

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／国内／株式／インデックス型	
信託期間	信託期間は2021年4月23日から無期限です。	
運用方針	確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	原則として毎年4月5日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額については、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。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

DC日本株式ESGセレクト・ リーダーズインデックスファンド

運用報告書(全体版)

第2期(決算日 2023年4月5日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
設定日(2021年4月23日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 400
第1期(2022年4月5日)	10,530	0	5.3	10,602	6.0	94.5	3.7	1.5	442
第2期(2023年4月5日)	10,704	0	1.7	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4	805

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み合わせますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)です。

MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、親指数(MSCI ジャパンIMI) 構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI 当事者」) が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。

MSCI 及びMSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算するMSCI 指数の所有者です。いかなるMSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源からMSCI 指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI 当事者も、いかなるMSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCI との関係を主張することはできません。

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(当 期 首) 2022年 4月5日	10,530	% —	10,602	% —	% 94.5	% 3.7	% 1.5	% 1.5	
4月末	10,308	△2.1	10,376	△2.1	95.4	2.8	1.5		
5月末	10,373	△1.5	10,449	△1.4	96.2	1.9	1.7		
6月末	10,093	△4.2	10,174	△4.0	96.0	2.1	1.6		
7月末	10,490	△0.4	10,576	△0.2	95.8	2.3	1.6		
8月末	10,517	△0.1	10,601	△0.0	96.9	1.3	1.6		
9月末	9,880	△6.2	9,956	△6.1	96.8	1.6	1.6		
10月末	10,368	△1.5	10,451	△1.4	97.6	0.8	1.6		
11月末	10,678	1.4	10,771	1.6	97.7	0.7	1.5		
12月末	10,176	△3.4	10,267	△3.2	97.6	0.9	1.5		
2023年 1月末	10,574	0.4	10,669	0.6	97.9	0.7	1.4		
2月末	10,653	1.2	10,751	1.4	97.8	0.8	1.4		
3月末	10,809	2.6	10,908	2.9	96.4	2.2	1.3		
(当 期 末) 2023年 4月5日	10,704	1.7	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4		

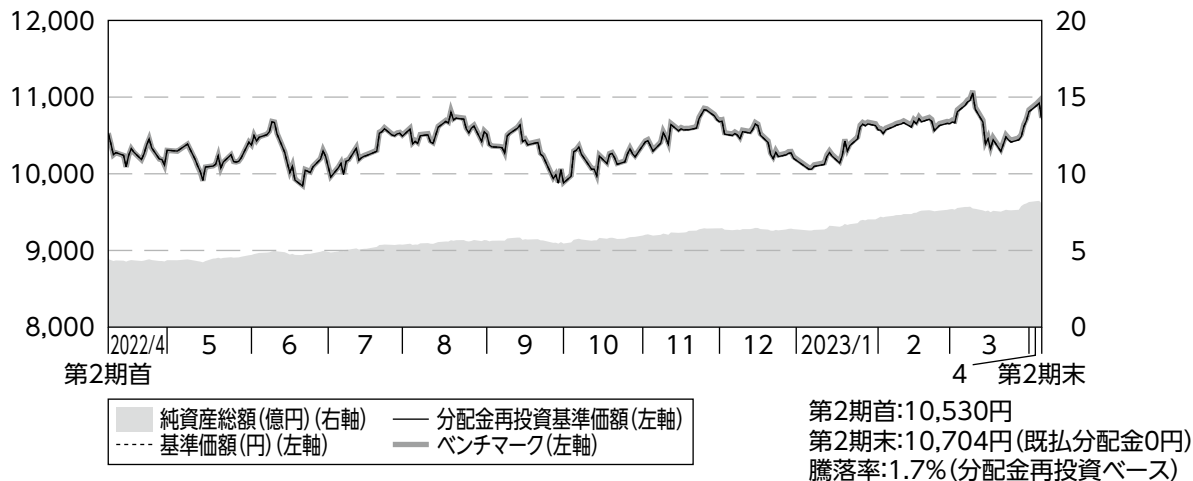
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

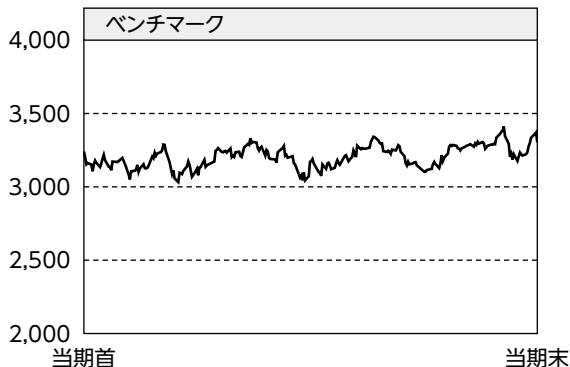


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年4月5日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

新型コロナウイルス感染拡大や米国の金融引き締めペースの加速が懸念される一方で、円安・米ドル高が進行したことが好感され、国内株式市場は2022年11月にかけて一進一退の展開となりました。その後は、日銀による長期金利の許容変動幅が拡大されたことが事実上の利上げと解釈され下落しましたが、次期日銀総裁候補である植田和男氏が金融緩和継続の方針を示したことや引き続き円安・米ドル高が進行したことが好感され2023年3月上旬にかけて堅調に推移しました。期末にかけては、米国での銀行の経営破綻をきっかけに市場心理が悪化したことなどから一時急落したものの、各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対する過度な懸念が後退したことなどから反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

【「日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引(TOPIX先物)を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式および投資信託証券については、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

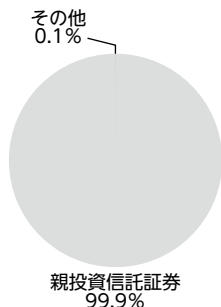
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

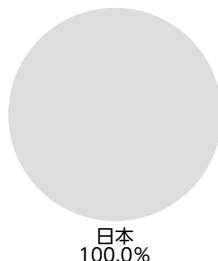
	当期末
	2023年4月5日
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

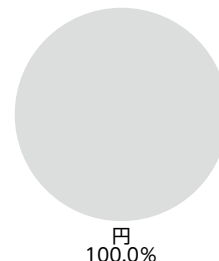
○資産別配分



○国別配分



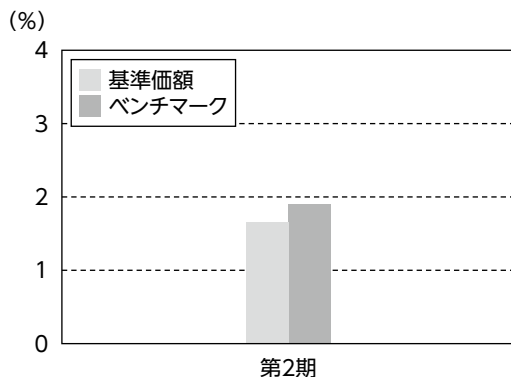
○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は信託報酬(マイナス)によるものです。

分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、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いて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第2期	
	2022年4月6日~2023年4月5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	(円)	743

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年4月6日~2023年4月5日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	25円	0.236%	(a) 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10,409円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(11)	(0.110)	
(販売会社)	(10)	(0.093)	
(受託会社)	(3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	26	0.244	

(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、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

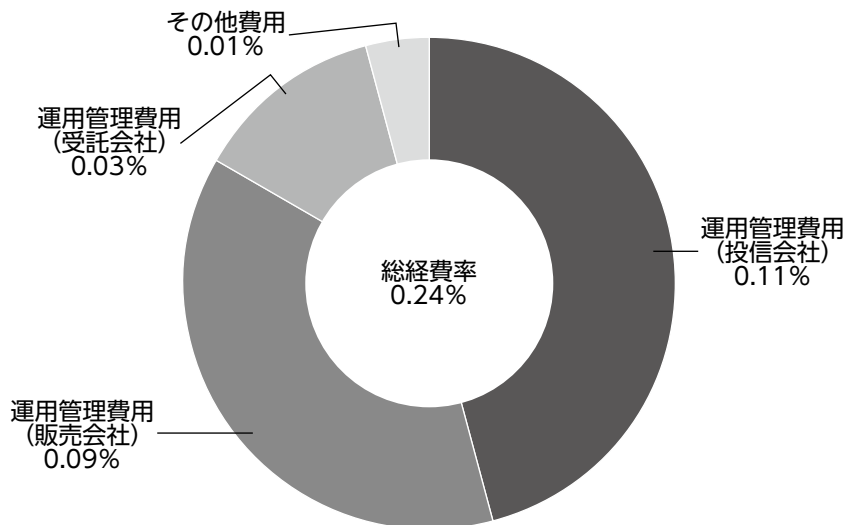
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

<参考情報>

総経費率

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0.24%です。



(注1)各費用は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)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

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本株式ESGセレクト・リーダーズ インデックスマザーファンド	千口 384,887	千円 403,446	千口 55,361	千円 58,931

株式売買比率

■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

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	11,423,905千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,327,153千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2.14

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000128	百万円 0.000128	% 100.0	百万円 0.000128	百万円 0.000128	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	328	31	9.5	327	30	9.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	28,571	3,098	10.8	28,481	3,083	10.8

<平均保有割合 10.6%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	52百万円	3百万円	54百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当期首残高本 (元)	当期設定本 元	当期解約本 元	当期末残高本 (元)	取引の理由
千円 400,000	千円 —	千円 —	千円 400,000	当初設定時における取得

※ 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>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	千口 419,494	千口 749,020	千円 805,571

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,942,102千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	千円 805,571	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,736	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	809,307	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年4月5日現在
(A)資 産	809,307,868円
コー ル・ロ ー ン 等	1,804,389
日本株式会社ESGセレクト・リーダーズ インデックスマザーファンド(評価額)	805,571,597
未 収 入 金	1,931,882
(B)負 債	3,325,042
未 払 解 約 金	2,512,250
未 払 信 託 報 酬	794,381
そ の 他 未 払 費 用	18,411
(C)純 資 産 総 額(A-B)	805,982,826
元 本	752,962,490
次 期 繰 越 損 益 金	53,020,336
(D)受 益 権 総 口 数	752,962,490口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,704円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年4月6日 至 2023年4月5日
(A)配 当 等 収 益	△372円
受 取 利 息	5
支 払 利 息	△377
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	17,643,647
売 買 益	20,664,272
売 買 損	△3,020,625
(C)信 託 報 酬 等	△1,423,255
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	16,220,020
(E)前 期 繰 越 損 益 金	17,829,393
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	18,970,923
(配 当 等 相 当 額)	(20,649,319)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,678,396)
(G) 計 (D+E+F)	53,020,336
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	53,020,336
追 加 信 託 差 損 益 金	18,970,923
(配 当 等 相 当 額)	(21,872,874)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,901,951)
分 配 準 備 積 立 金	34,123,634
繰 越 損 益 金	△74,221

- (注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は420,679,514円、期中追加設定元本額は443,279,542円、期中一部解約元本額は110,996,566円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	16,294,241円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	21,872,874円
(D) 分配準備積立金額	17,829,393円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	55,996,508円
(F) 期末残存口数	752,962,490口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	743円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2023年4月5日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2021年4月23日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未滿は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組 比率	株式先 物率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率				
設定日(2021年4月23日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 399
第1期(2022年4月5日)	10,554	5.5	10,602	6.0	94.6	3.7	1.5	479
第2期(2023年4月5日)	10,755	1.9	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4	10,692

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)です。

MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、親指数(MSCIジャパンIMI)構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

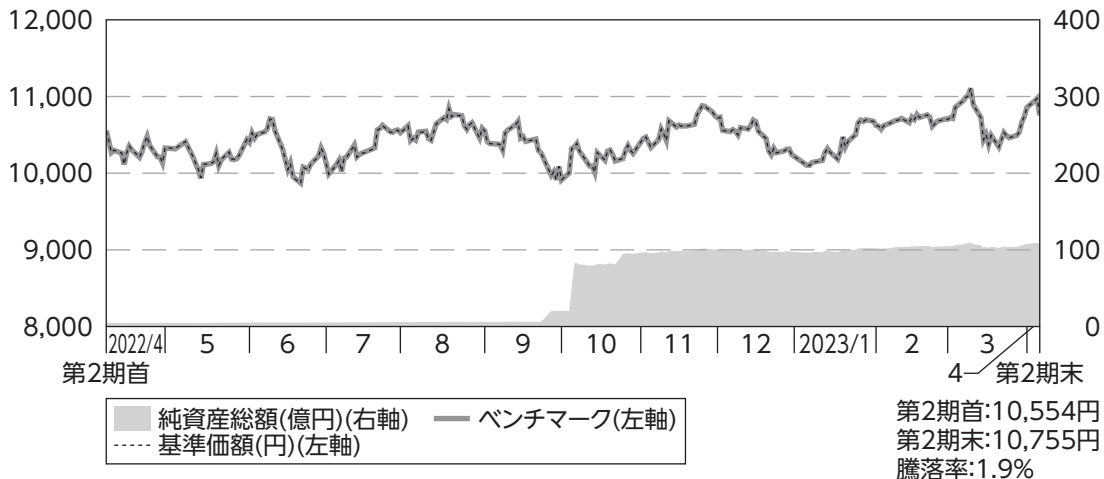
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託 証券組入比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
(当 期 首) 2022年 4月5日	円 10,554	% —	10,602	% —	% 94.6	% 3.7	% 1.5		
4月末	10,333	△2.1	10,376	△2.1	95.5	2.8	1.6		
5月末	10,401	△1.4	10,449	△1.4	96.2	1.9	1.7		
6月末	10,122	△4.1	10,174	△4.0	96.0	2.1	1.6		
7月末	10,522	△0.3	10,576	△0.2	95.9	2.3	1.6		
8月末	10,552	△0.0	10,601	△0.0	96.9	1.3	1.6		
9月末	9,914	△6.1	9,956	△6.1	96.9	1.6	1.6		
10月末	10,406	△1.4	10,451	△1.4	97.6	0.8	1.6		
11月末	10,720	1.6	10,771	1.6	97.7	0.7	1.5		
12月末	10,218	△3.2	10,267	△3.2	97.6	0.9	1.5		
2023年 1月末	10,620	0.6	10,669	0.6	97.9	0.7	1.4		
2月末	10,701	1.4	10,751	1.4	97.8	0.8	1.4		
3月末	10,860	2.9	10,908	2.9	96.5	2.2	1.3		
(当 期 末) 2023年 4月5日	10,755	1.9	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4		

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

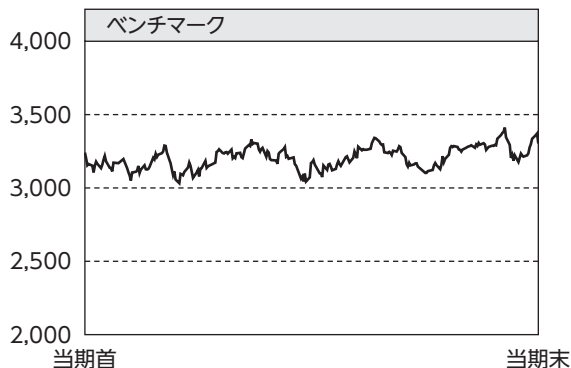


(注)ベンチマークは、2022年4月5日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

前半は、新型コロナウイルス感染拡大や米国の金融引き締めペースの加速が懸念される一方で、円安・米ドル高の進行が好感されたことなどから一進一退の展開となりました。後半は、米国株式市場が堅調に推移したことが追い風となり上昇して始まりました。その後は、日銀による長期金利の変動許容幅の拡大が事実上の利上げと解釈され下落しましたが、金融緩和継続の方針が示されたことや引き続き円安・米ドル高が進行したことが好感され、2023年3月上旬にかけて堅調に推移しました。期末にかけては、米国での銀行の経営破綻をきっかけに市場心理が悪化したことなどから一時急落したものの、各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対する過度な懸念が後退したことなどから反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引(TOPIX先物)を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式および投資信託証券については、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

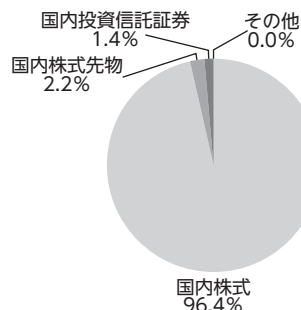
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	6.7%
2	ソニーグループ	日本	5.1%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	3.4%
4	第一三共	日本	2.7%
5	東京エレクトロン	日本	2.4%
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	2.4%

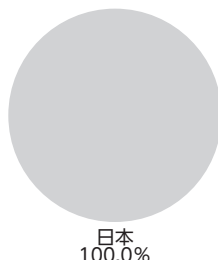
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日立製作所	日本	2.4%
8	KDDI	日本	2.2%
9	任天堂	日本	2.0%
10	ダイキン工業	日本	1.9%
組入銘柄数		251	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

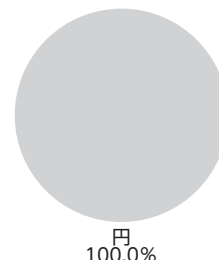
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

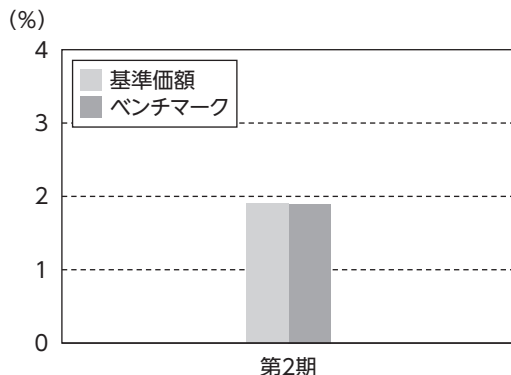


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

今後の運用方針

主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年4月6日~2023年4月5日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.001	

(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、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,447円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 4,112 (95)	千円 10,458,112 (-)	千株 318	千円 965,793

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	森ヒルズリート投資法人	60	9,429	4	634
	産業ファンド投資法人	—	—	3	557
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	—	—	1	341
	日本プロロジスリート投資法人	80	25,486	5	1,647
	ヒューリックリート投資法人	49	8,200	4	688
	積水ハウス・リート投資法人	162	13,213	11	871
	野村不動産マスターファンド投資法人	1	169	8	1,354
	日本ビルファンド投資法人	58	37,264	4	2,509
	ジャパンリアルエステイト投資法人	48	29,184	3	1,796
	日本都市ファンド投資法人	2	209	13	1,427
	オリックス不動産投資法人	2	361	6	1,133
	日本プライムリアルティ投資法人	31	12,220	1	393
国内	ユナイテッド・アーバン投資法人	115	17,327	8	1,222
	日本ロジスティクスファンド投資法人	31	9,889	—	—
	ジャパンエクセレント投資法人	45	5,994	3	407

(注1)金額は受渡代金です。

(注2)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 973	百万円 767	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

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) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	11,423,905千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,327,153千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2.14

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	28,571	3,098	10.8	28,481	3,083	10.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	52百万円	3百万円	54百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(ー%)			
マルハニチロ	0.1	—	—
鉱業(0.5%)			
I N P E X	1.6	37.7	55,230
建設業(1.8%)			
コムシスホールディングス	0.2	—	—
大成建設	0.3	—	—
大林組	1	23.6	23,647
清水建設	0.9	20	15,140
鹿島建設	0.7	—	—
戸田建設	0.4	—	—
住友林業	0.2	5.1	13,418
大和ハウス工業	0.9	21.8	67,536
積水ハウス	1	22.4	59,718
エクシオグループ	0.2	—	—
高砂熱学工業	0.1	1.7	3,598
大気社	—	0.9	3,258
千代田化工建設	—	5.7	2,274
食料品(3.7%)			
明治ホールディングス	—	8	25,240
サッポロホールディングス	0.1	2.3	8,004
アサヒグループホールディングス	0.7	16.6	81,871
キリンホールディングス	1.3	29.9	62,655
サントリー食品インターナショナル	0.2	5	24,550
伊藤園	—	1.9	8,179
不二製油グループ本社	0.1	1.6	3,051
キッコーマン	0.2	5.3	36,517
味の素	0.8	16.6	76,160
キューピー	0.2	3.3	7,355
ハウス食品グループ本社	0.1	2.2	6,164
カゴメ	—	2.7	8,356
ニチレイ	0.2	3.9	10,370
日清食品ホールディングス	0.1	2.2	26,334
繊維製品(0.5%)			
東洋紡	0.1	2.9	2,960
帝人	0.3	6.5	9,100
東レ	2.2	50.3	37,181
パルプ・紙(ー%)			
日本製紙	0.2	—	—
レンゴー	0.3	—	—
化学(6.2%)			
クラレ	0.5	11.6	13,896

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
旭化成	2	45.5	41,750
住友化学	2.4	54.1	24,182
東ソー	—	9.4	16,732
デンカ	—	2.7	7,281
信越化学工業	0.6	—	—
カネカ	0.1	1.7	5,805
三井化学	0.3	6.7	22,143
J S R	—	6.4	19,264
東京応化工業	0.1	1.2	8,748
三菱ケミカルグループ	2.1	46.5	36,065
ダイセル	0.4	9.3	9,141
積水化学工業	0.6	13.3	24,897
UBE	0.2	3.5	7,290
日本化薬	0.2	—	—
花王	0.8	16.9	88,184
日本ペイントホールディングス	—	30.1	37,023
関西ペイント	0.3	6.4	11,494
D I C	0.1	2.8	6,655
東洋インキSCホールディングス	0.1	—	—
富士フイルムホールディングス	0.6	13.1	87,023
資生堂	0.6	—	—
ライオン	—	8.5	12,308
小林製薬	—	1.8	14,490
デクセリアルズ	—	2	5,090
日東電工	0.2	5.2	43,888
信越ポリマー	—	1.5	2,154
ニフコ	0.1	2.9	10,701
ユニ・チャーム	0.6	14.6	77,832
医薬品(6.8%)			
協和キリン	0.4	9.8	28,645
アステラス製薬	3	66.6	126,140
住友ファーマ	0.3	—	—
塩野義製薬	0.4	9.6	57,254
中外製薬	1.1	24.4	79,007
エーザイ	0.4	9.1	66,966
小野薬品工業	0.6	13.1	35,782
参天製薬	0.6	12.7	14,147
第一三共	2.8	63.6	290,461
石油・石炭製品(0.5%)			
ENEOSホールディングス	4.9	111.4	52,402
ゴム製品(1.1%)			
ブリヂストン	—	20.7	108,323

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
住友理工	—	1.3	873
ガラス・土石製品(0.5%)			
太平洋セメント	—	4.2	10,096
TOTO	0.2	5.1	22,899
日本碍子	0.4	—	—
日本特殊陶業	0.2	5.6	15,013
ニチアス	0.1	—	—
鉄鋼(1.2%)			
日本製鉄	—	29.3	87,270
神戸製鋼所	—	12.2	12,163
JFEホールディングス	—	17.8	28,711
日立金属	0.3	—	—
非鉄金属(0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	0.1	2	2,870
三井金属鉱業	—	2	6,350
三菱マテリアル	0.2	4.3	9,146
住友金属鉱山	0.4	9	45,585
DOWAホールディングス	0.1	1.9	8,113
UACJ	—	1.1	2,845
金属製品(0.2%)			
LIXIL	—	10.4	22,568
機械(5.6%)			
三浦工業	0.1	3.2	10,432
タクマ	0.1	—	—
ナブテスコ	0.2	4	12,620
小松製作所	1.4	33.6	107,788
日立建機	0.2	3.9	11,817
クボタ	1.7	36.7	71,711
荏原製作所	0.2	3.3	19,833
ダイキン工業	0.4	9	207,000
栗田工業	0.2	3.8	22,572
ダイフク	0.2	11.1	27,272
グローリー	0.1	1.7	4,833
セガサミーホールディングス	0.3	5.7	14,050
ホシザキ	0.1	—	—
NTN	0.6	—	—
日立造船	0.3	5.9	5,068
三菱重工業	0.5	11.6	58,649
電気機器(21.2%)			
日清紡ホールディングス	0.2	—	—
イビデン	0.2	4.1	20,869
コニカミノルタ	0.7	16.4	9,331
日立製作所	1.6	35.2	252,595
三菱電機	2.9	—	—
富士電機	—	4.6	23,690
安川電機	0.4	8.7	48,111

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
明電舎	—	1.2	2,236
オムロン	0.3	6.7	50,250
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.1	—	—
日本電気	0.4	—	—
富士通	0.3	7.1	127,445
セイコーエプソン	—	10.2	18,982
アルバック	0.1	—	—
パナソニック ホールディングス	3.6	80.2	99,448
アンリツ	0.2	4.9	5,924
ソニーグループ	2	45.8	540,898
TDK	0.6	14.1	65,001
アルプスアルパイン	—	7.2	8,935
ヒロセ電機	0.1	—	—
日本航空電子工業	0.1	1.7	3,823
横河電機	0.4	8.3	17,720
アズビル	0.2	4.2	14,868
日本光電工業	0.1	—	—
アドバンテスト	—	6.6	74,580
キーエンス	0.3	—	—
シスメックス	0.3	6.1	52,758
スタンレー電気	0.2	4.7	13,667
ウシオ電機	0.2	—	—
ファナック	—	35	160,335
ローム	—	3.2	34,240
京セラ	—	11.6	79,877
太陽誘電	—	4.3	18,447
村田製作所	0.9	20.8	162,281
リコー	—	19.9	19,502
東京エレクトロン	0.2	16.2	255,636
輸送用機器(7.7%)			
デンソー	0.7	—	—
川崎重工業	0.2	5.5	15,801
トヨタ自動車	17.1	384.9	713,027
日野自動車	0.5	—	—
マツダ	—	20.6	24,493
ヤマハ発動機	0.5	10.8	36,396
精密機器(1.3%)			
テルモ	1	23.4	84,403
島津製作所	0.4	8.6	35,561
ニコン	0.5	11	14,311
シチズン時計	0.4	—	—
その他製品(2.9%)			
前田工織	—	0.6	1,914
大建工業	—	0.4	901
大日本印刷	0.4	8.1	30,253
NISSHA	—	1.4	2,522

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アシックス	0.2	5.9	21,977	
ヤマハ	0.2	5.1	25,806	
リンテック	0.1	1.4	2,991	
任天堂	0.2	40.1	210,324	
コクヨ	0.1	3	5,469	
美津濃	—	0.6	1,842	
電気・ガス業(1.0%)				
中部電力	1	—	—	
中国電力	0.5	—	—	
東北電力	—	16.4	10,856	
九州電力	0.6	14.6	11,154	
電源開発	—	5.3	11,315	
レノバ	0.1	1.3	2,538	
東京瓦斯	0.6	14.2	35,272	
大阪瓦斯	0.6	13.6	29,525	
東邦瓦斯	0.1	2.7	6,639	
陸運業(2.4%)				
東武鉄道	0.3	—	—	
相鉄ホールディングス	0.1	2.8	6,328	
東急	0.8	19.3	34,431	
小田急電鉄	0.5	—	—	
京王電鉄	0.2	3.7	17,667	
東日本旅客鉄道	0.5	—	—	
西日本旅客鉄道	0.3	8	44,456	
西武ホールディングス	0.4	8.2	11,734	
西日本鉄道	0.1	2.2	5,321	
近鉄グループホールディングス	0.3	—	—	
阪急阪神ホールディングス	0.4	8.3	32,868	
南海電気鉄道	0.2	3.7	10,881	
京阪ホールディングス	—	3.5	12,425	
名古屋鉄道	0.3	—	—	
山九	0.1	1.9	9,006	
センコーグループホールディングス	0.2	3.7	3,459	
日立物流	0.1	—	—	
九州旅客鉄道	0.2	4.9	14,567	
S Gホールディングス	0.5	10.5	20,338	
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	2.8	21,560	
海運業(0.6%)				
日本郵船	0.3	17.6	56,584	
倉庫・運輸関連業(0.0%)				
トランコム	—	0.3	2,139	
情報・通信業(6.2%)				
T I S	—	8.2	28,905	
S H I F T	—	0.5	11,440	
オープンドア	—	0.5	785	
マネーフォワード	—	1.6	7,808	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ビジョナル	—	0.6	4,278	
野村総合研究所	0.5	14.4	44,208	
メルカリ	0.2	3.8	8,873	
Zホールディングス	4.3	97	37,354	
伊藤忠テクノソリューションズ	—	3.5	11,392	
サイボウズ	—	0.9	2,496	
ネットワンシステムズ	0.1	—	—	
B I P R O G Y	0.1	2.6	8,216	
ビジョン	—	1.4	2,234	
日本電信電話	2.1	—	—	
K D D I	2.6	58.5	237,100	
ソフトバンク	4.6	104.2	156,404	
エヌ・ティ・ティ・データ	—	22.9	40,853	
カブコン	—	6.3	29,830	
S C S K	0.3	5.7	11,069	
卸売業(4.9%)				
あらた	—	0.5	1,990	
アルフレッサ ホールディングス	0.3	—	—	
T O K A Iホールディングス	0.2	3.5	3,010	
シップヘルスケアホールディングス	0.1	—	—	
アズワン	—	1.1	6,105	
日本ライフライン	0.1	—	—	
伊藤忠商事	1.9	43.1	178,692	
丸紅	—	56.1	97,642	
三井物産	—	52	205,400	
キャンノンマーケティングジャパン	0.1	1.7	5,236	
サンゲツ	0.1	1.5	3,243	
モスフードサービス	—	0.9	2,740	
イエローハット	—	1.2	2,160	
スズケン	0.1	—	—	
小売業(3.6%)				
ローソン	0.1	1.6	8,832	
ゲオホールディングス	—	0.8	1,273	
ハローズ	—	0.3	915	
大黒天物産	—	0.2	972	
D C Mホールディングス	0.2	4	4,540	
マツキヨココカラ&カンパニー	—	4.2	29,106	
Z O Z O	—	4.5	13,545	
オイシックス・ラ・大地	—	1	2,360	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	—	1.9	2,055	
イオン北海道	—	1.5	1,186	
スギホールディングス	—	1.3	7,436	
日本瓦斯	—	3.8	7,250	
マックスバリュ東海	—	0.3	798	
丸井グループ	0.3	6.4	13,049	

銘柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
イオン	1.1	23.7	60,494
平和堂	—	1	1,955
ヤオコー	—	0.7	4,767
ケーズホールディングス	0.3	—	—
Genky DrugStores	—	0.3	1,144
ヤマダホールディングス	1.1	26.3	12,308
ファーストリテイリング	0.1	6.4	188,128
サンドラッグ	—	2.6	9,425
銀行業 (7.2%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	16.2	15,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	433.8	364,825
りそなホールディングス	3.3	78.4	51,148
三井住友トラスト・ホールディングス	0.5	12	54,912
三井住友フィナンシャルグループ	2.1	47.4	253,210
千葉銀行	0.9	—	—
静岡銀行	0.7	—	—
山口フィナンシャルグループ	0.3	—	—
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
大和証券グループ本社	—	48.4	29,814
野村ホールディングス	4.9	105.6	53,539
マネックスグループ	—	6.3	3,080
保険業 (3.7%)			
SOMPOホールディングス	0.5	11.4	59,451
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.7	15.6	63,304
第一生命ホールディングス	1.6	35.6	86,792
東京海上ホールディングス	1	66.6	168,131
T&Dホールディングス	0.9	—	—
その他金融業 (1.0%)			
東京センチュリー	0.1	1.3	5,804
オリックス	2	43.4	94,026
不動産業 (2.1%)			
ヒューリック	0.6	13.9	15,109
野村不動産ホールディングス	0.2	4.3	12,568
東急不動産ホールディングス	1	—	—
三井不動産	1.5	32.9	80,045
三菱地所	1.9	40.9	64,131
平和不動産	—	1.1	4,196
東京建物	—	6.8	10,839
住友不動産	—	11.2	33,168
サービス業 (4.1%)			
総合警備保障	0.1	2.8	9,884
ディップ	—	1.3	4,361
エスプール	—	2.4	1,418
H. U. グループホールディングス	0.1	1.9	5,031

銘柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
オリエンタルランド	0.3	36.5	165,418	
ダスキン	0.1	1.5	4,807	
サイバーエージェント	—	15.6	17,440	
テクノプロ・ホールディングス	0.2	3.9	13,650	
リクルートホールディングス	2.2	52.3	191,888	
エラン	—	1.1	1,102	
インソース	—	1.7	2,114	
カープスホールディングス	—	1.9	1,360	
LITALICO	—	0.7	1,722	
乃村工藝社	0.1	2.8	2,455	
セコム	0.3	—	—	
ベネッセホールディングス	0.1	2.6	5,018	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数<比率>	148 205	4,037 239	10,312,114 <96.4%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<国内投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
森ヒルズリート投資法人	—	56	8,534	0.1	
産業ファンド投資法人	3	—	—	—	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	—	—	—	
日本プロロジスリート投資法人	3	78	23,353	0.2	
ヒューリックリート投資法人	2	47	7,115	0.1	
積水ハウス・リート投資法人	—	151	11,189	0.1	
野村不動産マスターファンド投資法人	7	—	—	—	
日本ビルファンド投資法人	2	56	31,360	0.3	
ジャパンリアルエステイト投資法人	—	45	24,075	0.2	
日本都市ファンド投資法人	11	—	—	—	
オリックス不動産投資法人	4	—	—	—	
日本プライムリアルティ投資法人	1	31	10,943	0.1	
ユナイテッド・アーバン投資法人	—	107	15,547	0.1	
日本ロジスティクスファンド投資法人	—	31	9,408	0.1	
ジャパンエクセレント投資法人	2	44	5,236	0.0	
合 計	口 数	金 額			
	銘 柄 数 <比率>				
	10	646	146,762	<1.4%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※当期末現在の保有銘柄のうち、当社または当社の利害関係人が資産運用会社または一般事務受託会社である投資法人

①資産運用会社

日本ロジスティクスファンド投資法人については、当社の利害関係人である三井物産ロジスティクス・パートナーズ株式会社が資産運用会社となっております。

②一般事務受託会社

以下の投資法人については、当社の利害関係人である三井住友信託銀行株式会社が一般事務受託会社となっております。

投資法人名	
森ヒルズリート投資法人 日本プロロジスリート投資法人 日本ビルファンド投資法人	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本ロジスティクスファンド投資法人

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内	158	—
	73	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	10,312,114	96.4
投 資 証 券	146,762	1.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	236,677	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	10,695,553	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年4月5日現在
(A)資 産	10,694,435,630円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	103,435,741
株 式(評価額)	10,312,114,580
投 資 証 券(評価額)	146,762,100
未 収 入 金	729,094
未 収 配 当 金	127,191,365
差 入 委 託 証 拠 金	4,202,750
(B)負 債	1,961,045
未 払 金	3,176
未 払 解 約 金	1,957,851
未 払 利 息	18
(C)純 資 産 総 額(A-B)	10,692,474,585
元 本	9,942,102,895
次 期 繰 越 損 益 金	750,371,690
(D)受 益 権 総 口 数	9,942,102,895口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,755円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年4月6日 至 2023年4月5日
(A)配 当 等 収 益	165,658,071円
受 取 配 当 金	165,706,053
受 取 利 息	198
そ の 他 収 益 金	132
支 払 利 息	△48,312
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	351,778,708
売 買 益	743,348,154
売 買 損	△391,569,446
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	8,501,494
取 引 益	17,174,808
取 引 損	△8,673,314
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	525,938,273
(E)前 期 繰 越 損 益 金	25,155,627
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	209,441,011
(G)解 約 差 損 益 金	△10,163,221
(H) 計 (D+E+F+G)	750,371,690
次 期 繰 越 損 益 金(H)	750,371,690

(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
評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設
定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額
を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は454,441,229円、期中追加設定元本額は9,729,862,124円、期中一部解約元本額は242,200,458円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	7,678,903,135円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	749,020,546円
コア投資戦略ファンド(成長型)	552,032,281円
コア投資戦略ファンド(安定型)	255,171,736円
コア投資戦略ファンド(切替型)	229,733,695円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	177,935,243円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	116,243,652円
POFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	104,377,737円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド(適格機関投資家専用)	41,184,314円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	37,500,556円

お知らせ

該当事項はありません。