

○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	無期限	
運用方針	<ul style="list-style-type: none">・米国の株式を主要投資対象としたマザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にS&P500指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。・外貨建資産およびマザーファンド受益証券組入れに伴う実質的な組入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。	
主要運用対象	ベビーフンド	米国株式インデックス・マザーファンド受益証券
	マザーファンド	米国の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます)
組入制限	ベビーフンド	<ul style="list-style-type: none">・マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。・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。
	マザーファンド	<ul style="list-style-type: none">・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	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。</p> <p>①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等全額とします。</p> <p>②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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もあります。</p> <p>③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

米国株式インデックス・ファンド

第6期 運用報告書(全体版)
(決算日 2023年3月10日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申しあげます。
この度、「米国株式インデックス・ファンド」は、2023年3月10日に第6期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。
今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間(営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番地1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			<ベンチマーク> S&P500 指数		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(円ベース)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期('19年3月11日)	10,961	0	3.4	11,068	4.2	95.5	4.3	1,601
3期('20年3月10日)	10,342	0	△ 5.6	10,520	△ 5.0	94.7	5.3	2,495
4期('21年3月10日)	15,516	0	50.0	15,879	50.9	98.0	1.7	6,857
5期('22年3月10日)	18,443	0	18.9	18,995	19.6	93.2	6.6	24,225
6期('23年3月10日)	19,980	0	8.3	20,747	9.2	94.8	5.1	52,377

(注1) ベンチマークは、S&P500指数(円ベース)で、スタンダード・アンド・プアーズが公表するS&P500指数をもとに、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券および投資証券を含みます。

(注3) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		<ベンチマーク> S&P500 指数		株式 組入比率	株式 先物比率
		騰落率	(円ベース)	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
'22年3月10日	18,443	-	18,995	-	93.2	6.6
3月末	20,943	13.6	21,577	13.6	94.0	6.1
4月末	20,050	8.7	20,668	8.8	92.8	7.5
5月末	19,847	7.6	20,475	7.8	91.4	8.6
6月末	19,446	5.4	20,074	5.7	93.3	6.8
7月末	20,432	10.8	21,105	11.1	97.1	3.3
8月末	20,615	11.8	21,310	12.2	95.8	4.7
9月末	19,684	6.7	20,362	7.2	91.9	9.0
10月末	21,605	17.1	22,362	17.7	96.0	3.0
11月末	20,553	11.4	21,288	12.1	93.5	7.3
12月末	19,112	3.6	19,817	4.3	93.2	7.3
'23年1月末	19,621	6.4	20,359	7.2	96.5	1.1
2月末	20,344	10.3	21,120	11.2	95.4	5.1
(期末)						
'23年3月10日	19,980	8.3	20,747	9.2	94.8	5.1

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、S&P500指数(円ベース)で、スタンダード・アンド・プアーズが公表するS&P500指数をもとに、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券および投資証券を含みます。

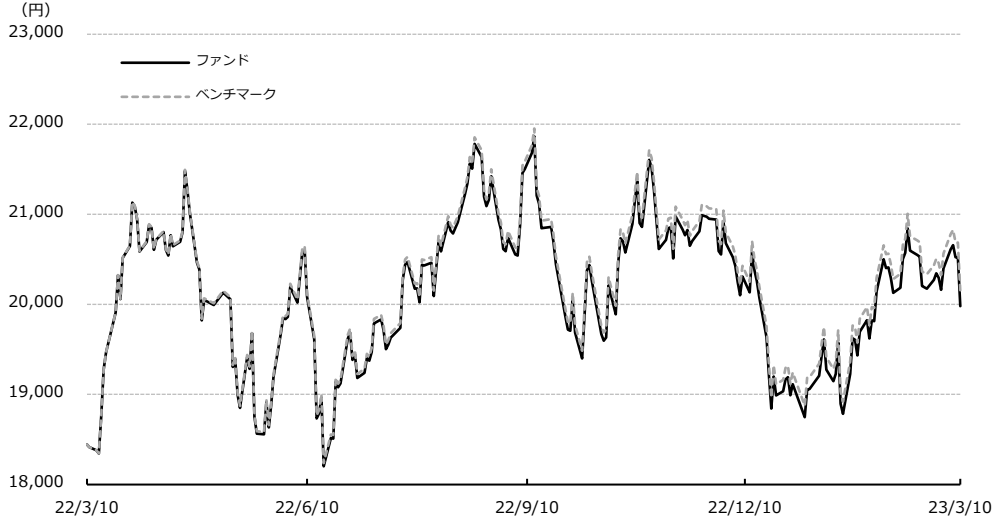
(注4) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

当期の運用実績

(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはS&P500指数(円ベース)で、前期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化したものです。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第6期	18,443円	19,980円	0円	+8.3%	+9.2%

当期末の基準価額は19,980円となり、前期末の18,443円に比べて1,537円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(S&P500指数(円ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。詳しくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+8.3%となり、ベンチマークの騰落率(+9.2%)を0.9%下回りました。
主な要因は以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、見送りとしております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

投資環境

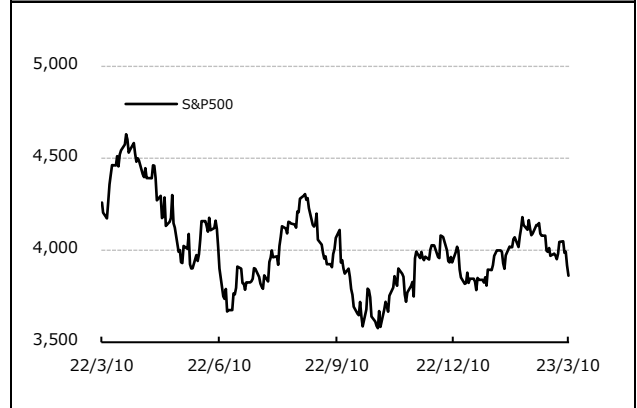
(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

米国株式市場

米国株式市場は下落しました。

期前半は、世界的なインフレ進行への懸念や米国の早期利上げ観測、ウクライナ情勢の緊迫化を受けて大幅下落となった後、底堅い企業業績などを背景に切り返しました。期後半は、米連邦準備理事会(FRB)のタカ派姿勢が鮮明となったことなどが嫌気され反落しましたが、その後は米利上げペースの減速期待や企業業績の改善期待などが相場を支え一進一退の展開となりました。

米国株式指数の推移

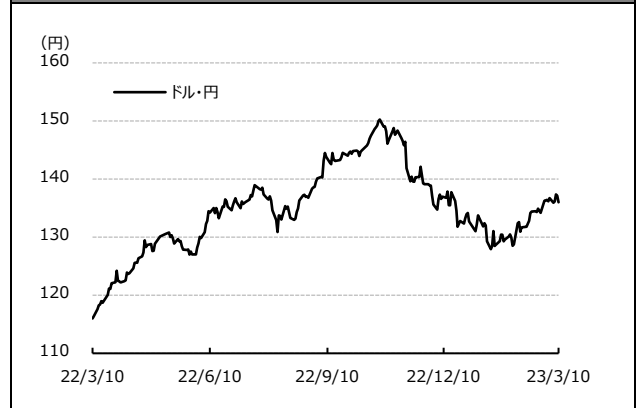


為替市況

ドル・円相場は、円安ドル高となりました。

FRBが積極的な金融引き締め継続姿勢を示す一方、日銀は現行の金融緩和政策方針を維持していることから、日米の金融政策方針の違いと金利差の拡大を背景に円安ドル高が進みました。前期末に116円台であった米ドル・円は136円台への円安ドル高となりました。

ドル・円相場の推移



運用の概況

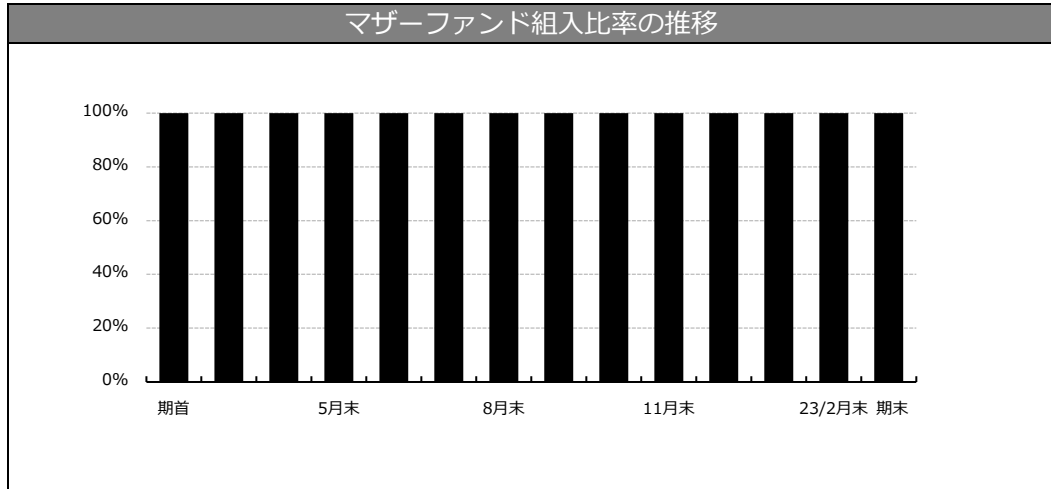
(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

当ファンドは「米国株式インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ち、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。

マザーファンドは、米国の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます)を主要投資対象とし、中長期的にS&P500指数(円ベース)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行う事を基本的な運用方針としています。株式への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

マザーファンドの組入状況

当期も、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。



今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、米国の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます)に投資することにより、実質株式組入比率を高水準に保ちつつ広く分散投資を行い、S&P500指数(円ベース)に対する連動性を最大限高める運用を継続してまいります。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年3月11日~2023年3月10日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	20,187円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	100円	0.495%	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投 信 会 社)	(44)	(0.220)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(49)	(0.242)	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)	(7)	(0.033)	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	1	0.003	(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
(株 式)	(0)	(0.001)	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
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(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
(株 式)	(0)	(0.000)	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
(d) その他費用	8	0.039	(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)	(0.029)	・ 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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(2)	(0.010)	・ 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、コーポレートアクションに伴う税金、海外金融先物取引で発生する利息費用、LEI 支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	109円	0.537%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)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2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

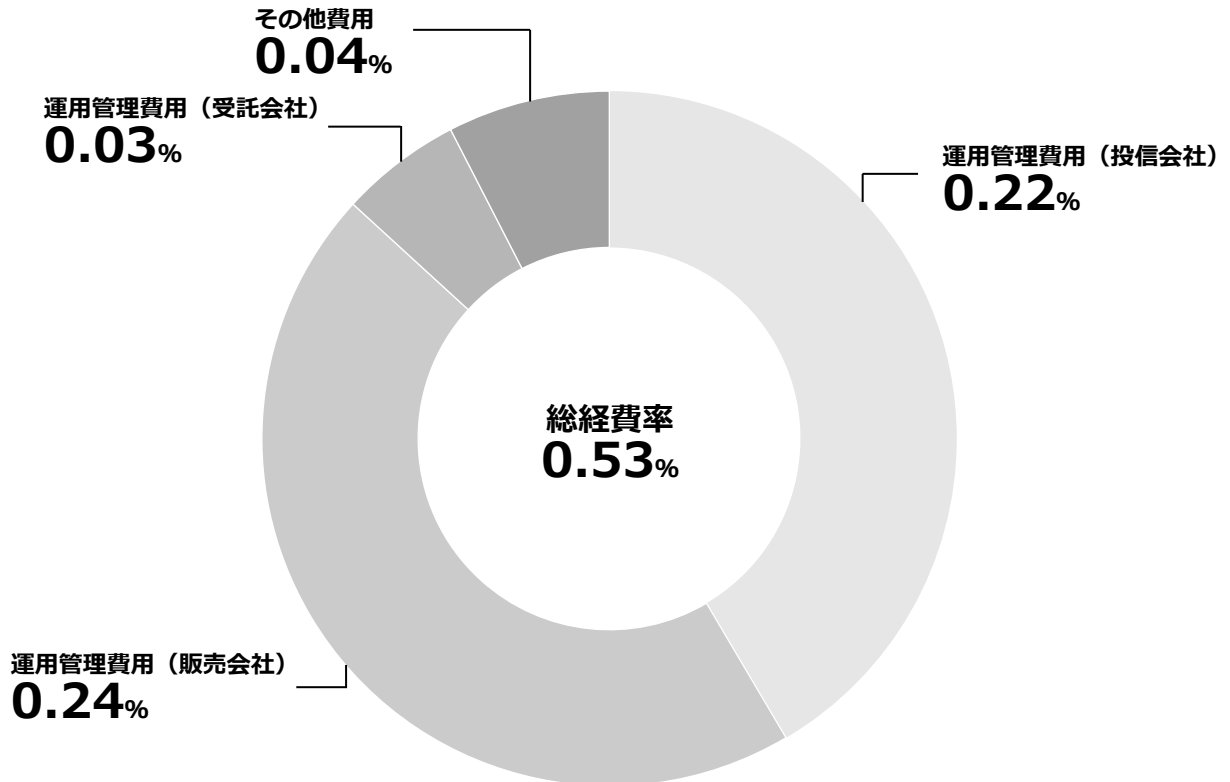
(注3) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(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**0.53%**です。



(注1) 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。

(注4) 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。

◎売買および取引の状況('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
米国株式インデックス・マザーファンド	6,698,128	29,048,400	692,922	3,103,400

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎株式売買比率

○株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

米国株式インデックス・マザーファンド

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	28,559,261 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	45,752,282 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.62

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の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金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○外国株式(米国株式インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付	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
APPLE INC(アメリカ)	87	1,713,942	19,489	APPLE INC(アメリカ)	4	100,815	23,229	
MICROSOFT CORP(アメリカ)	45	1,544,662	33,812	MICROSOFT CORP(アメリカ)	2	81,626	38,503	
AMAZON COM INC(アメリカ)	46	827,542	17,744	AMAZON COM INC(アメリカ)	2	45,799	18,467	
TESLA INC(アメリカ)	13	555,184	40,559	CHEVRON CORPORATION(アメリカ)	1	29,162	22,261	
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	26	513,689	19,552	TESLA INC(アメリカ)	0.24	28,936	120,568	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B(アメリカ)	10	436,827	39,871	ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	1	27,238	15,836	
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	21	428,980	19,841	ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	1	25,043	15,951	
UNITED HEALTH GROUP INC(アメリカ)	5	384,020	67,089	ABIOMED INC(アメリカ)	0.457	23,105	50,559	
JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	16	366,991	22,804	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B(アメリカ)	0.51	20,410	40,019	
NVIDIA CORP(アメリカ)	15	364,127	23,710	UNITED HEALTH GROUP INC(アメリカ)	0.27	20,382	75,491	

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

◎利害関係人との取引状況等('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○当期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

○利害関係人の発行する有価証券等

米国株式インデックス・マザーファンド

種 類	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株 式	百万円 23	百万円 1	百万円 55

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、STATE STREET CORPです。

◎組入資産の明細('23年3月10日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米 国 株 式 イン デ ッ ク ス ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 6,091,141	千口 12,096,347	千円 52,374,765

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における米国株式インデックス・マザーファンド全体の口数は14,359,629千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('23年3月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米 国 株 式 イン デ ッ ク ス ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 52,374,765	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	201,142	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	52,575,907	100.0

(注1) 外貨建資産は、当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米ドル=136.01円です。

(注2) 米国株式インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(60,436,737千円)の投資信託財産総額(65,535,746千円)に対する比率は92.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年3月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	52,575,907,813
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	201,142,694
米国株式インデックス・マザーファンド(評価額)	52,374,765,119
(B)負 債	198,329,751
未 払 解 約 金	86,433,605
未 払 信 託 報 酬	109,695,518
未 払 利 息	532
そ の 他 未 払 費 用	2,200,096
(C)純 資 産 総 額(A - B)	52,377,578,062
元 本	26,215,091,207
次 期 繰 越 損 益 金	26,162,486,855
(D)受 益 権 総 口 数	26,215,091,207口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D×10,000)	19,980円

(注) 期首元本額	13,135,140,947円
期中追加設定元本額	18,485,068,557円
期中一部解約元本額	5,405,118,297円

◎損益の状況

当期 (自'22年3月11日 至'23年3月10日)

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	△ 97,147
支 払 利 息	△ 97,147
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,400,566,755
売 買 益	2,195,838,184
売 買 損	△ 795,271,429
(C)信 託 報 酬 等	△ 194,898,280
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	1,205,571,328
(E)前 期 繰 越 損 益 金	962,652,789
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	23,994,262,738
(配 当 等 相 当 額)	(7,980,231,623)
(売 買 損 益 相 当 額)	(16,014,031,115)
(G) 計 (D + E + F)	26,162,486,855
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	26,162,486,855
追 加 信 託 差 損 益 金	23,994,262,738
(配 当 等 相 当 額)	(8,025,295,993)
(売 買 損 益 相 当 額)	(15,968,966,745)
分 配 準 備 積 立 金	2,168,224,117

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
(注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
(注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	491,905,646円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	713,665,682円
C	収益調整金	23,994,262,738円
D	分配準備積立金	962,652,789円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	26,162,486,855円
F	分配対象収益 (1 万口当たり)	9,979円
G	分配金	0円
H	分配金 (1 万口当たり)	0円

◎1 万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第 6 期 (2022 年 3 月 11 日～ 2023 年 3 月 10 日)
当期分配金	- 円
(対基準価額比率)	- %
当期の収益	- 円
当期の収益以外	- 円
翌期繰越分配対象額	9,979 円

- (注1) 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2) 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。

◎約款変更のお知らせ

信託財産留保額の撤廃に伴い、2022 年 6 月 11 日付で信託約款に所要の変更を行いました。

米国株式インデックス・マザーファンド

第 16 期 運用報告書 (決算日 2023 年 3 月 10 日)

米国株式インデックス・マザーファンドの
第 16 期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・米国の証券取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)を主要投資対象とし、S&P500指数(円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・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。
主要運用対象	米国の証券取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目 23 番地 1 号 虎ノ門ヒルズ森タワー 25 階

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		<ベンチマーク> S&P500 指数		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	期中 騰落率	(円ベース)	期中 騰落率	(円ベース)			
12期('19年3月11日)	円	%			%	%	百万円
12期('19年3月11日)	23,311	3.9	24,057	4.2	95.5	4.3	9,468
13期('20年3月10日)	22,095	△ 5.2	22,866	△ 5.0	94.7	5.3	20,404
14期('21年3月10日)	33,302	50.7	34,515	50.9	98.0	1.7	14,548
15期('22年3月10日)	39,769	19.4	41,287	19.6	93.2	6.6	33,050
16期('23年3月10日)	43,298	8.9	45,096	9.2	94.8	5.1	62,174

(注1) ベンチマークは、スタンダード・アンド・プアーズが公表するS&P500指数をもとに、ファンド設定日の翌営業日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券および投資証券を含みます。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		<ベンチマーク> S&P500 指数		株式 組入比率	株式 先物比率
	騰落率	(円ベース)	騰落率	(円ベース)		
(期首)	円	%			%	%
'22年3月10日	39,769	-	41,287	-	93.2	6.6
3月末	45,173	13.6	46,900	13.6	94.0	6.1
4月末	43,261	8.8	44,923	8.8	92.8	7.5
5月末	42,843	7.7	44,503	7.8	91.4	8.6
6月末	41,994	5.6	43,633	5.7	93.3	6.8
7月末	44,140	11.0	45,874	11.1	97.1	3.3
8月末	44,557	12.0	46,319	12.2	95.8	4.7
9月末	42,562	7.0	44,258	7.2	91.9	9.0
10月末	46,735	17.5	48,606	17.7	96.0	3.0
11月末	44,478	11.8	46,270	12.1	93.5	7.3
12月末	41,378	4.0	43,075	4.3	93.2	7.3
'23年1月末	42,499	6.9	44,252	7.2	96.5	1.1
2月末	44,080	10.8	45,907	11.2	95.4	5.1
(期末)						
'23年3月10日	43,298	8.9	45,096	9.2	94.8	5.1

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、スタンダード・アンド・プアーズが公表するS&P500指数をもとに、ファンド設定日の翌営業日を10,000として委託会社が独自に円換算して指数化したものです。なお円換算にあたっては、対顧客電信売買相場の仲値を使用しています。

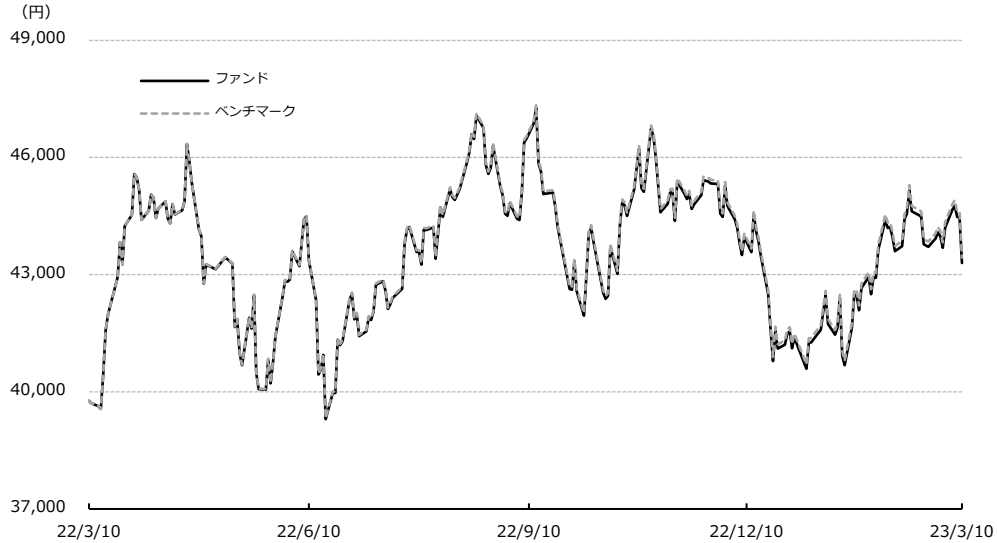
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券および投資証券を含みます。

(注4) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはS&P500指数(円ベース)で、前期末の基準価額にあわせて指数化しています。

当期末の基準価額は43,298円となり、前期末の39,769円に比べて3,529円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(S&P500 指数(円ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+8.9%となり、ベンチマークの騰落率(+9.2%)を0.4%下回りました。主な要因は以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

投資環境

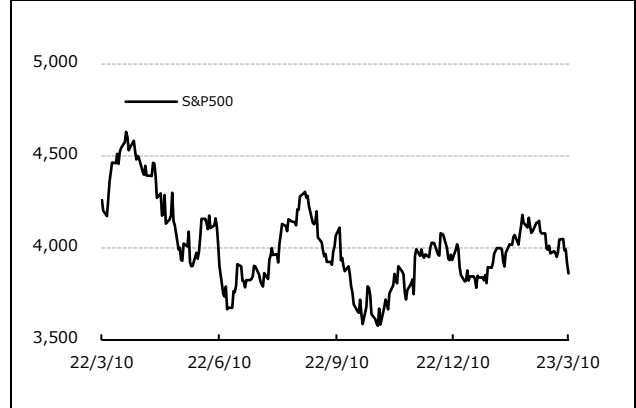
(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

米国株式市場

米国株式市場は下落しました。

期前半は、世界的なインフレ進行への懸念や米国の早期利上げ観測、ウクライナ情勢の緊迫化を受けて大幅下落となった後、底堅い企業業績などを背景に切り返しました。期後半は、米連邦準備理事会(FRB)のタカ派姿勢が鮮明となったことなどが嫌気され反落しましたが、その後は米利上げペースの減速期待や企業業績の改善期待などが相場を支え一進一退の展開となりました。

米国株式指数の推移



為替市況

ドル・円相場は、円安ドル高となりました。

FRBが積極的な金融引き締め継続姿勢を示す一方、日銀は現行の金融緩和政策方針を維持していることから、日米の金融政策方針の違いと金利差の拡大を背景に円安ドル高が進みました。前期末に116円台であった米ドル・円は136円台への円安ドル高となりました。

ドル・円相場の推移



運用の概況

(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

当マザーファンドは、当期につきましても、米国の証券取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)を主要投資対象とし、S&P500指数(円ベース)に連動した投資成果となるように現物株式ポートフォリオを構築しました。株式の組入比率は原則として高位を維持し、また外貨建資産の為替リスクは原則としてヘッジを行っておりません。

S&P500指数の銘柄入れ替え・比率変更時には適宜ポートフォリオの見直しを行いました。日次でキャッシュ比率のモニターを行い、未収配当金の積み上がりなどによるキャッシュ比率の増加には先物を買建てることにより対応しました。

その他、コーポレートアクションなどによる指数構成銘柄の異動には、個別銘柄の取引で対応しました。

今後の運用方針

今後も引き続き、主として米国の証券取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)に投資することにより、実質株式組入比率を高水準に保ちつつ広く分散投資を行い、S&P500指数(円ベース)に対する連動性を最大限高める運用を継続してまいります。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年3月11日~2023年3月10日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	43,641円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 売買委託手数料	2円	0.003%	(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
(株 式)	(1)	(0.001)	
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	0	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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	13	0.029	(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)	(12)	(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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	・ その他は、コーポレートアクションに伴う税金、海外金融先物取引で発生する利息費用、LEI 支払手数料及び金銭信託手数料
合 計	15円	0.032%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)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2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		18,579	194,858	962	10,251
		(2,334)	(2,732)	(294)	(3,458)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

○投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百口	千米ドル	百口	千米ドル
		780	6,128	41	303
		(18)	(212)	(38)	(212)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。ただし、口数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

○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	百万円	百万円	百万円
		47,393	46,180	-	-

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 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)のわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎株式売買比率

○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	28,559,261 千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	45,752,282 千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.62

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は、各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の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金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○外国株式

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
APPLE INC(アメリカ)	87	1,713,942	19,489	APPLE INC(アメリカ)	4	100,815	23,229
MICROSOFT CORP(アメリカ)	45	1,544,662	33,812	MICROSOFT CORP(アメリカ)	2	81,626	38,503
AMAZON COM INC(アメリカ)	46	827,542	17,744	AMAZON COM INC(アメリカ)	2	45,799	18,467
TESLA INC(アメリカ)	13	555,184	40,559	CHEVRON CORPORATION(アメリカ)	1	29,162	22,261
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	26	513,689	19,552	TESLA INC(アメリカ)	0.24	28,936	120,568
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B(アメリカ)	10	436,827	39,871	ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	1	27,238	15,836
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	21	428,980	19,841	ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	1	25,043	15,951
UNITED HEALTH GROUP INC(アメリカ)	5	384,020	67,089	ABIOMED INC(アメリカ)	0.457	23,105	50,559
JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	16	366,991	22,804	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B(アメリカ)	0.51	20,410	40,019
NVIDIA CORP(アメリカ)	15	364,127	23,710	UNITED HEALTH GROUP INC(アメリカ)	0.27	20,382	75,491

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末(決算日の属する月については決算日)の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金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

◎利害関係人との取引状況等('22年3月11日から'23年3月10日まで)

○当期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

○利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株 式	23	1	55

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、STATE STREET CORPです。

◎組入資産の明細('23年3月10日現在)

(1) 外国株式

銘柄	前期末(期首)		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	
001 LYONDELLBASELL INDU CL A	19	33	308	41,994	素材
002 AFLAC	45	74	486	66,115	保険
003 AES CORPORATION	43	89	216	29,415	公益事業
004 AT & T INC	524	942	1,727	234,962	電気通信サービス
005 ABBOTT LABORATORIES	129	231	2,261	307,614	ヘルスケア機器・サービス
006 ABBVIE INC	129	234	3,452	469,562	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
007 ABIOMED INC	3	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
008 ACTIVISION BLIZZARD INC	57	94	738	100,440	メディア・娯楽
009 ADOBE INC	34	61	2,068	281,376	ソフトウェア・サービス
010 ADOVANCE AUTO PARTS	4	7	99	13,490	小売
011 ADVANCED MICRO DEVICES	119	213	1,796	244,373	半導体・半導体製造装置
012 AGILENT TECHNOLOGIES INC	22	39	543	73,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
013 AIR PRODUCTS & CHEMICALS	16	29	847	115,217	素材
014 AKAMAI TECHNOLOGIES	11	19	145	19,807	ソフトウェア・サービス
015 GARMIN LTD	11	19	187	25,470	耐久消費財・アパレル
016 ALASKA AIR GROUP INC	9	14	70	9,610	運輸
017 ALBEMARLE CORP	8	15	372	50,715	素材
018 ALIGN TECHNOLOGY	5	10	326	44,358	ヘルスケア機器・サービス
019 ALLIANT ENERGY CORP	20	31	161	22,031	公益事業
020 ALLSTATE CORP	21	35	420	57,195	保険
021 ALPHABET INC-CL C	20	700	6,489	882,692	メディア・娯楽
022 ALPHABET INC-CL A	21	790	7,295	992,210	メディア・娯楽
023 ALTRIA GROUP INC	135	237	1,109	150,917	食品・飲料・タバコ
024 AMAZON COM INC	31	1,174	10,832	1,473,309	小売
025 AMEREN CORPORATION	17	34	284	38,708	公益事業
026 AMERICAN AIRLINES GROUP	41	87	138	18,810	運輸
027 AMERICAN ELECTRIC POWER	37	68	606	82,537	公益事業
028 AMERICAN EXPRESS	46	78	1,357	184,588	各種金融
029 AMERICAN INT'L GROUP	61	98	547	74,474	保険
030 AMERICAN WATER WORKS CO INC	12	25	350	47,659	公益事業
031 AMERISOURCEBERGEN CORP	10	21	320	43,577	ヘルスケア機器・サービス
032 AMERIPRISE FINANCIAL INC	7	14	454	61,764	各種金融
033 AMETEK INC	16	30	427	58,203	資本財
034 AMGEN INC	41	70	1,598	217,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
035 AMPHENOL CORP-CL A	44	78	612	83,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
036 ANALOG DEVICES	39	68	1,256	170,842	半導体・半導体製造装置
037 ANSYS INC	5	11	359	48,958	ソフトウェア・サービス
038 ELEVANCE HEALTH INC	17	31	1,452	197,499	ヘルスケア機器・サービス
039 APA CORPORATION	27	40	150	20,406	エネルギー
040 APPLE INC	1,141	1,977	29,777	4,050,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
041 APPLIED MATERIALS	66	113	1,330	180,978	半導体・半導体製造装置
042 ARCHER-DANIELS-MIDLAND	41	72	568	77,306	食品・飲料・タバコ
043 ARISTA NETWORKS	15	33	491	66,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	前期末(期首)		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	
044 ASSURANT INC	3	6	81	11,152	保険
045 ATMOS ENERGY CORP	9	17	194	26,458	公益事業
046 AUTODESK INC	16	29	582	79,215	ソフトウェア・サービス
047 AUTOMATIC DATA PROCESS	31	54	1,203	163,660	ソフトウェア・サービス
048 AUTOZONE INC	1	2	610	83,019	小売
049 AVERY DENNISON CORP	5	10	179	24,349	素材
050 BAKER HUGHES COMPANY	65	132	398	54,225	エネルギー
051 BALL CORPORATION	22	41	226	30,854	素材
052 BANK OF AMERICA CORP	527	923	2,819	383,515	銀行
053 BANK NEW YORK MELLO CORP	56	97	466	63,515	各種金融
054 BATH & BODY WORKS INC	17	28	109	14,921	小売
055 BAXTER INTERNATIONAL	37	67	262	35,684	ヘルスケア機器・サービス
056 BECTON DICKINSON	21	37	875	119,109	ヘルスケア機器・サービス
057 WR BERKLEY CORP	10	25	164	22,330	保険
058 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	133	238	7,267	988,455	各種金融
059 BEST BUY COMPANY INC	16	25	199	27,119	小売
060 BIO-RAD LABORATORIES-A	1	2	138	18,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
061 BIOGEN INC	10	19	493	67,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
062 BIO-TECHNE CORP	2	19	146	19,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
063 BLACKROCK INC	10	19	1,292	175,743	各種金融
064 BOEING CO	40	74	1,491	202,926	資本財
065 BOOKING HOLDINGS INC	3	5	1,282	174,468	消費者サービス
066 BORGWARNER INC	17	31	153	20,877	自動車・自動車部品
067 BOSTON SCIENTIFIC CORP	105	189	891	121,227	ヘルスケア機器・サービス
068 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	163	281	1,869	254,247	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
069 BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9	15	222	30,315	ソフトウェア・サービス
070 BROADCOM INC	30	53	3,334	453,486	半導体・半導体製造装置
071 BROWN & BROWN INC	18	29	164	22,308	保険
072 BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14	24	151	20,629	食品・飲料・タバコ
073 CBOE GLOBAL MARKETS INC	8	13	162	22,034	各種金融
074 CBRE GROUP INC-A	24	41	339	46,135	不動産
075 CDW CORP/DE	9	18	353	48,062	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
076 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	15	24	200	27,226	素材
077 C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9	15	162	22,111	運輸
078 THE CIGNA GROUP	24	40	1,094	148,902	ヘルスケア機器・サービス
079 CME GROUP INC	26	48	852	115,909	各種金融
080 CMS ENERGY CORP	20	38	227	30,946	公益事業
081 CSX CORP	162	278	828	112,638	運輸
082 CVS HEALTH CORPORATION	96	173	1,335	181,639	ヘルスケア機器・サービス
083 COTERRA ENERGY INC	60	105	263	35,890	エネルギー
084 CADENCE DESIGN SYS INC	20	36	714	97,179	ソフトウェア・サービス
085 CAESARS ENTERTAINMENT INC	14	27	133	18,188	消費者サービス
086 CAMPBELL SOUP CO (US)	12	26	138	18,797	食品・飲料・タバコ
087 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31	50	513	69,783	各種金融
088 CARDINAL HEALTH INC	21	34	249	33,926	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	前期末(期首)		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	
089 CARMAX INC	11	21	142	19,389	小売
090 CARNIVAL CORP	53	134	133	18,224	消費者サービス
091 CARRIER GLOBAL CORP	64	110	511	69,566	資本財
092 CATALENT INC	13	22	159	21,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
093 CATERPILLAR	39	69	1,665	226,559	資本財
094 CELANESE CORPORATION	7	13	155	21,136	素材
095 CENTENE CORP	43	75	491	66,864	ヘルスケア機器・サービス
096 CENTERPOINT ENERGY INC	44	84	234	31,886	公益事業
097 CERIDIAN HCM HOLDING INC	9	20	148	20,178	ソフトウェア・サービス
098 CERNER CORP	20	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
099 CHARLES RIVER LABORATORIES	3	6	150	20,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
100 CHARTER COMMUNICATION-A	9	14	497	67,693	メディア・娯楽
101 CHEVRON CORPORATION	140	235	3,781	514,272	エネルギー
102 CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2	3	567	77,213	消費者サービス
103 CHURCH & DWIGHT CO INC	18	32	272	37,092	家庭用品・パーソナル用品
104 CINCINNATI FINANCIAL CORP	11	20	239	32,539	保険
105 CISCO SYSTEMS	309	542	2,649	360,332	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
106 CINTAS CORP	6	11	498	67,806	商業・専門サービス
107 CITIGROUP INC	145	256	1,246	169,555	銀行
108 CITIZENS FINANCIAL GROUP	30	65	235	32,047	銀行
109 CITRIX SYSTEMS INC	8	-	-	-	ソフトウェア・サービス
110 CLOROX CO	8	16	246	33,579	家庭用品・パーソナル用品
111 COCA-COLA CO	285	515	3,062	416,504	食品・飲料・タバコ
112 COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	38	68	417	56,747	ソフトウェア・サービス
113 COLGATE-PALMOLIVE CO	62	110	789	107,372	家庭用品・パーソナル用品
114 COMCAST CORP-CL A	335	570	2,024	275,388	メディア・娯楽
115 COMERICA	10	16	102	13,960	銀行
116 CONAGRA BRANDS INC	33	63	221	30,187	食品・飲料・タバコ
117 CONOCOPHILLIPS	96	164	1,745	237,440	エネルギー
118 CONSOLIDATED EDISON	27	47	433	58,990	公益事業
119 CONSTELLATION BRANDS INC-A	12	21	460	62,605	食品・飲料・タバコ
120 CONSTELLATION ENERGY	22	43	338	46,024	公益事業
121 THE COOPER COS INC	3	6	208	28,417	ヘルスケア機器・サービス
122 COPART INC	16	56	395	53,761	商業・専門サービス
123 CORNING	57	100	341	46,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
124 CORTEVA INC	53	94	566	77,055	素材
125 COSTCO WHOLESALE CORP	32	58	2,808	381,925	食品・生活必需品小売り
126 COSTAR GROUP	-	54	371	50,581	商業・専門サービス
127 CUMMINS ENGINE CO	10	18	467	63,561	資本財
128 DR HORTON INC	24	41	391	53,252	耐久消費財・アパレル
129 DTE ENERGY	13	25	269	36,711	公益事業
130 DXC TECHNOLOGY CO	18	27	71	9,701	ソフトウェア・サービス
131 DANAHER CORP	46	87	2,120	288,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
132 DARDEN RESTAURANTS	9	16	237	32,326	消費者サービス
133 DAVITA INC	3	7	52	7,138	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	前期末(期首)		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	
134 DEERE & CO	20	36	1,532	208,405	資本財
135 DELTA AIR LINES INC	48	85	329	44,764	運輸
136 DENTSPLY SIRONA INC	15	29	108	14,710	ヘルスケア機器・サービス
137 DEVON ENERGY CORPORATION	46	86	460	62,668	エネルギー
138 DEXCOM INC	7	51	576	78,384	ヘルスケア機器・サービス
139 DIAMONDBACK ENERGY	11	23	323	44,004	エネルギー
140 DISNEY (WALT) CO NEW	133	241	2,317	315,262	メディア・娯楽
141 DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21	36	383	52,141	各種金融
142 DISCOVERY INC-A	14	-	-	-	メディア・娯楽
143 DISCOVERY INC-C	21	-	-	-	メディア・娯楽
144 DISH NETWORK CORP-A	15	29	33	4,551	メディア・娯楽
145 DOLLAR GENERAL CORP	17	30	658	89,499	小売
146 DOLLAR TREE INC	16	27	383	52,134	小売
147 DOMINION ENERGY INC	60	110	599	81,503	公益事業
148 DOMINO'S PIZZA INC	2	5	158	21,526	消費者サービス
149 DOVER CORP	10	18	280	38,109	資本財
150 DOW INC	54	93	513	69,882	素材
151 DUKE ENERGY CORP	56	102	964	131,237	公益事業
152 DUPONT DE NEMOURS INC	38	62	440	59,970	素材
153 EOG RESOURCES INC	42	77	891	121,281	エネルギー
154 EQT CORP	-	48	152	20,801	エネルギー
155 EASTMAN CHEMICAL CO	9	16	132	18,042	素材
156 EBAY INC	46	72	309	42,135	小売
157 ECOLAB INC	18	33	521	70,951	素材
158 EDISON INTERNATIONAL	26	50	341	46,392	公益事業
159 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46	81	619	84,246	ヘルスケア機器・サービス
160 ELECTRONIC ARTS	20	34	385	52,417	メディア・娯楽
161 EMERSON ELECTRIC CO	44	78	651	88,565	資本財
162 ENPHASE ENERGY INC	9	18	390	53,137	半導体・半導体製造装置
163 ENTERGY CORP	14	26	273	37,185	公益事業
164 EPAM SYSTEMS INC	4	7	214	29,240	ソフトウェア・サービス
165 EQUIFAX INC	9	16	322	43,823	商業・専門サービス
166 ETSY INC	8	15	170	23,211	小売
167 EVERGY INC	15	28	170	23,128	公益事業
168 EVERSOURCE ENERGY	25	45	339	46,214	公益事業
169 EXELON CORP	73	131	534	72,635	公益事業
170 EXPEDIA GROUP INC	10	18	191	25,980	消費者サービス
171 EXPEDITORS INTL WASH INC	11	21	231	31,551	運輸
172 EXXON MOBIL CORPORATION	309	544	5,938	807,758	エネルギー
173 FMC CORP	9	15	195	26,655	素材
174 META PLATFORMS INC-A	173	297	5,402	734,776	メディア・娯楽
175 FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2	4	194	26,452	各種金融
176 FASTENAL CO	43	75	395	53,804	資本財
177 FEDEX CORP	18	32	666	90,595	運輸
178 F5 INC	4	7	107	14,583	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	前期末(期首)		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	
179 FIDELITY NATIONAL INFORMATION	44	78	468	63,690	ソフトウェア・サービス
180 FIFTH THIRD BANCORP	48	91	289	39,312	銀行
181 FIRST REPUBLIC BANK/CA	13	23	230	31,313	銀行
182 FIRST SOLAR INC	-	13	285	38,788	半導体・半導体製造装置
183 FISERV INC	43	84	975	132,654	ソフトウェア・サービス
184 FIRSTENERGY CORP	41	72	282	38,476	公益事業
185 FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6	9	189	25,834	ソフトウェア・サービス
186 FORD MOTOR COMPANY	288	522	651	88,547	自動車・自動車部品
187 FORTINET INC	10	86	517	70,448	ソフトウェア・サービス
188 FORTIVE CORPORATION	26	47	313	42,682	資本財
189 FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	8	-	-	-	資本財
190 FOX CORPORATION-CLASS A	20	40	134	18,272	メディア・娯楽
191 FOX CORP	12	15	47	6,498	メディア・娯楽
192 FRANKLIN RESOURCES INC	21	35	100	13,618	各種金融
193 FREEPORT MCMORAN INC	108	189	740	100,689	素材
194 GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	-	48	372	50,622	ヘルスケア機器・サービス
195 ARTHUR J GALLAGHER & CO	15	27	509	69,287	保険
196 GARTNER INC	5	10	362	49,266	ソフトウェア・サービス
197 GENERAC HOLDINGS INC	4	8	99	13,570	資本財
198 GENERAL DYNAMICS CORP	17	30	673	91,604	資本財
199 GENERAL ELECTRIC CO	80	144	1,325	180,320	資本財
200 GENERAL MILLS	45	78	616	83,876	食品・飲料・タバコ
201 GENERAL MOTORS CO	107	188	711	96,715	自動車・自動車部品
202 GENUINE PARTS CO	10	18	309	42,061	小売
203 GILEAD SCIENCES INC	92	165	1,310	178,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
204 GLOBAL PAYMENTS INC	21	35	378	51,414	ソフトウェア・サービス
205 GLOBE LIFE INC	6	11	135	18,366	保険
206 GOLDMAN SACHS GROUP INC	24	44	1,517	206,350	各種金融
207 GRAINGER (WW)	3	5	411	55,988	資本財
208 HCA HEALTHCARE INC	17	28	720	97,938	ヘルスケア機器・サービス
209 HEWLETT-PACKARD CO	85	117	326	44,423	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
210 HALLIBURTON CO	62	120	429	58,465	エネルギー
211 HARTFORD FINANCIAL SVCS	23	41	302	41,086	保険
212 HASBRO INC	9	15	77	10,600	耐久消費財・アパレル
213 JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	4	9	154	21,058	ソフトウェア・サービス
214 THE HERSHEY COMPANY	10	19	462	62,962	食品・飲料・タバコ
215 HESS CORP	20	36	492	67,027	エネルギー
216 HP ENTERPRISE CO	91	170	251	34,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
217 HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20	35	511	69,593	消費者サービス
218 HOLOGIC INC	18	33	261	35,591	ヘルスケア機器・サービス
219 HOME DEPOT	77	135	3,889	529,002	小売
220 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	50	89	1,718	233,767	資本財
221 HORMEL FOODS CORP	19	38	154	20,971	食品・飲料・タバコ
222 HOWMET AEROSPACE INC	28	46	194	26,509	資本財
223 HUMANA	9	16	816	111,058	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	前期末(期首)		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	
224 HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5	10	187	25,454	運輸
225 HUNTINGTON BANCSHARES INC	101	191	262	35,757	銀行
226 HUNTINGTON INGALLS IND	2	5	118	16,052	資本財
227 IPG PHOTONICS CORP	2	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
228 IDEX CORP	5	10	234	31,865	資本財
229 IDEXX LABORATORIES	6	11	519	70,722	ヘルスケア機器・サービス
230 ILLINOIS TOOL WORKS	20	36	868	118,059	資本財
231 ILLUMINA INC	11	20	419	57,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
232 INCYTE CORP	12	23	169	23,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
233 INGERSOLL-RAND INC	28	53	312	42,566	資本財
234 INTEL CORP	297	546	1,445	196,541	半導体・半導体製造装置
235 INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41	73	740	100,693	各種金融
236 IBM CORP	65	120	1,515	206,131	ソフトウェア・サービス
237 INT'L FLAVORS FRAGRANCES	18	33	292	39,789	素材
238 INT'L PAPER CO	25	47	172	23,416	素材
239 INTERPUBLIC GROUP OF COS	26	48	167	22,788	メディア・娯楽
240 INTUIT CORP	20	37	1,508	205,195	ソフトウェア・サービス
241 INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	26	47	1,080	146,983	ヘルスケア機器・サービス
242 IQVIA HOLDINGS INC	14	24	492	66,958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
243 JPMORGAN CHASE & CO	216	387	5,056	687,704	銀行
244 JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9	-	-	-	商業・専門サービス
245 JACOBS SOLUTIONS INC	-	16	189	25,731	商業・専門サービス
246 JOHNSON & JOHNSON	192	346	5,233	711,809	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
247 JUNIPER NETWORKS INC	20	42	133	18,131	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
248 KLA CORPORATION	11	18	710	96,671	半導体・半導体製造装置
249 KELLOGG CO	17	34	219	29,834	食品・飲料・タバコ
250 KEURIG DR PEPPER INC	-	112	389	52,937	食品・飲料・タバコ
251 KEYCORP	70	124	199	27,187	銀行
252 KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	12	23	368	50,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
253 KIMBERLY-CLARK CORP	25	44	543	73,858	家庭用品・パーソナル用品
254 KINDER MORGAN INC	144	262	449	61,094	エネルギー
255 THE KRAFT HEINZ CO/THE	48	105	400	54,420	食品・飲料・タバコ
256 KROGER CO	50	86	410	55,768	食品・生活必需品小売り
257 LKQ CORP	20	31	179	24,349	小売
258 L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14	24	508	69,164	資本財
259 LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7	12	271	36,949	ヘルスケア機器・サービス
260 LAM RESEARCH CORP	10	18	887	120,762	半導体・半導体製造装置
261 LAMB WESTON HOLDINGS INC	9	18	179	24,380	食品・飲料・タバコ
262 LAS VEGAS SANDS CORP	25	43	245	33,324	消費者サービス
263 ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17	30	753	102,460	家庭用品・パーソナル用品
264 LEIDOS HOLDINGS INC	10	17	159	21,707	商業・専門サービス
265 LENNAR CORP-CL A	20	33	335	45,564	耐久消費財・アパレル
266 LILLY (ELI) & CO	58	104	3,316	451,072	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
267 LINCOLN NATIONAL CORP	13	21	57	7,864	保険
268 LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	9	18	127	17,360	メディア・娯楽

銘柄	前期末(期首)		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	
269 LOCKHEED MARTIN CORPORATION	18	30	1,469	199,856	資本財
270 LOEWS CORP	13	24	144	19,668	保険
271 LOWE'S COMPANIES	50	81	1,626	221,238	小売
272 LUMEN TECHNOLOGIES INC	70	104	30	4,092	電気通信サービス
273 M & T BANK CORP	9	22	302	41,187	銀行
274 MGM RESORTS INTERNATIONAL	27	40	173	23,597	消費者サービス
275 MSCI INC	6	10	569	77,428	各種金融
276 MARATHON OIL CORP	54	84	208	28,373	エネルギー
277 MARATHON PETROLEUM CORP	45	61	791	107,716	エネルギー
278 MARKETAXESS HOLDINGS INC	2	4	168	22,972	各種金融
279 MARSH & MCLENNAN COS	36	66	1,049	142,727	保険
280 MARRIOTT INT'L A	20	35	598	81,442	消費者サービス
281 MARTIN MARIETTA MATERIALS	4	7	277	37,719	素材
282 MASCO CORP	17	30	155	21,093	資本財
283 MASTERCARD INC-CLASS A	63	112	3,976	540,790	ソフトウェア・サービス
284 MATCH GROUP INC	19	35	129	17,566	メディア・娯楽
285 MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17	33	241	32,795	食品・飲料・タバコ
286 MCDONALD'S CORP	54	96	2,529	344,028	消費者サービス
287 MCKESSON CORP	11	18	628	85,541	ヘルスケア機器・サービス
288 MERCK & CO	185	335	3,606	490,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
289 METLIFE INC	52	87	566	77,024	保険
290 METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1	2	439	59,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
291 MICROSOFT CORP	549	985	24,862	3,381,494	ソフトウェア・サービス
292 MICROCHIP TECHNOLOGY INC	41	73	607	82,666	半導体・半導体製造装置
293 MICRON TECHNOLOGY	82	144	801	109,038	半導体・半導体製造装置
294 MODERNA INC	25	43	596	81,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
295 MOHAWK INDUSTRIES INC	3	6	61	8,394	耐久消費財・アパレル
296 MOLINA HEALTHCARE INC	4	7	192	26,234	ヘルスケア機器・サービス
297 MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	11	24	132	18,012	食品・飲料・タバコ
298 MONDELEZ INTERNATIONAL INC	102	181	1,172	159,451	食品・飲料・タバコ
299 MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3	5	292	39,735	半導体・半導体製造装置
300 MONSTER BEVERAGE CORP	26	50	518	70,474	食品・飲料・タバコ
301 MOODY'S CORPORATION	11	20	611	83,148	各種金融
302 MORGAN STANLEY	105	174	1,604	218,223	各種金融
303 MOSAIC CO/THE	27	44	235	32,063	素材
304 MOTOROLA SOLUTIONS INC	12	21	582	79,167	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
305 NRG ENERGY INC	15	31	102	13,931	公益事業
306 NVR INC	0.25	0.38	201	27,434	耐久消費財・アパレル
307 NASDAQ INC	8	44	242	32,950	各種金融
308 NETAPP INC	16	27	173	23,618	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
309 NETFLIX INC	32	58	1,747	237,700	メディア・娯楽
310 NEWELL BRANDS INC	22	50	65	8,930	耐久消費財・アパレル
311 NEWMONT CORPORATION	58	105	440	59,909	素材
312 NEWS CORP - CLASS A	31	44	73	9,939	メディア・娯楽
313 NEWS CORP - CLASS B	10	10	16	2,234	メディア・娯楽

銘柄	前期末(期首)		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	
314 NEXTERA ENERGY INC	144	262	1,937	263,553	公益事業
315 NIKE B	93	166	1,964	267,132	耐久消費財・アパレル
316 NISOURCE INC	26	51	140	19,077	公益事業
317 NORDSON CORP	4	6	148	20,178	資本財
318 NORFOLK SOUTHERN CORP	17	31	661	90,011	運輸
319 NORTHERN TRUST CORP	14	28	244	33,275	各種金融
320 NORTHROP GRUMMAN CORP	10	19	880	119,748	資本財
321 GEN DIGITAL INC	43	77	137	18,728	ソフトウェア・サービス
322 NUCOR CORP	21	34	574	78,098	素材
323 NVIDIA CORP	183	329	7,721	1,050,259	半導体・半導体製造装置
324 O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5	8	684	93,164	小売
325 OCCIDENTAL PETROLEUM	65	96	582	79,221	エネルギー
326 OLD DOMINION FREIGHT LINE	6	12	422	57,516	運輸
327 OMNICOM GROUP	14	26	234	31,889	メディア・娯楽
328 ON SEMICONDUCTOR CORP	-	57	466	63,434	半導体・半導体製造装置
329 ONEOK INC NEW	33	59	387	52,762	エネルギー
330 ORACLE CORP	118	203	1,766	240,226	ソフトウェア・サービス
331 ORGANON & CO	15	32	75	10,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
332 OTIS WORLDWIDE CORP	31	55	465	63,292	資本財
333 P G & E CORP	-	214	345	47,028	公益事業
334 PNC BANK CORP	31	53	737	100,302	銀行
335 PPG INDUSTRIES	17	31	401	54,547	素材
336 PPL CORPORATION	52	97	259	35,229	公益事業
337 PVH CORP	5	-	-	-	耐久消費財・アパレル
338 PTC INC	7	14	173	23,530	ソフトウェア・サービス
339 PACCAR INC	25	69	515	70,141	資本財
340 PACKAGING CORP OF AMERICA	7	12	173	23,662	素材
341 PARKER HANNIFIN CORP	9	17	599	81,522	資本財
342 PAYCHEX INC	23	42	469	63,829	ソフトウェア・サービス
343 PAYCOM SOFTWARE INC	3	6	175	23,863	ソフトウェア・サービス
344 PYPAL HOLDINGS INC	86	150	1,144	155,672	ソフトウェア・サービス
345 PENN ENTERTAINMENT INC	12	-	-	-	消費者サービス
346 PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	26	-	-	-	銀行
347 PEPSICO INC	101	182	3,134	426,275	食品・飲料・タバコ
348 PERKINELMER INC	9	15	196	26,707	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
349 PFIZER	411	742	2,929	398,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
350 PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	114	204	2,028	275,893	食品・飲料・タバコ
351 PHILLIPS 66	32	62	628	85,548	エネルギー
352 PINNACLE WEST CAPITAL	7	15	115	15,672	公益事業
353 PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16	31	640	87,156	エネルギー
354 POOL CORP	2	4	170	23,214	小売
355 T ROWE PRICE GROUP INC	15	30	334	45,527	各種金融
356 PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16	30	241	32,830	保険
357 PROCTER & GAMBLE CO	177	313	4,280	582,192	家庭用品・パーソナル用品
358 PROGRESSIVE CORP	42	77	1,097	149,317	保険

銘柄	前期末(期首)		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	
359 PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28	49	446	60,681	保険
360 PUBLIC SV ENTERPRISE CO	38	66	384	52,328	公益事業
361 PULTE GROUP INC	16	30	166	22,701	耐久消費財・アパレル
362 QORVO INC	7	12	124	16,994	半導体・半導体製造装置
363 QUALCOMM	82	148	1,738	236,452	半導体・半導体製造装置
364 QUANTA SERVICES INC	10	18	303	41,314	資本財
365 QUEST DIAGNOSTICS INC	8	15	206	28,069	ヘルスケア機器・サービス
366 RALPH LAUREN CORP	2	5	60	8,252	耐久消費財・アパレル
367 RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13	25	253	34,424	各種金融
368 RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	109	194	1,861	253,159	資本財
369 REGENERON PHARMACEUTICALS	7	14	1,056	143,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
370 REGIONS FINANCIAL CORP	68	124	257	34,964	銀行
371 REPUBLIC SERVICES INC	14	27	355	48,414	商業・専門サービス
372 RESMED INC	10	19	411	56,027	ヘルスケア機器・サービス
373 ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	8	13	108	14,711	商業・専門サービス
374 ROCKWELL AUTOMATION INC	8	15	459	62,529	資本財
375 ROLLINS	13	29	101	13,843	商業・専門サービス
376 ROPER TECHNOLOGIES INC	7	14	592	80,564	ソフトウェア・サービス
377 ROSS STORES INC	26	45	480	65,411	小売
378 S&P GLOBAL INC	26	43	1,458	198,385	各種金融
379 SVB FINANCIAL GROUP	4	7	78	10,672	銀行
380 SALESFORCE INC	71	132	2,361	321,177	ソフトウェア・サービス
381 HENRY SCHEIN INC	8	17	132	18,008	ヘルスケア機器・サービス
382 SCHLUMBERGER LTD	103	187	979	133,165	エネルギー
383 SCHWAB (CHARLES) CORP	110	201	1,341	182,520	各種金融
384 SEALED AIR CORP	9	16	79	10,872	素材
385 SEMpra ENERGY	24	41	611	83,142	公益事業
386 SERVICENOW INC	14	26	1,146	155,899	ソフトウェア・サービス
387 SHERWIN-WILLIAMS CO	17	31	684	93,139	素材
388 SIGNATURE BANK	4	8	75	10,282	銀行
389 SKYWORKS SOLUTIONS INC.	12	21	240	32,704	半導体・半導体製造装置
390 SMITH (A.O.) CORP	8	17	115	15,701	資本財
391 JM SMUCKER CO	7	14	213	29,040	食品・飲料・タバコ
392 SNAP-ON	4	6	166	22,602	資本財
393 SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	3	7	219	29,850	半導体・半導体製造装置
394 SOUTHERN CO	78	144	931	126,704	公益事業
395 SOUTHWEST AIRLINES CO	42	78	259	35,350	運輸
396 STARBUCKS CORP	86	151	1,521	206,973	消費者サービス
397 STATE STREET CORP	27	49	406	55,231	各種金融
398 STEEL DYNAMICS INC	-	22	282	38,357	素材
399 STRYKER CORP	24	44	1,184	161,066	ヘルスケア機器・サービス
400 SYNOPSIS INC	11	20	728	99,089	ソフトウェア・サービス
401 SYNCHRONY FINANCIAL	39	56	188	25,657	各種金融
402 SYSCO CORP	38	67	501	68,231	食品・生活必需品小売り
403 TJX COMPANIES INC	88	153	1,149	156,396	小売

銘柄	前期末(期首)		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	
404 T MOBILE US INC	43	78	1,111	151,137	電気通信サービス
405 TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7	20	235	32,002	メディア・娯楽
406 TAPESTRY INC	18	32	135	18,416	耐久消費財・アパレル
407 TARGET CORP	35	60	974	132,533	小売
408 TARGA RESOURCES CORP	-	30	229	31,195	エネルギー
409 TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3	6	261	35,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
410 TELEFLEX	3	6	148	20,169	ヘルスケア機器・サービス
411 TERADYNE INC	12	19	200	27,256	半導体・半導体製造装置
412 TESLA INC	59	354	6,135	834,472	自動車・自動車部品
413 TEXAS INSTRUMENTS	67	119	2,074	282,131	半導体・半導体製造装置
414 TEXTRON	15	26	186	25,410	資本財
415 THERMO ELECTRON CORP	28	51	2,872	390,656	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
416 3M CO	42	73	772	105,083	資本財
417 TRACTOR SUPPLY COMPANY	7	14	337	45,922	小売
418 TRANSDIGM GROUP INC	3	6	508	69,188	資本財
419 TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	18	31	546	74,276	保険
420 TRIMBLE INC	17	32	163	22,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
421 TRUIST FINANCIAL CORPORATION	98	176	733	99,725	銀行
422 TWITTER INC	60	-	-	-	メディア・娯楽
423 TYLER TECHNOLOGIES INC	2	5	166	22,601	ソフトウェア・サービス
424 TYSON FOODS INC-CL A	21	38	221	30,080	食品・飲料・タバコ
425 US BANCORP	99	179	758	103,189	銀行
426 ULTA BEAUTY INC	3	6	353	48,086	小売
427 UNDER ARMOUR INC CLASS A	13	-	-	-	耐久消費財・アパレル
428 UNDER ARMOUR INC CLASS C	6	-	-	-	耐久消費財・アパレル
429 UNION PACIFIC CORP	47	80	1,616	219,835	運輸
430 UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	25	43	224	30,567	運輸
431 UNITED PARCEL SERVICE -CL B	53	96	1,761	239,606	運輸
432 UNITED RENTALS INC	5	9	416	56,646	資本財
433 UNITED HEALTH GROUP INC	68	123	5,743	781,109	ヘルスケア機器・サービス
434 UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4	8	101	13,840	ヘルスケア機器・サービス
435 VF CORP	24	41	95	13,053	耐久消費財・アパレル
436 VALERO ENERGY CORP	30	51	678	92,295	エネルギー
437 VERISIGN INC	6	12	246	33,524	ソフトウェア・サービス
438 VERIZON COMMUNICATIONS	303	555	2,030	276,158	電気通信サービス
439 VERISK ANALYTICS INC	11	20	377	51,320	商業・専門サービス
440 VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18	34	979	133,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
441 PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	45	67	139	19,034	メディア・娯楽
442 VIATRIS INC	84	152	154	21,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
443 VISA INC-CLASS A SHARES	122	216	4,764	648,084	ソフトウェア・サービス
444 VULCAN MATERIALS CO	10	17	308	41,928	素材
445 WEC ENERGY GROUP INC	21	41	369	50,216	公益事業
446 WABTEC CORPORATION	13	23	244	33,300	資本財
447 WALMART INC	103	186	2,559	348,111	食品・生活必需品小売り
448 WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	53	95	316	43,054	食品・生活必需品小売り

銘柄	前期末(期首)	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		
449 DISCOVERY INC-W/T	-	293	433	58,938	メディア・娯楽	
450 WASTE MANAGEMENT (NEW)	28	49	750	102,019	商業・専門サービス	
451 WATERS CORPORATION	4	7	230	31,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
452 WELLS FARGO COMPANY	292	503	2,072	281,847	銀行	
453 WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5	10	325	44,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
454 WESTERN DIGITAL CORP	23	42	156	21,230	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
455 WESTROCK COMPANY	19	33	103	14,096	素材	
456 WHIRLPOOL CORP	3	6	92	12,635	耐久消費財・アパレル	
457 WILLIAMS COS	89	161	483	65,732	エネルギー	
458 WYNN RESORTS LTD	8	14	154	21,024	消費者サービス	
459 XCEL ENERGY INC	40	72	466	63,486	公益事業	
460 XYLEM INC	12	23	238	32,375	資本財	
461 YUM! BRANDS INC	21	37	470	64,050	消費者サービス	
462 ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4	6	193	26,369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
463 ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15	28	346	47,176	ヘルスケア機器・サービス	
464 ZIONS BANCORPORATION	11	18	78	10,637	銀行	
465 ZOETIS INC	34	61	1,028	139,871	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
466 STANLEY BLACK & DECKER INC	12	19	159	21,667	資本財	
467 ALLEGION PLC W/I	7	11	125	17,075	資本財	
468 AMCOR PLC	113	198	215	29,260	素材	
469 AON PLC	16	26	800	108,820	保険	
470 ARCH CAPITAL GROUP LTD	-	49	338	46,036	保険	
471 ACCENTURE PLC-CL A	46	82	2,152	292,779	ソフトウェア・サービス	
472 EATON CORP PLC	29	52	921	125,363	資本財	
473 EVEREST RE GROUP LTD	3	4	181	24,736	保険	
474 INVESCO LTD	22	61	104	14,187	各種金融	
475 JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	52	91	577	78,612	資本財	
476 LINDE PLC	37	65	2,278	309,861	素材	
477 MEDTRONIC PLC	98	176	1,375	187,149	ヘルスケア機器・サービス	
478 APTIV PLC	20	35	408	55,493	自動車・自動車部品	
479 NIELSEN HOLDINGS PLC	22	-	-	-	商業・専門サービス	
480 NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	25	53	77	10,479	消費者サービス	
481 SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14	25	160	21,842	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
482 PENTAIR PLC	13	20	113	15,401	資本財	
483 STERIS PLC	6	13	246	33,513	ヘルスケア機器・サービス	
484 TRANE TECHNOLOGIES PLC	17	30	583	79,361	資本財	
485 WILLIS TOWERS WATSON PLC	9	14	343	46,663	保険	
486 CHUBB LTD	31	55	1,093	148,765	保険	
487 TE CONNECTIVITY LTD	24	41	535	72,874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
488 NXP SEMICONDUCTORS NV	19	34	619	84,309	半導体・半導体製造装置	
489 ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16	29	202	27,513	消費者サービス	
合計	株数・金額	20,857	40,515	422,412	57,452,359	
	銘柄数<比率>	477	474	-	<92.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当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) 邦貨換算金額欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(2) 外国投資証券

銘柄	前期末(期首)		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)	百口	百口	千米ドル	千円	
001 AVALONBAY COMMUNITIES INC	9	18	316	43,114	
002 BOSTON PROPERTIES INC	11	18	111	15,197	
003 DUKE REALTY CORP	26	—	—	—	
004 EQUITY RESIDENTIAL PPTY	23	44	272	37,025	
005 FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	9	94	12,911	
006 HOST HOTELS AND RESORTS INC	51	95	153	20,907	
007 KIMCO REALTY CORP	44	82	160	21,877	
008 PUBLIC STORAGE	11	20	615	83,653	
009 REGENCY CENTERS CORP	12	19	117	16,025	
010 SIMON PPTY (SIMON DEBART	24	43	504	68,633	
011 VENTAS INC COM	30	53	248	33,737	
012 VORNADO REALTY TRUST	9	—	—	—	
013 ALEXANDRIA REAL ESTATE	10	19	274	37,295	
014 AMERICAN TOWER CORP	33	61	1,170	159,255	
015 CAMDEN PROPERTY TRUST	—	13	148	20,206	
016 CROWN CASTLE INC	31	57	732	99,576	
017 DIGITAL REALTY TRUST INC	21	38	397	54,103	
018 EQUINIX INC	6	12	835	113,683	
019 ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	8	183	24,989	
020 EXTRA SPACE STORAGE INC	9	17	286	38,922	
021 HEALTHPEAK PROPERTIES INC	42	67	155	21,135	
022 INVITATION HOMES INC	—	77	241	32,790	
023 IRON MOUNTAIN INC	20	36	193	26,264	
024 MID AMERICA APARTMENT COMM	8	15	237	32,256	
025 PROLOGIS INC	54	122	1,486	202,232	
026 REALTY INCOME CORP	39	82	524	71,322	
027 SBA COMMUNICATIONS CORP	8	14	355	48,373	
028 UDR INC	19	40	167	22,823	
029 VICI PROPERTIES INC	—	127	424	57,779	
030 WELLTOWER INC	32	62	450	61,330	
031 WEYERHAEUSER CO	56	97	296	40,332	
合 計	口 数・金 額	659	1,377	11,159	1,517,760
	銘柄 数<比率>	28	29	—	<2.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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) 邦貨換算金額欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注3) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末評価額	
		買建額	売建額
外国	MINI S & P 500	百万円 3,198	百万円 -

(注1) 邦貨換算金額は、当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) 単位未満は切り捨てています。

◎投資信託財産の構成('23年3月10日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 57,452,359	% 87.7
投資証券	1,517,760	2.3
コール・ローン等、その他	6,565,627	10.0
投資信託財産総額	65,535,746	100.0

(注1) 外貨建資産は、当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米ドル=136.01円です。

(注2) 当期末における外貨建純資産(60,436,737千円)の投資信託財産総額(65,535,746千円)に対する比率は92.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年3月10日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	67,258,190,136
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,089,119,529
株 式 (評 価 額)	57,452,359,334
投 資 証 券 (評 価 額)	1,517,760,679
未 収 入 金	1,722,443,439
未 収 配 当 金	86,247,690
差 入 委 託 証 拠 金	390,259,465
(B)負 債	5,083,291,674
未 払 金	5,083,286,942
未 払 利 息	4,638
そ の 他 未 払 費 用	94
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	62,174,898,462
元 本	14,359,629,833
次 期 繰 越 損 益 金	47,815,268,629
(D)受 益 権 総 口 数	14,359,629,833口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D × 10,000)	43,298円

◎損益の状況

当期 (自 '22年3月11日 至 '23年3月10日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	728,869,778
受 取 配 当 金	709,022,905
受 取 利 息	15,064,087
そ の 他 収 益 金	4,964,084
支 払 利 息	△ 181,298
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,980,488,685
売 買 損 益	8,053,344,352
売 買 損	△ 5,072,855,667
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 529,978,716
取 引 益	882,054,988
取 引 損	△ 1,412,033,704
(D)そ の 他 費 用	△ 14,088,455
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	3,165,291,292
(F)前 期 繰 越 損 益 金	24,740,096,914
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	27,906,026,981
(H)解 約 差 損 益 金	△ 7,996,146,558
(I) 計 (E + F + G + H)	47,815,268,629
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	47,815,268,629

- (注1) 期首元本額 8,310,588,256円
 期中追加設定元本額 8,357,012,019円
 期中一部解約元本額 2,307,970,442円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。
 米国株式インデックス・ファンド 12,096,347,434円
 米国株式インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定> 1,058,823,302円
 米国株式インデックス・ファンド2<適格機関投資家限定> 867,842,148円
 世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定> 262,124,299円
 欧米株式インデックス・ファンドVA<適格機関投資家限定> 74,492,650円

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。