ソフトウェア・サービス
VEECO INSTRUMENTS INC	8	-	-	-		半導体・半導体製造装置
V2X INC	41	-	-	-		資本財
VAXCYTE INC	-	21	106	15,757		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERACYTE INC	17	115	278	41,204		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERINT SYSTEMS INC	56	62	154	22,817		ソフトウェア・サービス
VERITEX HOLDINGS INC	9	9	17	2,576		銀行
VERICEL CORP	-	42	143	21,160		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTEX INC - CLASS A	-	38	79	11,722		ソフトウェア・サービス
VERVE THERAPEUTICS INC	5	-	-	-		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VICOR CORP	-	3	20	2,992		資本財
VICTORY CAPITAL HOLDING - A	-	49	165	24,461		金融サービス
VIMEO INC	189	519	188	27,888		メディア・娯楽
VIR BIOTECHNOLOGY INC	91	48	48	7,106		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIRTUS INVESTMENT PARTNERS	4	-	-	-		金融サービス
VISTEON CORP	35	59	821	121,476		自動車・自動車部品
VITAL FARMS INC	200	116	130	19,353		食品・飲料・タバコ
VIZIO HOLDING CORP-A	-	169	98	14,506		耐久消費財・アパレル
VOYAGER THERAPEUTICS INC	7	11	9	1,357		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WABASH NATIONAL CORP	-	67	150	22,197		資本財
WARBY PARKER INC-CLASS A	-	194	239	35,354		一般消費財・サービス流通・小売り
WASHINGTON FEDERAL INC	13	-	-	-		銀行
WASHINGTON TRUST BANCORP	-	46	123	18,232		銀行
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	83	54	954	141,161		資本財
WERNER ENTERPRISES INC	8	-	-	-		運輸
WESBANCO INC	187	7	16	2,504		銀行
WESCO INTERNATIONAL INC	36	-	-	-		資本財
WESCO INTERNATIONAL INC	23	23	63	9,447		資本財
WESTERN NEW ENGLAND BANCORP	-	4	2	416		銀行
WEWORK INC-CL A	-	38	15	2,324		不動産管理・開発
WHEELS UP EXPERIENCE INC	628	-	-	-		運輸
WINGSTOP INC	38	17	296	43,845		消費者サービス
WINMARK CORP	-	1	45	6,785		一般消費財・サービス流通・小売り

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		
WINNEBAGO INDUSTRIES	38	0.91	5	829	自動車・自動車部品	
WINTRUST FINANCIAL CORP	13	-	-	-	銀行	
WORKIVA INC	49	6	64	9,579	ソフトウェア・サービス	
WORLD KINECT CORP	55	227	512	75,776	エネルギー	
XENCOR INC	-	96	203	30,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
XYLEM INC	-	24	233	34,449	資本財	
XEROX HOLDINGS CORP	98	67	107	15,956	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XERIS BIOPHARMA HOLDINGS INC	13	13	2	403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YELP INC	20	172	742	109,793	メディア・娯楽	
YEET INC	302	3	2	318	ソフトウェア・サービス	
ZENTALIS PHARMACEUTICALS INC	7	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZETA GLOBAL HOLDINGS CORP-A	32	183	146	21,676	ソフトウェア・サービス	
ZIPRECRUITER INC-A	12	165	248	36,792	メディア・娯楽	
ZUMIEZ INC	-	111	189	28,005	一般消費財・サービス流通・小売り	
ZUORA INC - CLASS A	-	292	252	37,283	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLIUM SE	260	-	-	-	素材	
ADIANT PLC	24	100	379	56,119	自動車・自動車部品	
ALKERMES PLC	115	141	422	62,459	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMBARELLA INC	10	41	234	34,667	半導体・半導体製造装置	
ARGO GROUP INTERNATIONAL	-	14	44	6,526	保険	
BABYLON HOLDINGS LTD- CL A	59	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
BEYONDSRING INC	8	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOHAVEN PHARMACEUTICAL HOLD	28	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIT DIGITAL INC	-	160	37	5,611	ソフトウェア・サービス	
BORR DRILLING LTD	330	358	263	38,961	エネルギー	
CIMPRESS PLC	-	5	35	5,231	商業・専門サービス	
CUSHMAN & WAKEFIELD PLC	93	-	-	-	エクイティ不動産投資信託(REIT)	
ESSENT GROUP LTD	377	12	64	9,534	金融サービス	
FABRINET	-	26	397	58,818	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FRESH DEL MONTE PRODUCE INC	-	37	94	14,022	食品・飲料・タバコ	
GOLDEN OCEAN GROUP LTD	113	-	-	-	運輸	
GAMBLING.COM GROUP LTD	-	30	39	5,899	メディア・娯楽	
HELEN OF TROY LTD	-	4	48	7,136	耐久消費財・アパレル	
HERBALIFE NUTRITION LTD	273	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品	
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOG	332	-	-	-	消費者サービス	
KINIKSA PHARMACEUTICALS-A	116	12	21	3,127	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIVANOVA PLC	13	41	234	34,740	ヘルスケア機器・サービス	
NABORS INDUSTRIES LTD	26	-	-	-	エネルギー	
NORDIC AMERICAN TANKERS LTD	120	120	47	6,995	エネルギー	
NOBLE CORP	57	-	-	-	エネルギー	
PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A	-	251	217	32,140	金融サービス	
PATRIA INVESTMENTS LTD-A	-	116	173	25,634	金融サービス	
PAYSAFE LTD	417	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
PROTHENA CORP PLC	-	3	19	2,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)	当期			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千米・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)	百株	百株			
SFL CORP LTD	—	53	57	8,569	エネルギー
SAPIENS INTERNATIONAL CORP	—	31	94	13,936	ソフトウェア・サービス
SIGNET JEWELERS LTD	97	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
STONECO LTD-A	702	367	402	59,469	金融サービス
SUPER GROUP SGHC LTD	—	71	25	3,788	消費者サービス
THERAVANCE BIOPHARMA INC	59	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIBERTY LATIN AMERIC-CL A	38	41	34	5,105	電気通信サービス
TRONOX HOLDINGS PLC- A	56	—	—	—	素材
GOLAR LNG LTD	58	—	—	—	エネルギー
VALARIS LTD	13	—	—	—	エネルギー
CAESARSTONE LTD	68	65	27	4,093	資本財
UROGEN PHARMA LTD	21	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONESP WORLD HOLDINGS LTD	123	33	38	5,645	消費者サービス
ARDMORE SHIPPING CORP	203	159	200	29,707	エネルギー
DHT HOLDINGS INC	103	308	293	43,331	エネルギー
GENCO SHIPPING & TRADING LTD	46	—	—	—	運輸
NAVIGATOR HOLDINGS LTD	33	33	46	6,892	エネルギー
SCORPIO TANKERS INC	95	32	168	24,840	エネルギー
TEEKAY TANKERS LTD-CLASS A	70	6	24	3,620	エネルギー
通貨小計	株数、金額 銘柄数(比率)	56,747 616銘柄	48,518 575銘柄	101,366 (92.0%)	
合計	株数、金額 銘柄数(比率)	56,747 616銘柄	48,518 575銘柄	— (92.0%)	

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

(注2) 〈 〉内は、期末の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## (2) 外国投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	口数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨	邦貨		
(アメリカ)	千口	千口	千米・ドル	千円		
ACADIA REALTY TRUST	24	18	289	42,805		
ALEXANDER & BALDWIN INC	3	-	-	-		
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8	26	547	80,965		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	-	13	221	32,781		
ARBOR REALTY TRUST INC	33	-	-	-		
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4	0.527	5	875		
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	84	-	-	-		
BRANDYWINE REALTY TRUST	-	8	41	6,191		
CHATHAM LODGING TRUST	-	21	210	31,162		
COPT DEFENSE PROPERTIES	21	28	727	107,517		
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	-	11	25	3,810		
EASTGROUP PROPERTIES INC	1	-	-	-		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	11	-	-	-		
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	11	-	-	-		
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1	-	-	-		
GREAT AJAX CORP	9	9	65	9,657		
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	-	4	120	17,852		
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4	1	14	2,108		
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	-	20	141	20,899		
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	-	28	443	65,522		
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	-	19	68	10,194		
KITE REALTY GROUP TRUST	1	22	510	75,400		
LADDER CAPITAL CORP-REIT	-	7	81	12,120		
MACERICH CO/THE	9	-	-	-		
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2	-	-	-		
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.61	4	142	21,038		
NEXPOINT REAL ESTATE FINANCE	0.086	-	-	-		
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	-	2	13	2,017		
OUTFRONT MEDIA INC	98	32	347	51,375		
PARAMOUNT GROUP INC	44	53	282	41,742		
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2	-	-	-		
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	-	23	143	21,215		
RLJ LODGING TRUST	-	95	946	139,944		
RPT REALTY	4	7	82	12,161		
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.938	-	-	-		

銘柄	期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米・ドル	千円	
SITE CENTERS CORP	2	-	-	-	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	6	-	-	-	
TERRENO REALTY CORP	11	-	-	-	
WASHINGTON REIT	-	4	60	8,972	
通貨小計	口数・金額	407	468	5,535	818,334
	銘柄数・比率	26銘柄	24銘柄	-	<5.0%>
合計	口数・金額	407	468	-	818,334
	銘柄数・比率	26銘柄	24銘柄	-	<5.0%>

(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) < >は純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

### (3) 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 RUSSELL 2000 MINI	百万円 354	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、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) 評価額の単位未満は切捨て。

## ◇資産状況

## ■投資信託財産の構成

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	14,986,080	91.0
投 資 証 券	818,334	5.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	657,171	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	16,461,586	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(16,288,575千円)の投資信託財産総額(16,461,586千円)に対する比率は、98.9%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=147.84円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,619,466,004円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	477,713,183
株 式(評価額)	14,986,080,249
投 資 証 券(評価額)	818,334,525
未 収 入 金	297,721,244
未 収 配 当 金	11,006,067
差 入 委 託 証 拠 金	28,610,736
(B) 負 債	322,222,504
未 払 金	306,354,585
未 払 解 約 金	15,867,919
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,297,243,500
元 本	7,993,167,314
次 期 繰 越 損 益 金	8,304,076,186
(D) 受 益 権 総 口 数	7,993,167,314口
1万口当り基準価額(C/D)	20,389円

&lt;注記事項&gt;

期首元本額	10,406,048,240円
期中追加設定元本額	689,303,604円
期中一部解約元本額	3,102,184,530円

期末における元本の内訳

ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)	5,251,232,701円
ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)	2,741,934,613円
合計	7,993,167,314円

## ■損益の状況

自2022年9月21日 至2023年9月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	246,013,339円
受 取 配 当 金	239,928,925
受 取 利 息	3,665,029
そ の 他 収 益 金	2,419,385
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	748,960,876
売 買 益	4,352,902,417
売 買 損	△3,603,941,541
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 25,115,769
取 引 益	116,542,244
取 引 損	△ 141,658,013
(D) そ の 他 費 用	△ 8,476,263
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	961,382,183
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	9,571,556,267
(G) 解 約 差 損 益 金	△2,842,134,832
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	613,272,568
(I) 合 計(E+F+G+H)	8,304,076,186
次 期 繰 越 損 益 金(I)	8,304,076,186

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益及び先物取引等損益は、期末の評価換えによるものを含まず。

(注2) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。