

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／特殊型(絶対収益追求型)
信託期間	信託期間は2016年1月20日から2025年10月10日までです。
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	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が運用する「マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)」を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	原則として、毎年10月10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。

SuMi TRUST マルチストラテジー／ SMARS(SMA専用)

運用報告書(全体版)

第8期(決算日 2023年10月10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。
- ・ 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。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金	騰 落 率				
第4期(2019年10月10日)	円 9,835	円 0	% △1.3	% —	% 99.3	百万円 521	
第5期(2020年10月12日)	10,335	0	5.1	—	99.1	410	
第6期(2021年10月11日)	10,519	0	1.8	—	98.8	287	
第7期(2022年10月11日)	10,256	0	△2.5	—	98.5	240	
第8期(2023年10月10日)	10,000	0	△2.5	—	99.0	172	

(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入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比
	騰 落 率				
(当 期 首) 2022年10月11日	円 10,256	% —	% —	% 98.5	
10月末	10,277	0.2	—	98.4	
11月末	10,338	0.8	—	99.0	
12月末	10,331	0.7	—	99.1	
2023年 1月末	10,290	0.3	—	99.2	
2月末	10,110	△1.4	—	99.1	
3月末	10,263	0.1	—	98.9	
4月末	10,279	0.2	—	98.7	
5月末	10,257	0.0	—	99.0	
6月末	10,347	0.9	—	99.0	
7月末	10,297	0.4	—	99.0	
8月末	10,255	△0.0	—	99.0	
9月末	10,094	△1.6	—	98.7	
(当 期 末) 2023年10月10日	10,000	△2.5	—	99.0	

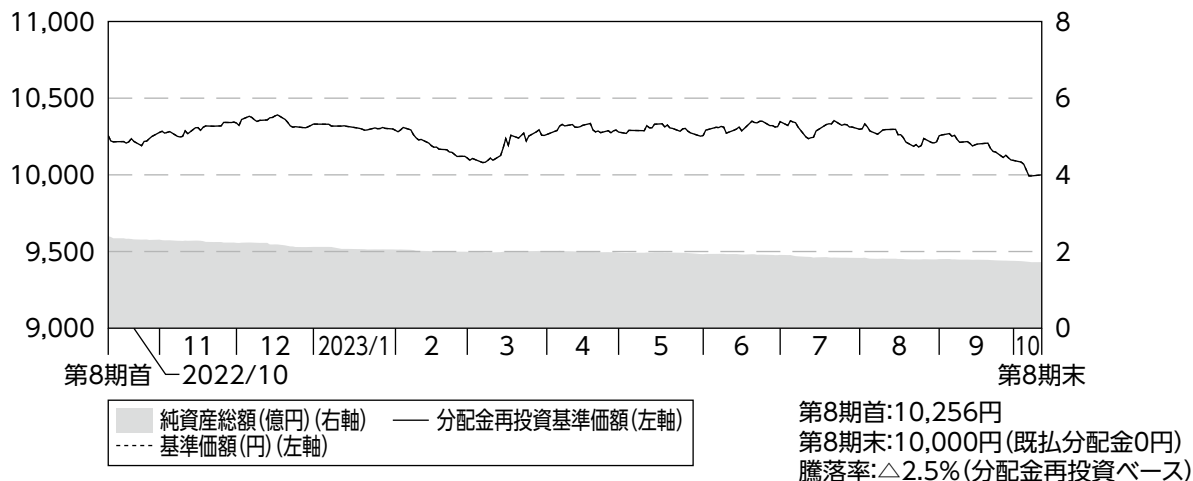
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

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は、2022年10月11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

当ファンドの主な投資対象である「マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額も下落しました。マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)では、主要中央銀行による金融引き締めなどが影響して長期金利が上昇する中、先進国ハイインカム入替戦略や債券先物を保有しているオーバーレイヘッジ戦略がマイナスに影響しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
マルチ・ストラテジー・ファンド (適格機関投資家専用)	わが国を含む世界の株式及び債券並び にデリバティブ取引及び為替予約取引	99.0%	△2.4%
マネープールマザーファンド	わが国の公社債等	0.6%	△0.1%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境

国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。先進国を中心にインフレ率がピークアウトしている中で、米国を中心として実体経済が想定以上に強かったことから、リセッション懸念が薄らぎ投資家センチメントは回復しました。また、各国の中央銀行と比較して日銀の金融政策が緩和的だったことを受けて円安が進んだことも国内株式市場にプラスとなりました。

国内債券市場

国内債券10年利回りは、一時は10年ぶりの高水準となる0.80%近辺まで上昇しました。インフレ率が3.0%を超過する中、日銀は2022年12月と2023年7月にイールドカーブコントロールの運用を見直し、長期金利の変動許容幅を拡大させました。実質的な金融引き締め策を講じたことで、国内債券10年利回りは上昇基調となりました。

外国株式市場

外国株式市場は上昇しました。米国を中心として当初は金融引き締めが進むにつれて経済が冷え込んでいくと想定されていましたが、政策金利が高い中でも雇用環境や小売売上高などの実体経済に関する指標が強く、リセッション懸念が薄らいだことなどから株式市場は上昇しました。また生成AIを中心とした新しいテクノロジーなどが影響して、米国の大型ハイテク株が市場予想を上回る決算を発表したこともプラスに影響を与えました。

外国債券市場

外国債券利回りは上昇基調となりました。インフレ率はピークアウト基調であったものの、依然としてその水準は高いため、各国中央銀行は金融引き締めを継続し政策金利を上昇させました。また米国では政策金利が高いにもかかわらず実体経済が強かったことから、金融引き締めの長期化が意識され長期金利は上昇基調となりました。加えて、米国債の格下げや米国債発行の増加、政府閉鎖懸念などの債券に対する不安要素が重なったことも利回りの上昇に影響を与えました。

為替市場

主要通貨は対円で上昇しました。外国為替市場では、日米長期金利差を背景に、米ドルは対円で概ね上昇推移となりました。ユーロと英ポンドも金融政策の方向性の違いが意識されて対円で上昇しました。

○当ファンド

「マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を高位に保つ運用を行いました。

・「マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)」

世界の株式や債券に加え、先物取引や為替取引なども活用した様々な運用戦略を組み合わせることでリスク分散を図りました。また、戦略横断的なリスク管理を行うことで市場環境の変化に適切に対応し、戦略のエクスポージャーを調整するなど機動的な運用を行いました。なお、主要投資対象および主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じても行いました。

当期末時点での採用戦略は以下の通りです。

・TCA戦略

過去のリターン傾向やマクロ経済動向などをもとに市場の中長期的なトレンドを捉えようとする戦略です。流動性の高い債券先物、株式先物、為替予約を投資対象とします。

・先進国債券アロケーション戦略

先進国国債市場間に生じる利回り格差や価格の方向性に着目し、ロングショートポジションを構築することで市場動向に左右されない収益獲得を狙う戦略です。

・通貨アロケーション戦略

通貨間の金利差、貿易・経常収支による需給や物価水準などに着目することで、幅広い時間軸での通貨の動きを捉えて安定した収益獲得を目指す戦略です。

・株主還元リサーチ戦略

業績安定度の高い企業の中から、増配や自社株買いなど持続的な株主還元拡大が期待できる銘柄に投資することで、低ボラティリティと高株価リターンの両立を目指す戦略です。

・リビジョン&バリュー戦略(R&V戦略)

GARP型の現物株式ロングポジションにTOPIX先物のショートカバーを組み合わせたロングショート戦略です。リビジョン(業績修正)効果、バリュー効果によって高いリターンが見込まれる銘柄を選別します。

・ α フォーカス戦略

類似した2銘柄間のロング・ショートポジションを通じ、収益獲得を狙う戦略です。企業のファンダメンタルの違いや銘柄間の一時的な価格の乖離に着目しペアを構築します。

・クオンツバリュー戦略

PBR割安銘柄で構成されるロングポジションにTOPIX先物のショートカバーを組み合わせたクオンツタイプのロングショート戦略です。

・リサーチマーケットニュートラル戦略

社会や産業構造の変化に着目した投資テーマを切り口に銘柄を選別します。現物株式ロングポジションにTOPIX先物のショートカバーを組み合わせたマーケットニュートラル戦略です。なお、本戦略は、日本株式リサーチ・マーケット・ニュートラル マザーファンドへの投資を通じて行います。

当ファンドのポートフォリオ

- **中小型株戦略**
中小型株式市場のプレミアムと高い成長性を、ファンドマネージャーの銘柄選択を通じてより効率的に享受する戦略です。なお、本戦略はJapan Small Cap Fundへの投資を通じて行います。
- **外国株式最小分散戦略**
過去のリスクが小さい銘柄ほど、その後の実績リターンが大きくなる「ローリスク・ハイリターン」のアノマリー現象に着目した銘柄群でポートフォリオを構成し、高い運用効率を狙う戦略です。なお、本戦略は、外国株式最小分散インデックスマザーファンドへの投資を通じて行います。
- **先進国ハイインカム入替戦略**
定量モデル判断をメインに財政健全度と期待リターンが高い先進国の国債に投資し、原則為替ヘッジを行うことで安定的な絶対収益獲得を狙う戦略です。なお、本戦略は、先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド為替ヘッジありへの投資を通じて行います。
- **ゴールド投資戦略**
金ETFに投資し(通常の投資環境においては原則として組入比率0~5%程度を想定)、インフレ懸念の台頭や金融市場を揺るがす出来事が発生した場合に実質的な資産価値の保全を図る戦略です。
- **オーバーレイヘッジ戦略**
市場の大幅な変動が見込まれる際は、先物等を活用してポートフォリオ全体に対するヘッジポジションを構築し、機動的にリスクをコントロールする戦略です。

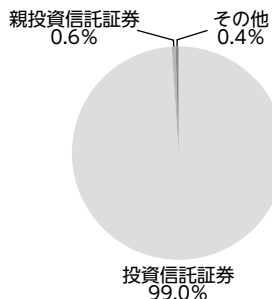
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

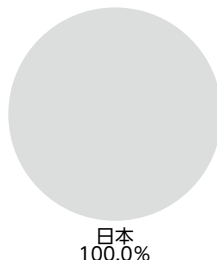
	当期末
	2023年10月10日
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	99.0%
マネープールマザーファンド	0.6%
その他	0.4%
組入ファンド数	2

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

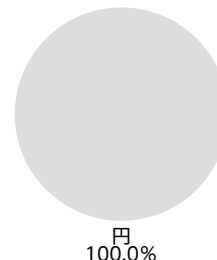
○資産別配分



○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、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8期	
	2022年10月12日~2023年10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	(円)	718

(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

○当ファンド

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が運用する「マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りを用いる運用戦略を含みます。

・マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)

主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りを用いる運用戦略を含みます。

・マネープールマザーファンド

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年10月12日~2023年10月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	16円	0.154%	(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10,261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)	(6)	(0.055)	
(販売会社)	(6)	(0.055)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(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)	(—)	(—)	
(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)	(—)	(—)	
(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)	(0)	(0.000)	
合計	17	0.159	

(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。

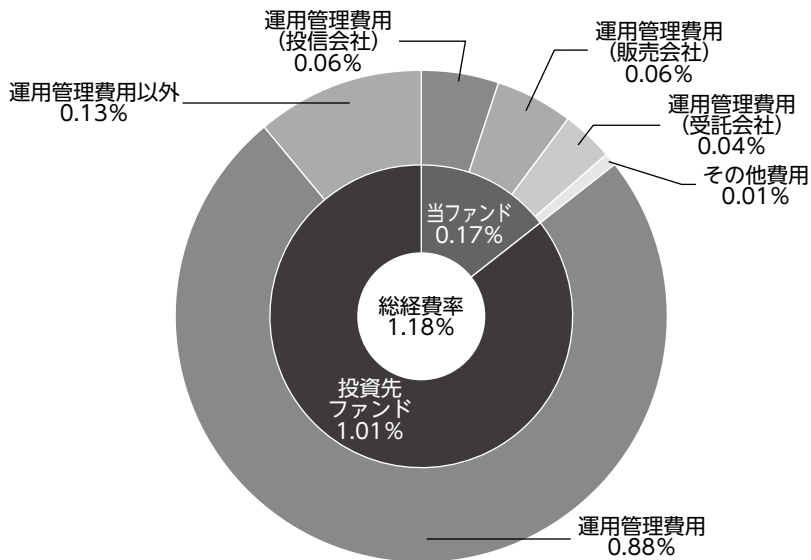
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<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1.18%です。



総経費率 (①+②+③)	1.18%
①当ファンドの費用の比率	0.17%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.88%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13%

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

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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)投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)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

<投資信託受益証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	マルチ・ストラテジー・ファンド (適格機関投資家専用)	千口 —	千円 —	千口 63,225	千円 62,035

(注)金額は受渡代金です。

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			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投資信託受益証券	百万円 —	百万円 —	% —	百万円 62	百万円 62	% 100.0
金 銭 信 託	0.000096	0.000096	100.0	0.000096	0.000096	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	315	34	10.8	320	35	10.9

(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。

<マネープールマザーファンド>

区 分	当 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 28	百万円 28	% 100.0	百万円 28	百万円 28	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	72,136,387	8,050,083	11.2	72,290,277	8,096,181	11.2

<平均保有割合 0.0%>

(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

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	千口 178,654	千円 170,543	% 99.0

(注) 比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネープールマザーファンド	千口 1,004	千口 1,004	千円 1,005

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、232,534,561千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 170,543	% 98.4
マ ネ ー プ ー ル マ ザ ー フ ァ ン ド	1,005	0.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,738	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	173,286	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10月10日現在
(A)資 産	173,286,546円
コー ル・ロ ー ン 等	943,424
投資信託受益証券(評価額)	170,543,999
マネーパールマザーファンド(評価額)	1,005,478
未 収 入 金	793,645
(B)負 債	975,409
未 払 解 約 金	826,459
未 払 信 託 報 酬	143,869
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	5,080
(C)純 資 産 総 額(A-B)	172,311,137
元 本	172,303,242
次 期 繰 越 損 益 金	7,895
(D)受 益 権 総 口 数	172,303,242口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,000円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年10月12日 至 2023年10月10日
(A)配 当 等 収 益	△535円
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△536
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,083,311
売 買 益	406,170
売 買 損	△4,489,481
(C)信 託 報 酬 等	△318,058
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△4,401,904
(E)前 期 繰 越 損 益 金	3,317,019
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,092,780
(配 当 等 相 当 額)	(2,971,792)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,879,012)
(G) 計 (D+E+F)	7,895
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	7,895
追 加 信 託 差 損 益 金	1,092,780
(配 当 等 相 当 額)	(2,971,792)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,879,012)
分 配 準 備 積 立 金	9,403,964
繰 越 損 益 金	△10,488,849

- (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234,124,794円、期中追加設定元本額は2,540,690円、期中一部解約元本額は64,362,242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)	－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	2,971,792円
(D) 分配準備積立金額	9,403,964円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	12,375,756円
(F) 期末残存口数	172,303,242口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	718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。

組入投資信託証券の内容

■マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用方針	主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引、オプション取引、スワップ取引(トータル・リターン・スワップ取引を含みます。)、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引(以下、「デリバティブ取引」といいます。))及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。 ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。
主要運用対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。
組入制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。))への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の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。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。

●損益の状況

項目	第 10 期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日
(A)配当等収益	354,960,591円
受取配当金	323,069,804
受取利息	65,694
その他の収益	38,392,545
支払利息	△6,567,452
(B)有価証券売買損益	△163,723,801
売買益	4,415,241,652
売買損	△4,578,965,453
(C)先物取引等取引損益	△758,209,327
取引益	1,886,366,556
取引損	△2,644,575,883
(D)信託報酬等	△432,095,655
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△999,068,192
(F)前期繰越損益金	227,632,910
(G)追加信託差損益金	△244,314,013
(配当等相当額)	(199,105,092)
(売買損益相当額)	(△443,419,105)
(H)計(E+F+G)	△1,015,749,295
(I)収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	△1,015,749,295
追加信託差損益金	△244,314,013
(配当等相当額)	(200,014,267)
(売買損益相当額)	(△444,328,280)
分配準備積立金	359,245,722
繰越損益金	△1,130,681,004

●組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第9期末 株数 (千株)	第10期 株数 (千株)	期末 評価額 (千円)
鉱業(1.5%)			
INPEX	34	96.1	134,347
石油資源開発	—	3.7	15,410
建設業(4.2%)			
ウエストホールディングス	4	4	14,840
ショーボンドホールディングス	3.4	—	—
ミライト・ワン	4	—	—
日本アクア	—	138	131,790
コムシスホールディングス	4.5	—	—
大成建設	4.4	6.4	27,456
大林組	—	4.1	3,972
飛島建設	2.7	1.4	1,451
長谷工コーポレーション	12	7.2	10,612
鹿島建設	3.9	11.1	16,849
鉄建建設	1.2	—	—
西松建設	12.5	12.5	41,750
東鉄工業	—	3.9	10,214
熊谷組	3.7	—	—
日本道路	—	0.8	4,912
五洋建設	—	8.5	5,363
住友林業	12.9	—	—
大和ハウス工業	30.3	30.1	91,624
積水ハウス	4.5	—	—
ユアテック	11.2	10.7	7,928
関電工	27.5	16	13,536
きんでん	7.4	13.3	19,005
東京エネシス	2.4	—	—
エクシオグループ	7.1	5.6	12,835
九電工	8.9	2.6	8,307
日揮ホールディングス	20.7	—	—
大気社	4.6	1.6	5,472
インフロンア・ホールディングス	—	2.4	2,433
食料品(2.1%)			
日清製粉グループ本社	—	15	23,385
中部飼料	3.3	—	—
日本甜菜製糖	6.3	5.9	9,646
山崎製パン	2.3	6.7	9,996
森永乳業	—	5.9	27,553
雪印メグミルク	3.7	5.8	10,254
伊藤ハム米久ホールディングス	14.8	—	—
アサヒグループホールディングス	4.4	—	—
キリンホールディングス	0.9	4.9	9,954
サントリー食品インターナショナル	6.1	—	—
味の素	5.3	—	—
アリアケジャパン	2.3	—	—
ニチレイ	13.5	7.4	19,410
東洋水産	3	3.6	20,124
日清食品ホールディングス	3.3	1.4	15,708
日本たばこ産業	38	26	68,783
わらべや日洋ホールディングス	6.3	2.8	5,320
繊維製品(0.7%)			
グンゼ	—	0.7	2,968
東洋紡	9.6	6.5	6,636

銘柄	第9期末 株数 (千株)	第10期 株数 (千株)	期末 評価額 (千円)
倉敷紡績	3	3.7	8,073
東レ	—	20.3	15,856
ホギメディカル	3.4	—	—
T S Iホールディングス	48.1	20.3	11,368
ワールド	11.2	11.3	15,029
オンワードホールディングス	—	22.8	7,752
パルプ・紙(2.2%)			
日本製紙	21.3	14.7	13,935
レンゴー	348	237.6	207,900
化学(6.2%)			
旭化成	62.2	33.3	32,117
レゾナック・ホールディングス	4.2	—	—
住友化学	23.1	—	—
日産化学	2.3	1	6,120
クレハ	9.5	1.3	10,764
石原産業	—	2.4	2,616
日本曹達	6.7	4.3	18,705
東ソー	—	3.3	5,560
デンカ	18	5.1	13,576
信越化学工業	11	10.9	209,879
日本酸素ホールディングス	7.7	—	—
日本化学工業	1.1	—	—
保土谷化学工業	2.1	—	—
日本触媒	5.4	2.4	13,152
大日精化工業	—	0.9	1,613
三菱瓦斯化学	12.8	—	—
三井化学	1.3	6.8	21,284
J S R	4.6	3.9	12,109
東京応化工業	11.3	—	—
K Hネオケム	3.6	5.6	15,181
住友ベークライト	2.5	—	—
積水化学工業	—	24.9	45,591
日本ゼオン	25.4	—	—
扶桑化学工業	46.2	2	7,270
A D E K A	7	2.5	5,335
日油	—	2.3	12,604
花王	—	7.4	38,280
日本ペイントホールディングス	—	5.5	6,413
太陽ホールディングス	8.4	—	—
富士フイルムホールディングス	—	2	13,768
資生堂	—	1.7	11,259
高砂香料工業	4.1	3.9	10,299
ファンケル	—	2	5,240
ポーラ・オルビスホールディングス	13.2	—	—
アクシーシア	29.9	42	53,760
タカラバイオ	5.9	—	—
クミアイ化学工業	—	11.8	10,230
日東電工	9.9	3.9	32,994
エフピコ	—	4.2	15,477
ユニ・チャーム	1.5	1.6	8,072
医薬品(3.2%)			
武田薬品工業	20.1	2.5	10,455
アステラス製薬	63.6	66.7	127,663

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
塩野義製薬	1.1	2.7	16,996	—
日本新薬	1.4	—	—	—
ロート製薬	5.9	—	—	—
小野薬品工業	19	12.6	35,626	—
参天製薬	—	13.4	13,279	—
キッセイ薬品工業	3.4	—	—	—
JCRファーマ	4.3	—	—	—
東和薬品	1.8	—	—	—
第一三共	8.8	2.7	10,989	—
大塚ホールディングス	12.1	23.1	94,432	—
大正製薬ホールディングス	—	2.3	12,167	—
あすか製薬ホールディングス	—	6.4	7,654	—
石油・石炭製品(0.6%)				
ニチレキ	7.7	7.1	9,691	—
出光興産	7	5	15,725	—
ENEOSホールディングス	132	76.4	35,144	—
コスモエネルギーホールディングス	11.2	—	—	—
ゴム製品(0.4%)				
ブリヂストン	13.7	7.1	34,285	—
住友理工	17.8	10.4	7,124	—
バンドー化学	—	2.8	2,808	—
ガラス・土石製品(0.8%)				
住友大阪セメント	—	3.3	11,236	—
太平洋セメント	2.4	—	—	—
東海カーボン	4.8	5	5,415	—
東洋炭素	8.5	6	24,390	—
ノリタケカンパニーリミテド	1.9	2.9	12,267	—
MARUWA	2.5	0.6	10,548	—
ニチアス	2	6.5	16,386	—
鉄鋼(0.3%)				
日本製鉄	21.8	3.9	10,413	—
神戸製鋼所	37.2	—	—	—
中山製鋼所	—	13.5	14,310	—
JFEホールディングス	19.1	—	—	—
大和工業	6.7	—	—	—
愛知製鋼	—	1.4	3,098	—
非鉄金属(1.4%)				
日本軽金属ホールディングス	4.9	—	—	—
三菱マテリアル	9	3.2	6,854	—
住友金属鉱山	26.1	14.4	72,720	—
UACJ	2.9	—	—	—
日本電解	24	—	—	—
古河電気工業	—	3.2	7,942	—
住友電気工業	54.8	28.8	46,857	—
フジクラ	11	—	—	—
リョービ	3.9	7.6	9,606	—
金属製品(0.9%)				
SUMCO	—	6.3	12,631	—
東洋製鐵グループホールディングス	17.7	8.7	14,033	—
ホッカンホールディングス	7.1	2.8	3,889	—
横河ブリッジホールディングス	6.3	—	—	—
LIXIL	—	13.9	29,676	—
ジーテクト	9.6	8.2	11,201	—
東プレ	3.5	1	1,263	—
日本発條	—	26.7	24,110	—

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
機械(6.2%)				
日本製鋼所	43.1	—	—	—
三浦工業	—	4.1	12,997	—
オークマ	—	2.1	10,878	—
芝浦機械	24.3	8.9	24,848	—
アマダ	—	7.9	8,998	—
FUJ I	—	11.1	23,809	—
牧野フライス製作所	3.6	—	—	—
旭ダイヤモンド工業	14.8	10.3	7,632	—
DMG森精機	21.3	12.5	24,662	—
ソディック	—	17.4	13,032	—
ディスコ	0.7	—	—	—
オプトラン	—	18.7	46,843	—
平田機工	—	1.1	7,095	—
三井海洋開発	10.7	—	—	—
SMC	1.6	1.5	101,715	—
小松製作所	34.2	26.5	82,892	—
住友重機械工業	10.6	2.9	8,099	—
日立建機	6.8	3.5	10,587	—
井関農機	9.1	8.4	10,113	—
クボタ	—	15.4	30,122	—
新東工業	17.5	16.8	12,045	—
荏原製作所	5.4	3.8	20,786	—
栗田工業	5.7	—	—	—
アネスト岩田	13	1.5	1,288	—
タダノ	—	2.6	2,457	—
CKD	4.3	3.8	7,622	—
平和	—	5.6	12,807	—
SANKYO	8.4	4.6	23,874	—
アマノ	—	2.6	6,338	—
マックス	2.7	2.8	5,899	—
グローリー	8.9	4.4	9,988	—
セガサミーホールディングス	18.7	9.7	19,487	—
リケン	3.7	—	—	—
TPR	8.8	10.8	14,202	—
ツバキ・ナカシマ	—	0.8	940	—
ジェイテクト	21.2	30.4	29,792	—
不二越	3.8	3.1	11,919	—
日本トムソン	—	15.9	9,603	—
THK	2.2	—	—	—
イーグル工業	9.6	5	5,640	—
キッツ	7.8	—	—	—
三菱重工業	15.1	1.7	8,398	—
IHI	12.3	3.7	14,152	—
スター精密	12.7	—	—	—
電気機器(14.3%)				
日清紡ホールディングス	19.6	2.4	2,306	—
イビデン	3	2.1	10,489	—
コニカミノルタ	—	71.7	38,861	—
ミネベアミツミ	6.9	—	—	—
日立製作所	5.2	3.2	22,454	—
東芝	11.2	—	—	—
三菱電機	30.6	48.1	72,366	—
富士電機	28.6	14.7	76,146	—
安川電機	—	4.2	21,420	—

銘柄	第9期末		第10期末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)		
明電舎	18.7	—	—	—
山洋電気	2.8	2.3	12,995	—
PHCホールディングス	—	0.8	1,244	—
日本電産	9.7	0.6	4,424	—
東光高岳	—	2.1	4,195	—
ダイヘン	2.5	—	—	—
JVCケンウッド	—	24.3	9,963	—
I-PEX	2.9	—	—	—
日新電機	7.6	—	—	—
大崎電気工業	21.3	17	8,942	—
ジェス・エアサ コーポレーション	2.7	—	—	—
日本電気	13.2	9.8	47,138	—
富士通	0.8	2.5	44,737	—
アイホン	1.5	0.4	775	—
ルネサスエレクトロニクス	34.7	17	24,080	—
セイコーエプソン	7.8	—	—	—
アルパック	5.6	—	—	—
EIZO	3.6	—	—	—
パナソニック ホールディングス	40.1	80.1	92,595	—
アンリツ	12.4	—	—	—
ソニーグループ	9	7.8	94,029	—
TDK	7.8	14.3	67,853	—
アルプスアルパイン	1.9	18.5	26,103	—
メイコー	4	—	—	—
フォスター電機	1.3	11.2	10,976	—
マクセル	9	3	4,314	—
横河電機	14.9	—	—	—
新電元工業	4.4	3.6	12,186	—
日本光電工業	—	4.8	15,792	—
アドバンテスト	—	3.9	38,454	—
エスベック	—	3.1	6,355	—
キーエンス	0.8	0.8	48,856	—
シスメックス	—	3	26,382	—
フェローテックホールディングス	11	8	25,840	—
イリゾ電子工業	—	1.3	5,785	—
レーザーテック	1.3	—	—	—
スタンレー電気	8.6	3.7	10,326	—
ウシオ電機	19.3	—	—	—
日本電子	11.1	—	—	—
ファナック	1.1	—	—	—
芝浦電子	9.9	—	—	—
エンブラス	—	4.3	17,243	—
大真空	14	—	—	—
ローム	2.1	7	73,570	—
浜松ホトニクス	4.9	2.6	18,304	—
三井ハイテック	19	—	—	—
新光電気工業	25.7	17.2	67,510	—
京セラ	9	6.5	42,315	—
太陽誘電	—	2.3	10,488	—
村田製作所	34.4	17.9	137,973	—
双葉電子工業	2.6	—	—	—
ニチコン	4.5	—	—	—
日本ケミコン	—	10.7	20,918	—
キャノン電子	3.3	—	—	—
キャノン	34.9	12.3	35,842	—
リコー	3.3	40.3	40,622	—

銘柄	第9期末		第10期末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)		
東京エレクトロン	4.3	2.6	121,446	—
輸送用機器(6.5%)				
ユニプレス	10.3	14.9	11,651	—
豊田自動織機	1.2	—	—	—
デンソー	—	3	22,062	—
東海理化電機製作所	0.2	—	—	—
川崎重工業	35.5	26.1	75,350	—
日産自動車	85.7	101	47,884	—
いすゞ自動車	—	14.1	22,588	—
トヨタ自動車	194.5	122.1	231,623	—
日野自動車	10.5	—	—	—
NOK	30.4	16.7	19,789	—
フタバ産業	16.5	—	—	—
KYB	5	—	—	—
プレス工業	37.5	30.8	13,521	—
アイシン	10.7	1.6	5,800	—
マツダ	38.1	30.1	32,026	—
本田技研工業	23.6	27.2	88,672	—
スズキ	3.2	5.5	26,581	—
SUBARU	13.9	22.1	47,724	—
エクセディ	4.5	5.1	8,838	—
豊田合成	3.8	—	—	—
エフ・シー・シー	—	9.6	13,756	—
シマノ	1.4	—	—	—
テイ・エス・テック	2.9	—	—	—
精密機器(0.8%)				
テルモ	2.5	—	—	—
日本エム・ディ・エム	10	—	—	—
島津製作所	—	2	8,000	—
インターアクション	1.7	—	—	—
ニコン	—	17.7	22,248	—
トプコン	2	—	—	—
オリンパス	—	18.1	45,231	—
A&Dホロンホールディングス	—	5.1	5,604	—
セイコーグループ	2.8	—	—	—
その他製品(3.4%)				
トランザクション	—	80	123,680	—
バンダイナムコホールディングス	—	4.9	42,242	—
大建工業	—	5.6	12,146	—
凸版印刷	21	18	37,134	—
大日本印刷	16.9	10.3	31,672	—
アシックス	—	3.2	9,888	—
任天堂	1.6	14.3	80,423	—
オカムラ	—	6	7,794	—
美津濃	3.1	2.9	8,436	—
電気・ガス業(2.9%)				
中部電力	5.7	41.8	57,893	—
関西電力	—	42.5	51,680	—
中国電力	27.5	34.4	23,598	—
北陸電力	11.1	—	—	—
東北電力	39.2	—	—	—
四国電力	30.8	37	26,899	—
九州電力	37.3	33.9	24,814	—
北海道電力	11.4	—	—	—
電源開発	7.8	9.5	20,301	—
イーレックス	—	11	25,850	—

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
東京瓦斯	14.8	5.1	13,989	
大阪瓦斯	14.2	14.2	30,487	
東邦瓦斯	10.1	8.2	20,336	
陸運業(2.4%)				
東急	15.5	88.6	143,000	
東日本旅客鉄道	5	—	—	
西日本旅客鉄道	—	2	10,538	
西武ホールディングス	—	5.7	8,293	
鴻池運輸	—	3.8	5,806	
ヤマトホールディングス	11.5	—	—	
山九	1.9	1.2	6,000	
センコーグループホールディングス	37.6	27.3	27,108	
セイノーホールディングス	—	8.6	11,309	
九州旅客鉄道	—	12.3	35,067	
海運業(—%)				
商船三井	3.9	—	—	
空運業(0.1%)				
日本航空	—	2.8	7,319	
倉庫・運輸関連業(0.0%)				
日新	—	1	2,188	
日本コンセプト	16	—	—	
情報・通信業(10.8%)				
NECネットエスアイ	8.5	6.5	10,465	
コーエーテクモホールディングス	1.5	—	—	
テクマトリックス	46	68	110,976	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	5.9	12,755	
GMOペイメントゲートウェイ	6.9	4.6	55,016	
アイル	—	9	17,901	
マークライNZ	—	25	69,000	
ダブルスタンダード	21.2	—	—	
シンクロ・フード	—	245	118,090	
オロ	—	3	5,988	
ユーザーローカル	9.6	6.6	9,193	
野村総合研究所	6.6	—	—	
フジ・メディア・ホールディングス	37.1	30.8	32,370	
Zホールディングス	33.2	25.5	10,516	
トレンドマイクロ	11.8	6.6	41,580	
伊藤忠テクノソリューションズ	1.7	9.6	29,712	
ANYCOLOR	—	4.6	23,138	
ネットワンシステムズ	—	11.9	38,377	
BIPROGY	5.1	10.1	31,108	
TBSホールディングス	20.6	14.4	21,470	
日本テレビホールディングス	20.7	22.1	22,674	
テレビ朝日ホールディングス	15.1	16.4	21,434	
スカパーJSATホールディングス	22.9	15.2	7,235	
テレビ東京ホールディングス	—	3.8	7,254	
日本電信電話	66.4	52.5	202,492	
KDDI	24.8	26.8	106,342	
ソフトバンク	16.7	—	—	
エヌ・ティ・ティ・データ	15.4	—	—	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2.9	—	—	
カブコン	—	2.6	10,881	
アイネス	—	1.1	1,449	
ソフトバンクグループ	1.1	14.4	90,259	
卸売業(5.4%)				
あらた	—	0.5	2,070	

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
双日	3.9	—	—	
アルフレッサ ホールディングス	—	17.5	27,912	
神戸物産	—	2.9	10,860	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	18	16.4	13,661	
ビューティガレージ	18	—	—	
小野建	—	4	6,020	
三菱食品	7.4	1.2	3,930	
第一興商	0.9	—	—	
メディカルホールディングス	8.9	7.7	13,251	
日本ライフライン	—	5.8	5,196	
伊藤忠商事	14.3	6.1	24,741	
長瀬産業	3.7	—	—	
豊田通商	9.9	10.3	57,989	
三井物産	—	21.1	82,543	
カメイ	3.8	3.3	4,851	
スターゼン	2	1.4	2,941	
住友商事	37	26	60,437	
三菱商事	26.3	19.2	88,128	
キャノンマーケティングジャパン	13.2	13.2	40,260	
ユアサ商事	1.4	0.5	1,767	
岩谷産業	2	—	—	
東邦ホールディングス	12.3	10.3	21,187	
サンゲツ	1.2	—	—	
PALTAC	—	0.5	2,385	
西本Wismettacホールディングス	—	18	63,360	
トラスコ中山	43	—	—	
オートバックスセブン	7	—	—	
ミスミグループ本社	20.9	—	—	
スズケン	—	6.2	21,080	
小売業(4.3%)				
サンエー	3.9	3.1	12,865	
カワチ薬品	4.6	4.3	9,743	
エービーシー・マート	5.6	7	48,370	
アスクル	5.7	—	—	
アダストリア	14	—	—	
くら寿司	4.3	—	—	
ハニーズホールディングス	6.4	—	—	
アルペン	6.8	—	—	
ビックカメラ	—	8.4	10,038	
DCMホールディングス	45.3	38.8	45,434	
Monotaro	15.6	—	—	
J.フロント リテイリング	—	4.8	5,788	
マツキヨココカラ&カンパニー	—	3.4	21,488	
ZOZO	2	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	29.7	7.7	10,641	
BENOS	—	15	31,860	
コスモス薬品	0.9	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	17.2	9.1	54,172	
ツルハホールディングス	—	0.5	4,730	
クスリのアオキホールディングス	—	2.2	16,104	
ノジマ	—	7.9	10,301	
サイゼリヤ	7.1	1.8	5,742	
上新電機	2.5	—	—	
日本瓦斯	18.3	18.3	34,660	
AOKIホールディングス	11.2	18.7	12,809	
青山商事	18.6	14.7	13,421	

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
しまむら	7.4	1.9	23,978	—
高島屋	21	—	—	—
エイチ・ツー・オー リテイリング	—	6.6	8,302	—
丸井グループ	15.5	—	—	—
イズミ	5	2.6	7,490	—
ゼビオホールディングス	27.6	14.2	13,007	—
ケーズホールディングス	—	2.2	2,582	—
シルバーライフ	—	9	15,309	—
アインホールディングス	—	0.7	3,766	—
ヤマダホールディングス	104.6	—	—	—
プレナス	2.8	—	—	—
サンドラッグ	4.4	4.1	14,780	—
ペルーナ	5.5	4.2	2,877	—
銀行業(6.1%)				
めぶきフィナンシャルグループ	—	24	8,112	—
東京さくらほしフィナンシャルグループ	1.5	—	—	—
九州フィナンシャルグループ	—	49.3	23,417	—
富山第一銀行	—	9.3	5,663	—
三十三フィナンシャルグループ	—	2.3	3,815	—
あおぞら銀行	17.4	3.7	9,708	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	224.8	165.7	155,443	—
りそなホールディングス	21.3	30.2	21,499	—
三井住友フィナンシャルグループ	54.8	45.1	254,093	—
千葉銀行	9.1	—	—	—
群馬銀行	33.6	—	—	—
岩手銀行	—	3.1	7,102	—
八十二銀行	—	42.9	23,895	—
滋賀銀行	0.8	—	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	—	23.1	23,076	—
百十四銀行	—	1.9	3,655	—
みずほフィナンシャルグループ	53.8	44.7	92,864	—
名古屋銀行	1.5	—	—	—
京葉銀行	6.3	—	—	—
トモニホールディングス	7.8	—	—	—
池田泉州ホールディングス	62	—	—	—
証券・商品先物取引業(0.7%)				
SBIホールディングス	46.9	23.9	66,179	—
大和証券グループ本社	—	9.1	5,596	—
野村ホールディングス	24.7	—	—	—
松井証券	—	6.3	4,914	—
保険業(1.2%)				
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	—	14.4	60,508	—
第一生命ホールディングス	38.1	—	—	—
東京海上ホールディングス	9.7	22.5	61,357	—
その他金融業(0.6%)				
イントラスト	—	11	10,373	—
クレディセゾン	—	10	17,290	—
オリックス	48.3	13.8	32,202	—
三菱HCキャピタル	20.5	—	—	—
不動産業(4.0%)				
日本駐車場開発	740	459.7	118,602	—
野村不動産ホールディングス	18.4	16.7	47,728	—
プレサンスコーポレーション	—	6.1	9,875	—
オープンハウスグループ	12.7	—	—	—
東急不動産ホールディングス	25.4	14.6	9,402	—

銘柄	第9期末		第10期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
飯田グループホールディングス	7.1	3.1	6,609	—
アズム	—	2.6	13,832	—
三井不動産	38.7	66.4	161,982	—
三菱地所	11.8	8.7	14,633	—
東京建物	16	—	—	—
住友不動産	13.6	—	—	—
ゴールドクレスト	7.4	7.1	11,466	—
イオンモール	—	4	7,180	—
カチタス	2.1	—	—	—
サンフロンティア不動産	9.7	6.5	7,111	—
サービス業(5.8%)				
MI X I	3	2.3	5,692	—
アイティメディア	48	30	45,570	—
エス・エム・エス	4.2	—	—	—
パーソルホールディングス	—	5.5	15,625	—
エムスリー	7.6	1.5	5,397	—
ディー・エヌ・エー	5.1	—	—	—
電通グループ	2.8	—	—	—
オリエンタルランド	—	0.3	6,472	—
リゾートトラスト	—	5.5	12,749	—
りらいあコミュニケーションズ	13.9	—	—	—
ユー・エス・エス	16.7	12	26,040	—
サイバーエージェント	—	4.4	5,517	—
楽天グループ	—	23.7	15,973	—
テクノプロ・ホールディングス	16.7	15.6	57,018	—
チャーム・ケア・コーポレーション	13	26.4	29,779	—
E R Iホールディングス	—	78	108,654	—
ウィルグループ	18	12.1	14,580	—
リクルートホールディングス	7.3	2.2	9,548	—
日本郵政	91.3	63.2	71,984	—
ベルシステム24ホールディングス	—	5.9	8,879	—
ストライク	9	—	—	—
リロググループ	—	6.2	13,274	—
T R Eホールディングス	78	2	2,838	—
大栄環境	—	3	4,902	—
共立メンテナンス	3.7	—	—	—
乃村工藝社	16	—	—	—
メイテック	7	24.2	59,096	—
ベネッセホールディングス	4.5	—	—	—
ダイセキ	25.6	17.8	75,739	—
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,612 366	5,755 357	10,280,024 <23.9%>

(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	第 9 期 末	第 10 期 末	
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額 (千円)
Japan Small Cap Fund—Class A JPY		9	9	156,157
Japan Small Cap Fund—Class B JPY		46	46	1,252,700
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	56	56	1,408,857
		2	2	<3.3%>

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘	柄	第 9 期 末	第 10 期 末	
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額
				外 貨 建 金 額 千米ドル
(アメリカ) SPDR GOLD SHARES ETF		42	36	6,337 840,222
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	42	36	6,337 840,222
		1	1	— <2.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	第 10 期 末	
			買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内	TOPIX		277	8,788
外国	S&P 500 EMIN		136	1,858
	DAX INDEX FU		273	1,478
	SGX Nifty 50		—	89
	NASDAQ 100MI		99	—
	S&P/TSE 60		270	—
	FTSE CHINA A		268	—
	EURO-BTP FUT		114	—
	US 10YR NOTE		8,727	—
	AUST 10Y BON		4,300	—

(注) 外貨建資産は、当該日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。

<親投資信託残高>

	第 9 期 末	第 10 期 末	
	口 数 千口	口 数 千口	評 価 額 千円
日本株式リサーチ・マーケット・ニュートラル マザーファンド	6,884,857	5,777,303	6,396,052
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	1,000	1,000	847
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	4,716,230	2,494,627	4,197,959

下記は、日本株式リサーチ・マーケット・ニュートラル マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第9期末	第10	期 末
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
鉱業(0.6%)			
INPEX	178.6	76.4	106,807
建設業(0.8%)			
コムシスホールディングス	32.9	—	—
大和ハウス工業	62.4	45.5	138,502
エクシオグループ	48.8	—	—
食料品(0.5%)			
寿スピリッツ	—	10.5	91,035
アリアケジャパン	4.5	—	—
化学(6.5%)			
信越化学工業	29.1	28.4	546,842
花王	19.1	24.8	128,290
資生堂	56.4	51.2	339,097
デクセリアルズ	31.5	25.1	71,459
医薬品(4.4%)			
エーザイ	47.5	39.9	303,120
第一三共	142.4	107.8	438,746
ガラス・土石製品(4.5%)			
OTO	68.7	54	252,720
日本碍子	138.1	12.9	22,962
MARUWA	20	27.6	485,208
非鉄金属(3.0%)			
住友金属鉱山	68.6	41	207,050
住友電気工業	211.6	186.5	303,435
金属製品(0.7%)			
SUMCO	73.7	57.3	114,886
機械(10.7%)			
日本製鋼所	96.8	119.1	320,855
芝浦機械	—	24.6	68,683
ディスコ	3.6	6.1	246,440
SMC	4.5	4.9	332,269
ダイキン工業	12.2	12.1	277,755
ダイフク	40.2	45.1	325,171
三菱重工業	—	43.4	214,396
電気機器(20.5%)			
イビデン	53.5	72.2	360,639
富士電機	38.2	52.2	270,396
明電舎	46.5	—	—
日本電産	23.8	—	—
オムロン	32.6	—	—
ソニーグループ	67.7	65.7	792,013
メイコー	—	28.2	82,203
アドバンテスト	16.7	14.7	144,942
キーエンス	10.7	10.4	635,128

銘柄	第9期末	第10	期 末
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
シスメックス	6.3	2.6	22,864
ファナック	6.8	2.4	55,392
新光電気工業	54.7	44.3	173,877
太陽誘電	28.4	21.2	96,672
村田製作所	40.8	44	339,152
東京エレクトロン	9.3	9.9	462,429
輸送用機器(7.3%)			
豊田自動織機	27.7	7.8	59,046
デンソー	38.1	33.6	247,094
川崎重工業	183.7	131.9	380,795
トヨタ自動車	349	149.4	283,411
アイシン	62	27.8	100,775
シマノ	8.4	6.5	155,285
精密機器(1.6%)			
HOYA	17.8	15.7	223,254
朝日インテック	17.8	15.7	36,267
その他製品(0.7%)			
ヤマハ	27.7	24.3	123,687
陸運業(2.2%)			
東海旅客鉄道	21.5	23.8	365,211
海運業(—%)			
商船三井	43.1	—	—
空運業(1.3%)			
ANAホールディングス	—	74.1	210,073
情報・通信業(7.8%)			
SHIFT	6.1	18.6	443,424
GMOペイメントゲートウェイ	7.2	10.6	126,776
野村総合研究所	88.2	73.7	220,878
伊藤忠テクノソリューションズ	57.9	38	117,610
日本電信電話	50.6	48.5	187,064
KADOKAWA	—	49.6	124,545
エヌ・ティ・ティ・データ	—	43.7	86,788
卸売業(2.7%)			
三菱商事	116.7	97.2	446,148
ミスミグループ本社	53.8	—	—
小売業(7.5%)			
マツキョココカラ&カンパニー	27.5	44.4	280,608
三越伊勢丹ホールディングス	—	239.9	331,541
コスモス薬品	7.8	6.9	88,941
良品計画	132.4	49.6	68,547
パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	—	83.5	198,479
ニトリホールディングス	5.4	7.4	125,800
ファーストリテイリング	1.7	1.9	156,864

銘 柄	第 9 期 末	第 10 期 末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
銀行業(4.6%)			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	650.2	605	567,550
三井住友フィナンシャルグループ	93.9	37.5	211,275
保険業(2.1%)			
第一生命ホールディングス	83	38.2	113,301
東京海上ホールディングス	34	89.8	244,884
不動産業(1.9%)			
パーク24	121.8	116.8	251,820
三井不動産	40.8	25.2	61,475
サービス業(8.1%)			
日本M&Aセンターホールディングス	62.7	—	—
エムスリー	60.1	48.5	174,503
オリエンタルランド	24.2	21.7	468,177
リクルートホールディングス	97.3	102.8	446,152
共立メンテナンス	44.2	48.5	275,480
合 計	株 数・金 額 4,491	株 数・金 額 3,870	評 価 額 16,774,977
	銘柄数<比率> 70	銘柄数<比率> 70	<88.5%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	第 10 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 TOPIX	—	16,608

下記は、先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	第 10	期 末				
		利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(ドイツ) 国債証券 DBR 1% 08/15/25	1.0	千ユーロ 16,600	千ユーロ 16,010	2,277,865	2025/8/15	
(フランス) 国債証券 FRTR 2% 11/25/32	2.0	4,200	3,936	559,983	2032/11/25	
(オランダ) 国債証券 NETHER 2% 07/15/24	2.0	6,000	5,946	846,035	2024/7/15	
(ベルギー) 国債証券 BGB 0.35% 06/22/32	0.35	4,400	3,509	499,350	2032/6/22	
(オーストリア) 国債証券 RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	3,600	3,166	450,521	2029/2/20	
(フィンランド) 国債証券 RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	8,100	7,201	1,024,528	2028/9/15	
(アイルランド) 国債証券 IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	4,300	3,446	490,319	2032/10/18	
ユ ー ロ 計				6,148,604		
(スウェーデン) 国債証券 SGB 1.5% 11/13/23	1.5	千スウェーデン クローナ 193,300	千スウェーデン クローナ 191,278	2,390,984	2023/11/13	
(デンマーク) 国債証券 DGB 1.75% 11/15/25	1.75	千デンマーク クローネ 96,900	千デンマーク クローネ 94,917	1,814,828	2025/11/15	
(オーストラリア) 国債証券 ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	千オーストラリア ドル 14,200	千オーストラリア ドル 12,199	1,114,872	2032/11/21	
合 計				11,469,290		

(注) 邦貨換算金額は、当該日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。

下記は、外国株式最小分散インデックスマザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	第9期末	第10期末			業種
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
AMAZON.COM	3	—	—	—	小売
ABBOTT LABORATORIES	36	28	320	42,434	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20	56	763	101,214	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	36	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	20	16	358	47,546	保険
ALLSTATE CORP	6	6	90	12,007	保険
AMGEN	4	17	428	56,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER	64	51	478	63,403	公益事業
AMERCO	5	—	—	—	運輸
COMCAST CORP-CL A	31	31	123	16,395	メディア・娯楽
APPLE INC	—	5	89	11,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMEREN CORPORATION	66	53	462	61,316	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	—	8	111	14,800	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOMATIC DATA PROCESS	52	42	959	127,221	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	4	3	844	111,924	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	80	57	1,765	234,063	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	67	10	48	6,454	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	7	5	144	19,170	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	437	415	1,715	227,431	電気通信サービス
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	49	40	412	54,705	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	46	—	—	—	メディア・娯楽
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	49	128	955	126,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	41	13	293	38,877	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	15	14	117	15,562	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CAMPBELL SOUP CO (US)	60	48	250	33,260	食品・飲料・タバコ
CHECK POINT SOFTWARE TECH	50	25	315	41,799	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	69	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	73	58	488	64,764	家庭用品・パーソナル用品
CISCO SYSTEMS	119	266	1,270	168,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	33	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
COLGATE-PALMOLIVE CO	81	65	481	63,876	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	—	2	62	8,286	ヘルスケア機器・サービス
CONSOLIDATED EDISON INC	195	158	1,486	197,056	公益事業
CMS ENERGY CORP	54	43	276	36,626	公益事業
DANAHER CORP	37	17	462	61,333	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	59	47	318	42,175	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	63	4	76	10,094	小売
REPUBLIC SERVICES INC	124	100	1,240	164,401	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	23	3	54	7,265	小売
DUKE ENERGY CORP	114	110	1,126	149,409	公益事業
ELECTRONIC ARTS INC	58	47	528	70,116	メディア・娯楽

銘柄	第9期末		第10期末		業種
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	14	11	271	36,018	保険
EXPEDITORS INTL WASH INC	37	29	337	44,738	運輸
NEXTERA ENERGY INC	201	—	—	—	公益事業
ASSURANT INC	—	15	207	27,481	保険
FIRST HORIZON CORP	—	163	404	53,595	銀行
FISERV INC	56	26	285	37,875	ソフトウェア・サービス
GENERAL MILLS INC	44	187	1,444	191,460	食品・飲料・タバコ
GILEAD SCIENCES INC	223	180	1,556	206,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MCKESSON CORP	—	11	426	56,549	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY FOODS CORPORATION	73	59	1,433	189,997	食品・飲料・タバコ
F5 INC	6	4	68	9,096	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUNIPER NETWORKS INC	62	50	154	20,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	—	19	166	22,084	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	8	7	237	31,431	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	48	38	430	57,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	166	132	605	80,314	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	—	5	266	35,325	ヘルスケア機器・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	41	34	621	82,359	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	34	87	738	97,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON & JOHNSON	127	101	1,663	220,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	88	126	871	115,510	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	35	28	366	48,559	家庭用品・パーソナル用品
KROGER CO	395	174	777	103,103	食品・生活必需品小売り
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	81	61	538	71,382	ソフトウェア・サービス
LILLY (ELI) & CO	40	31	1,067	141,508	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED PARCEL SERVICE B	9	8	162	21,547	運輸
DOMINION ENERGY INC	85	69	430	57,134	公益事業
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	80	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	54	43	1,175	155,900	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS	90	73	1,272	168,673	保険
ACTIVISION BLIZZARD INC	142	92	659	87,403	メディア・娯楽
MERCK & CO	177	143	1,488	197,285	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	37	30	779	103,387	ソフトウェア・サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	65	53	1,377	182,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XCEL ENERGY INC	232	188	1,298	172,122	公益事業
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	32	25	266	35,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWMONT CORPORATION	313	318	1,514	200,847	素材
EVERSOURCE ENERGY	13	13	112	14,941	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	—	3	178	23,690	資本財
CHENIERE ENERGY INC	13	26	385	51,157	エネルギー
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3	5	443	58,809	小売
ORACLE CORP	156	126	1,123	148,934	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	158	128	1,497	198,500	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	117	95	1,637	217,069	食品・飲料・タバコ
PFIZER	276	223	976	129,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	第 9 期 末		第 10 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BROWN & BROWN INC	20	—	—	—	保険
QUEST DIAGNOSTICS	—	9	131	17,463	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	92	74	1,057	140,263	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	78	62	866	114,861	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	31	8	675	89,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGEN INC	63	39	538	71,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROLLINS INC	35	28	102	13,639	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	—	15	672	89,122	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	47	38	1,096	145,396	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15	15	102	13,554	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	3	91	12,143	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
POOL CORP	1	1	70	9,303	小売
ELEVANCE HEALTH INC	—	1	65	8,630	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	—	13	205	27,282	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHERN CO	207	168	1,142	151,515	公益事業
AT&T INC	284	231	452	59,986	電気通信サービス
STARBUCKS CORP	42	—	—	—	消費者サービス
NETFLIX INC	16	—	—	—	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	89	218	464	61,630	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	37	53	971	128,815	半導体・半導体製造装置
TYLER TECHNOLOGIES INC	22	—	—	—	ソフトウェア・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	14	32	1,555	206,222	ヘルスケア機器・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	99	16	516	68,470	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALMART INC	105	72	1,022	135,520	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	140	110	1,675	222,115	商業・専門サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	43	34	528	70,019	食品・飲料・タバコ
CME GROUP INC	14	7	125	16,659	各種金融
WILLIAMS COS	—	123	391	51,849	エネルギー
ALLIANT ENERGY CORPORATION	35	27	149	19,784	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	154	124	1,169	155,039	公益事業
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	26	19	102	13,580	資本財
DOMINO'S PIZZA INC	15	12	430	57,106	消費者サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4	—	—	—	各種金融
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	—	7	64	8,516	素材
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25	15	167	22,159	各種金融
MASTERCARD INC-CLASS A	2	2	86	11,422	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	226	179	251	33,341	ソフトウェア・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	58	47	702	93,180	ソフトウェア・サービス
MASIMO CORP	12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	60	28	645	85,629	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9	9	93	12,374	商業・専門サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	59	52	662	87,858	各種金融
DOLLAR GENERAL CORP	73	59	1,361	180,489	小売

銘柄	第9期末		第10期末			業種
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SERVICENOW INC	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ABBVIE INC	—	61	888	117,763	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
T-MOBILE US INC	108	88	1,250	165,768	電気通信サービス	
KEURIG DR PEPPER INC	—	322	1,135	150,492	食品・飲料・タバコ	
BLACK KNIGHT INC	78	44	266	35,385	ソフトウェア・サービス	
EVERGY INC	25	19	121	16,092	公益事業	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PELTON INTERACTIVE INC-A	33	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	59	46	340	45,194	各種金融	
AON PLC	25	20	660	87,535	保険	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	36	—	—	—	各種金融	
U-HAUL HOLDING CO	—	39	242	32,130	運輸	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	24	24	264	35,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	96	78	1,398	185,417	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LIBERTY BROADBAND-C	78	—	—	—	メディア・娯楽	
WASTE CONNECTIONS INC	130	106	1,409	186,883	商業・専門サービス	
ALPHABET INC-CL C	6	—	—	—	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4	—	—	—	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	9,246 135	8,087 126	79,031 —	10,478,005 <63.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	135	154	1,086	107,191	素材	
BARRICK GOLD CORP	480	678	1,671	165,000	素材	
BCE INC	42	42	263	26,052	電気通信サービス	
CGI INC - CL A	56	45	557	54,979	ソフトウェア・サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	67	55	369	36,425	電気通信サービス	
OPEN TEXT CORP	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TELUS CORP	260	213	608	60,071	電気通信サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	—	96	382	37,772	メディア・娯楽	
THOMSON REUTERS CORP	—	83	1,333	131,633	商業・専門サービス	
KINROSS GOLD CORP	148	148	86	8,554	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	51	48	949	93,708	保険	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	249	201	1,183	116,774	素材	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	6	1,439	142,089	ソフトウェア・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	105	94	1,734	171,197	素材	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	30	—	—	—	商業・専門サービス	
HYDRO ONE LTD	—	142	514	50,821	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	1,654 13	2,012 14	12,182 —	1,202,272 <7.3%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
MERCK KGAA	15	9	180	25,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数 (百株)	第9期末	第10期末		業種	
		株数 (百株)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SAP SE	29	23	265	37,773	ソフトウェア・サービス	
BEIERSDORF AG	30	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
DEUTSCHE TELEKOM	1,001	810	1,632	232,207	電気通信サービス	
DEUTSCHE BOERSE	—	13	222	31,627	各種金融	
SYMRISE AG	51	41	413	58,763	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	529	491	130	18,514	電気通信サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	52	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	1,710 7	1,389 6	2,843 —	404,530 <2.4%>	
(イタリア)						
ENI	—	129	177	25,264	エネルギー	
RECORDATI SPA	22	22	92	13,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DIASORIN ITALIA SPA	14	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
INFRASTRUTTURA WIRELESS ITAL	186	160	162	23,161	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	223 3	312 3	432 —	61,544 <0.4%>	
(フランス)						
VIVENDI SE	—	367	362	51,597	メディア・娯楽	
ORANGE	767	983	941	133,878	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
SANOFI	—	41	352	50,120	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	777 3	1,393 3	1,655 —	235,596 <1.4%>	
(オランダ)						
KONINKLIJKE AHOLD NV	182	145	402	57,258	食品・生活必需品小売り	
WOLTERS KLUWER	—	60	618	87,998	商業・専門サービス	
QIAGEN N.V.	83	66	301	42,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KPN (KON.)	1,447	1,610	494	70,299	電気通信サービス	
FERRARI NV	13	5	125	17,862	自動車・自動車部品	
ADYEN NV	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	1,728 5	1,887 5	1,942 —	276,307 <1.7%>	
(スペイン)						
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65	200	324	46,177	公益事業	
TELEFONICA	—	323	111	15,844	電気通信サービス	
INDITEX	22	22	63	9,101	小売	
CELLNEX TELECOM SA	—	152	557	79,252	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	88 2	699 4	1,056 —	150,375 <0.9%>	
(ベルギー)						
SOFINA	8	—	—	—	各種金融	
UCB (GROUPE)	—	27	208	29,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	30	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18	18	147	20,983	各種金融	

銘柄		第9期末	第10期末			業種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
PROXIMUS		82	—	—	—	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV		17	13	174	24,892	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	156 5	59 3	531 —	75,545 <0.5%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		27	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27 1	— —	— —	— <—%>	
(フィンランド)						
SAMPO OYJ-A SHS		26	49	239	34,103	保険
ELISA A		79	69	358	50,970	電気通信サービス
KONE OYJ-B		117	94	477	67,908	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	223 3	213 3	1,075 —	152,982 <0.9%>	
(アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A		33	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33 1	— —	— —	— <—%>	
(ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS		127	50	97	13,914	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	127 1	50 1	97 —	13,914 <0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,096 31	6,005 28	9,635 —	1,370,797 <8.3%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
ASTRAZENECA		27	22	235	37,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADMIRAL GROUP PLC		107	—	—	—	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	135 2	22 1	235 —	37,544 <0.2%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA		2	1	387	55,411	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.96	0.87	167	23,917	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM		14	12	679	97,149	電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		0.31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG		2	2	629	89,932	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG		3	7	345	49,322	保険
NOVARTIS		193	186	1,479	211,516	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR		4	13	439	62,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS		61	49	1,395	199,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA - REGISTERED		181	146	1,636	234,005	食品・飲料・タバコ
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		30	24	567	81,129	運輸
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		3	3	225	32,217	素材
SWISS PRIME SITE-REG		10	37	305	43,694	不動産
SCHINDLER HOLDING AG-REG		8	6	133	19,076	資本財

銘柄	第9期末		第10期末		業種	
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	90	37	204	29,212	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BKW AG	—	11	157	22,514	公益事業	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	14	131	18,736	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	608 16	556 16	8,884 —	1,270,096 <7.7%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ERICSSON (LM) B	279	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	631	579	1,518	18,978	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	910 2	579 1	1,518 —	18,978 <0.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
TELENOR ASA	389	309	3,421	43,899	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	389 1	309 1	3,421 —	43,899 <0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVOZYMES A/S	59	32	1,163	22,246	素材	
NOVO NORDISK A/S-B	176	85	8,208	156,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	66	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	76	60	954	18,241	保険	
CHR HANSEN HOLDING A/S	9	—	—	—	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	387 5	178 3	10,325 —	197,427 <1.2%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
AUST AND NZ BANKING GROUP	140	—	—	—	銀行	
TELSTRA CORP	1,420	—	—	—	電気通信サービス	
COMPUTERSHARE LIMITED	—	124	305	27,949	ソフトウェア・サービス	
NEWCREST MINING LIMITED	—	66	163	14,930	素材	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	67	109	314	28,711	エネルギー	
WESFARMERS LTD	255	204	1,034	94,515	小売	
WOOLWORTHS GROUP LTD	100	91	335	30,678	食品・生活必需品小売り	
XERO LTD	30	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TELSTRA GROUP LTD	—	1,936	801	73,273	電気通信サービス	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	114	292	26,774	銀行	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,528	1,202	357	32,645	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,543 7	3,850 8	3,605 —	329,478 <2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	53	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	622	598	316	26,462	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	675 2	598 1	316 —	26,462 <0.2%>	
(香港)			千香港ドル			
HANG LUNG PROPERTIES LTD	—	820	1,279	21,605	不動産	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44	—	—	—	各種金融	
MTR CORP	865	750	3,131	52,886	運輸	

銘柄	株数 (百株)	第9期末	第10期末		業種	
		株数 (百株)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
HANG SENG BANK	426	377	4,701	79,403	銀行	
HONG KONG & CHINA GAS	5,725	4,595	3,565	60,225	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,065	1,830	4,776	80,671	銀行	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	722	—	—	—	小売	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	640	1,126	19,024	運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	—	234	507	8,576	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,847 6	9,246 7	19,087 —	322,394 <1.9%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	271	271	101	10,154	資本財	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	446	431	394	39,448	各種金融	
OCBC BANK	716	572	743	74,300	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,568	3,678	937	93,713	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,001 4	4,952 4	2,177 —	217,616 <1.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	34	491	18,776	半導体・半導体製造装置	
ICL LTD	391	350	932	35,576	素材	
NICE LTD	4	4	298	11,409	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	395 2	388 3	1,722 —	65,763 <0.4%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	38,892 226	36,788 213	— —	15,580,738 <94.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	第 9 期 末		第 10 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
CROWN CASTLE INC	4	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	5	4	1,340	177,772	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	0.888	149	19,777	
EQUINIX INC	0.1	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	13	5	1,490	197,549
	銘 柄 数 <比 率>	5	2	—	<1.2%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	42	34	2,138	36,120	
HKT TRUST AND HKT LTD	211	210	2,226	37,597	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	148	148	797	13,473	
小 計	口 数 ・ 金 額	401	392	5,162	87,191
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.5%>
合 計	口 数 ・ 金 額	414	397	—	284,741
	銘 柄 数 <比 率>	8	5	—	<1.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	第 10 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 S&P 500 EMIN	300	—
S&P/TSE 60	122	—

(注) 外貨建資産は、当該日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。

マネープールマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2022年11月21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2010年2月26日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等にも投資します。
組入制限	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1万円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。
- ・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。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
第 9 期 (2018年11月20日)	円	%	%	%	百万円 577,044
第10期 (2019年11月20日)	10,032	△0.1	—	—	544,455
第11期 (2020年11月20日)	10,024	△0.1	—	—	486,701
第12期 (2021年11月22日)	10,019	△0.0	—	—	358,814
第13期 (2022年11月21日)	10,015	△0.0	—	—	371,933

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
	騰 落	率		
(当 期 首) 2021年11月22日	円	%	%	%
11月末	10,015	—	—	—
12月末	10,015	0.0	—	—
2022年 1月末	10,014	△0.0	—	—
2月末	10,014	△0.0	—	—
3月末	10,014	△0.0	—	—
4月末	10,014	△0.0	—	—
5月末	10,014	△0.0	—	—
6月末	10,013	△0.0	—	—
7月末	10,013	△0.0	—	—
8月末	10,013	△0.0	—	—
9月末	10,012	△0.0	—	—
10月末	10,012	△0.0	—	—
(当 期 末) 2022年11月21日	10,011	△0.0	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

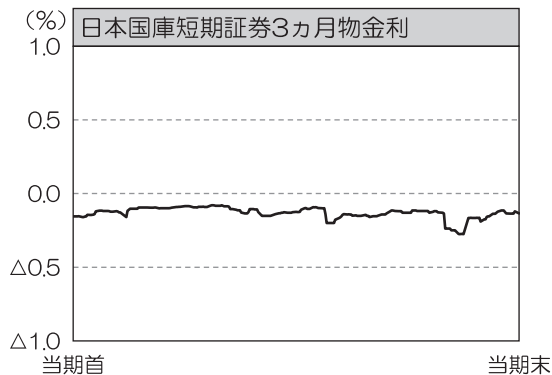
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09\sim 0\%$ 近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

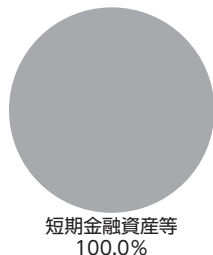
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

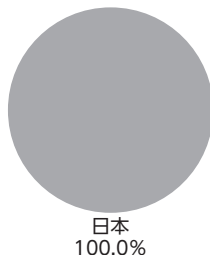
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

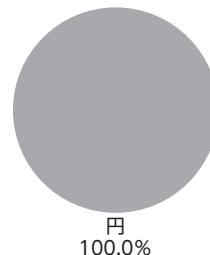
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主としてわが国の公社債を投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。ポートフォリオにつきましては、金利動向やマーケット環境を踏まえながら、債券組入比率の向上を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月23日～2022年11月21日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(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
（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）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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
（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）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(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、金銭信託預入に係る手数料等
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

(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(10,013円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コール・ローン	91,846,878	6,401,770	7.0	91,833,999	6,401,770	7.0

(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。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 371,934,952	% 100.0
投資信託財産総額	371,934,952	100.0

※ 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。

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 2022年11月21日現在
(A) 資産	371,934,952,946円
コール・ローン等	371,934,952,946
(B) 負債	1,497,555
未払解約金	544,709
未払利息	952,764
その他未払費用	82
(C) 純資産総額(A-B)	371,933,455,391
元本	371,514,353,891
次期繰越損益金	419,101,500
(D) 受益権総口数	371,514,353,891口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,011円

■損益の状況

項目	当期 自2021年11月23日 至2022年11月21日
(A) 配当等収益	△150,256,731円
受取利息	1,724,564
支払利息	△151,981,295
(B) その他費用	△82
(C) 当期損益金(A+B)	△150,256,813
(D) 前期繰越損益金	549,315,622
(E) 追加信託差損益金	155,678,449
(F) 解約差損益金	△135,635,758
(G) 計(C+D+E+F)	419,101,500
次期繰越損益金(G)	419,101,500

(注1) (E)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2) (F)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358,265,002,227円、期中追加設定元本額は114,656,558,826円、期中一部解約元本額は101,407,207,162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。

225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	103,275,806,469円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	97,023,993,837円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	40,913,946,872円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	30,921,835,681円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	23,295,546,510円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	21,404,228,793円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	15,577,844,099円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	4,267,283,000円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	4,138,099,571円
北米株配当戦略投信2018-11 (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	3,905,313,624円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
225ベアファンド9 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	3,382,622,913円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,616,273,059円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,331,276,690円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	1,057,375,332円
米国株価指数レバレッジ戦略ファンド (米国国債リスクコントロール型) (適格機関投資家専用)	99,396,417円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	299,461円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円

債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210, 100円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105, 486円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99, 941円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49, 791円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19, 911円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9, 983円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9, 983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9, 983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9, 979円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9, 972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9, 972円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9, 970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9, 970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9, 970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9, 963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9, 963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 962円
GARSファンド	9, 961円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9, 961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9, 961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9, 961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9, 961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9, 961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (ブラジル・レアルコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (円コース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (メキシコ・ペソコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (トルコ・リラコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (米ドルコース)	9, 960円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9, 957円
債券コア・セレクション	9, 956円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9, 953円
債券コア戦略ファンド	9, 953円
外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9, 952円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9, 951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9, 951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9, 950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9, 950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4, 989円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4, 985円
バンクローン・オープン (ユーロコース) (SMA専用)	1, 993円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (毎月決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (毎月決算型)	1, 991円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1, 990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1, 990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1, 990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (豪ドルコース)	988円

お知らせ

該当事項はありません。