

DCダイワS&P500 インデックス

運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2022年9月7日）
（作成対象期間 2022年4月7日～2022年9月7日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2022年4月7日）		
運用方針	投資成果をS&P500指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンドの受益証券	
	S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド	イ. 米国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） ロ. 米国の企業のDR（預託証券） ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）	
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの 株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの 株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、米国の株式に投資し、投資成果をS&P500指数（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P 500 指数 (円ベース) (※配当なし)		株式組入 比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率					
1 期末(2022年9月7日)	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
	10,029	0	0.3	9,976	△0.2	85.0	2.7	10.1	2.5	270

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S&P500指数(円ベース)は、S&P500指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

S&P500指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ I」)の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S & P」)の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJ Iに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。DCダイワS & P 500インデックスは、SPDJ I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、設定日の前営業日を10,000として指数化したものです。

*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

*ベンチマークはS&P500指数（円ベース）（※配当なし）です。

■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：10,029円（分配金0円）

騰落率：0.3%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「S&P500インデックス・マザーファンド」を通じてベンチマークに連動させることをめざした運用を行った結果、米国株式が下落した一方で、米ドルが対円で上昇（円安）したことからベンチマークはほぼ横ばいとなり、当ファンドの基準価額もほぼ横ばいとなりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワS&P500インデックス

年 月 日	基 準 価 額		S & P 500 指 数 (円ベース) (※配当なし)		株式組入 比	株式先物 率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	(ベンチマーク)				
(期首) 2022年4月7日	円 10,000	% -	(4/6) 10,000	% -	% -	% -	% -	% -
4月末	9,620	△3.8	9,616	△3.8	88.1	3.3	6.3	2.6
5月末	9,526	△4.7	9,509	△4.9	83.3	3.1	11.3	2.3
6月末	9,335	△6.7	9,310	△6.9	91.9	3.0	2.6	2.7
7月末	9,812	△1.9	9,778	△2.2	88.7	2.9	5.8	2.6
8月末	9,903	△1.0	9,856	△1.4	85.8	2.8	9.1	2.4
(期末) 2022年9月7日	10,029	0.3	9,976	△0.2	85.0	2.7	10.1	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022.4.7～2022.9.7)

■米国株式市況

米国株式市況は下落しました。

米国株式市況は、当ファンド設定時より2022年6月にかけて、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの思惑が強まり、景気の先行き懸念が台頭したことで、下落しました。その後は、資源価格の上昇一服でインフレ懸念が後退し、将来的な利下げ転換期待なども生じたことで8月半ばにかけて上昇しましたが、F R B高官の金融引き締めに積極的な発言などを受け、当作成期末にかけて株価は反落しました。

■為替相場

為替相場は、円安米ドル高となりました。

米ドル対円為替相場は、当ファンド設定時より、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違がより明確となって、円安が大きく進行しました。

ポートフォリオについて

(2022.4.7～2022.9.7)

■当ファンド

「S & P 500インデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■S & P 500インデックス・マザーファンド

株式組入比率（D R（預託証券）、E T F（上場投資信託証券）、株価指数先物、リートを含む。）は、当作成期を通じて原則として100%前後で運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、S&P500指数採用銘柄に投資し、S&P500指数に連動するE T Fも組み入れることによりS&P500指数との連動性を維持するように運用を行いました。また、効率性の観点からS&P500指数に連動する株価指数先物も利用しました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
S & P 500インデックス・マザーファンド	S&P500指数（円ベース）（※配当なし）

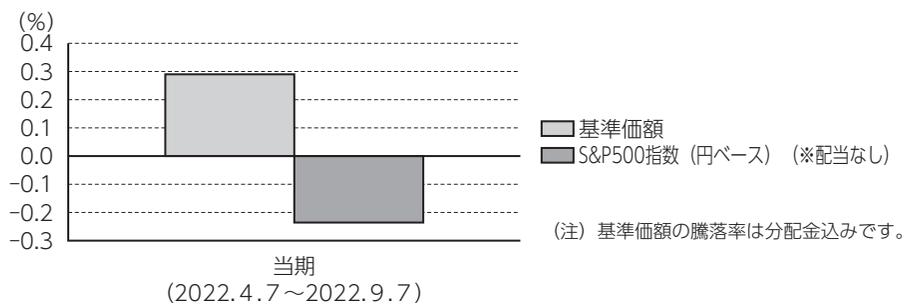
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 0.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は 0.3% となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。

また、配当金に対する課税分や保管費用、運用管理費用等のコスト負担、組み入れている株式ポートフォリオ（DR（預託証券）、ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物、リートを含む。）とベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはS&P500指数（円ベース）（※配当なし）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長に資することを目的に、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年4月7日 ～2022年9月7日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	28

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

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

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

主として「S & P 500インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■S & P 500インデックス・マザーファンド

主として、米国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からS&P500指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）や先物にも投資します。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.4.7~2022.9.7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	9円	0.093%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,634円です。
(投 信 会 社)	(5)	(0.051)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.032)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.009)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	1	0.010	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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
合 計	10	0.103	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

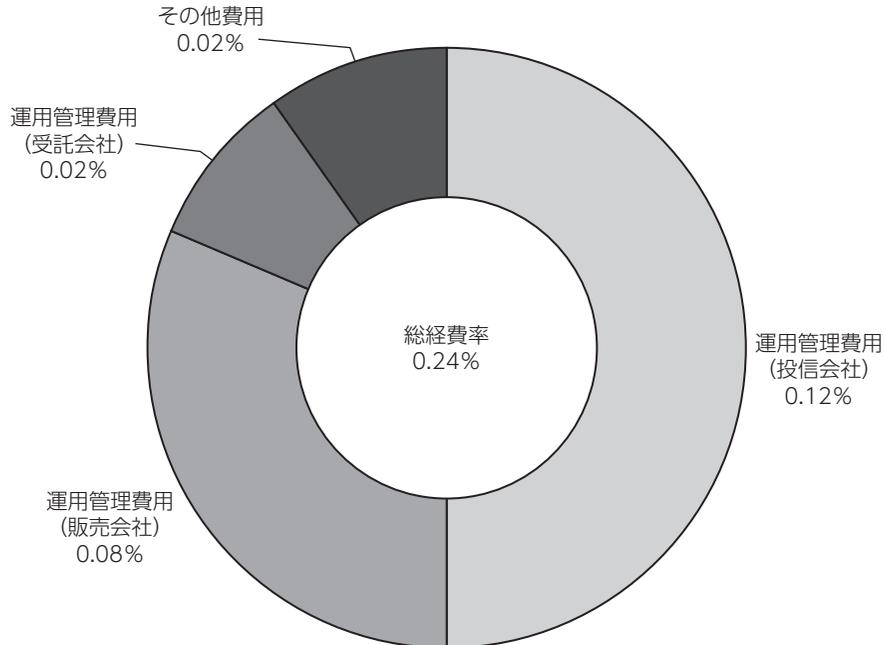
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.24%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

DCダイワS & P 500インデックス

■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

(2022年4月7日から2022年9月7日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
S & P 500インデックス・マザーファンド	121,858	274,005	0	0

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年4月7日から2022年9月7日まで)

項 目	当 期
	S & P 500インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	7,163,998千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,882,032千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	当初設定時における取得
1	-	-	1	

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千□	千円
S & P 500インデックス・マザーファンド	121,857	270,536

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
S & P 500インデックス・マザーファンド	270,536	100.0
コール・ローン等、その他	80	0.0
投資信託財産総額	270,616	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝143.12円です。

(注3) S & P 500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（68,098,435千円）の投資信託財産総額（69,786,026千円）に対する比率は、97.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	270,616,932円
コール・ローン等	80,275
S & P 500インデックス・マザーファンド(評価額)	270,536,657
(B) 負債	28,160
未払信託報酬	27,384
その他未払費用	776
(C) 純資産総額(A - B)	270,588,772
元本	269,819,398
次期繰越損益金	769,374
(D) 受益権総口数	269,819,398口
1万口当り基準価額(C / D)	10,029円

* 期首における元本額は1,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は270,874,145円、同解約元本額は2,054,747円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,029円です。

■損益の状況

当期 自2022年4月7日 至2022年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 8円
支払利息	△ 8
(B) 有価証券売買損益	△3,423,106
売買益	44,411
売買損	△3,467,517
(C) 信託報酬等	△ 28,160
(D) 当期損益金(A + B + C)	△3,451,274
(E) 追加信託差損益金	4,220,648
(売買損益相当額)	(4,220,648)
(F) 合計(D + E)	769,374
次期繰越損益金(F)	769,374
追加信託差損益金	4,220,648
(売買損益相当額)	(4,220,648)
繰越損益金	△3,451,274

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	769,382
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	769,382
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	769,382
(h) 受益権総口数	269,819,398□

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

運用報告書 第5期 (決算日 2022年9月7日)

(作成対象期間 2021年9月8日～2022年9月7日)

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

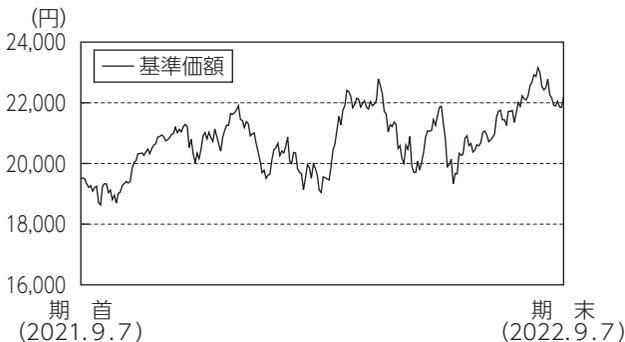
運用方針	投資成果をS&P500指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	イ. 米国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みません。） ロ. 米国の企業のDR（預託証券） ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P 500 指数 (円ベース) (※配当なし)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受託証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%	(ベンチマーク)	%				
開市	19,500	-	18,348	-	80.9	2.5	14.5	2.1
9月末	19,121	△ 1.9	17,980	△ 2.0	90.6	2.6	4.9	2.3
10月末	20,490	5.1	19,253	4.9	86.7	2.3	8.8	2.3
11月末	20,796	6.6	19,517	6.4	82.0	3.2	13.2	2.1
12月末	21,670	11.1	20,316	10.7	91.3	3.0	3.2	2.5
2022年1月末	20,128	3.2	18,853	2.8	86.9	2.8	8.0	2.3
2月末	19,957	2.3	18,670	1.8	81.6	3.0	13.7	2.2
3月末	22,215	13.9	20,758	13.1	91.8	3.1	2.8	2.5
4月末	21,278	9.1	19,868	8.3	88.1	3.3	6.3	2.6
5月末	21,074	8.1	19,646	7.1	83.3	3.1	11.3	2.3
6月末	20,657	5.9	19,234	4.8	91.9	3.0	2.6	2.7
7月末	21,716	11.4	20,201	10.1	88.7	2.9	5.8	2.6
8月末	21,922	12.4	20,364	11.0	85.8	2.8	9.1	2.4
期末	22,201	13.9	20,612	12.3	85.0	2.7	10.1	2.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S&P500指数(円ベース)は、S&P500指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：19,500円 期末：22,201円 騰落率：13.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークに連動させることをめざした運用を行った結果、米国株式が下落した一方で、米ドルが対円で見直ししたことからベンチマークが上昇し、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○米国株式市況

米国株式市況は下落しました。

米国株式市況は、当作成期首より2021年9月末にかけて、米国の量的金融緩和の早期縮小観測や連邦政府の債務上限問題などから、

軟調に推移しました。10月に入ると、債務上限問題の一時棚上げや良好な企業決算の発表を受けて上昇しました。その後も、物価の上昇加速による早期利上げ観測や、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感などで下落する局面があったものの、多くの良好な経済指標の発表が支えとなり、年末にかけて高値圏で推移しました。2022年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学リスクが顕在化したことを受け、株価は3月半ばにかけて下落しましたが、F R Bの利上げ決定後は一時的に反発しました。4月から6月にかけては、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R Bが利上げを加速するとの思惑が強まり、景気の先行き懸念が台頭したことで、株価は下落しました。その後は、資源価格の上昇一服でインフレ懸念が後退し、将来的な利下げ転換期待なども生じたことで8月半ばにかけて上昇しましたが、F R B高官の金融引き締めに関する積極的な発言を受け、当作成期末にかけて株価は反落しました。

○為替相場

為替相場は、円安米ドル高となりました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首よりおおむねレンジ内で推移しましたが、2021年9月下旬には、米国において利上げ観測が高まり、円安に推移しました。10月から2022年3月上旬にかけてはおおむねレンジ内で推移しましたが、3月中旬から当作成期末にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見直しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違がより明確となり、円安が大きく進行しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

主として、米国の株式(D R (預託証券)を含む。)に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からS&P500指数との連動をめざすE T F (上場投資信託証券)や先物にも投資します。なお、E T Fおよび先物の組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の50%程度以下に維持することを基本とします。

◆ポートフォリオについて

株式組入比率(D R (預託証券)、E T F (上場投資信託証券)、株価指数先物、リートを含む。)は、当作成期を通じて原則として100%前後で運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、S&P500指数採用銘柄に投資し、S&P500指数に連動するE T Fも組み入れることによりS&P500指数との連動性を維持するように運用を行いました。また、効率性の観点からS&P500指数に連動する株価指数先物も利用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は12.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.9%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト負担、組み入れている株式ポートフォリオ(D R (預託証券)、E T F (上場投資信託証券)、株価指数先物、リートを含む。)とベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

*ベンチマークはS&P500指数(円ベース)(※配当なし)です。

《今後の運用方針》

主として、米国の株式(D R (預託証券)を含む。)に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からS&P500指数との連動をめざすE T F (上場投資信託証券)や先物にも投資します。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	2円
(株式)	(1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託受益証券)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	2
(保管費用)	(2)
(その他)	(0)
合計	4

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外国	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	17,579.72 (2,913.67)	214,618 (△ 286)	212.34	615

(注1) 金額は受渡し代金。

(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おりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,139.853 ()	493,006 ()	1,114.119 ()	480,984 ()

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、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。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	73.54 (0.431)	6,699 ()	0.431 ()	7 ()

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、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。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	6,441	5,556	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	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)		92.498	1,730,105	18,704	KANSAS CITY SOUTHERN (アメリカ)		0.713	24,076	33,767
MICROSOFT CORP (アメリカ)		45.672	1,620,461	35,480	WESTERN UNION CO (アメリカ)		3.183	6,359	1,997
AMAZON.COM INC (アメリカ)		17.495	999,232	57,115	HANESBRANDS INC (アメリカ)		2.735	5,127	1,874
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		1.85	585,831	316,665	IPG PHOTONICS CORP (アメリカ)		0.397	4,804	12,102
TESLA INC (アメリカ)		5.623	555,842	98,851	PERRIGO CO PLC (アイルランド)		0.912	4,483	4,916
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		1.637	521,738	318,716	NOV INC (アメリカ)		2.659	3,981	1,497
NVIDIA CORP (アメリカ)		15.477	430,467	27,813	LEGGETT & PLATT INC (アメリカ)		0.904	3,953	4,373
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)		13.417	414,783	30,914	UNUM GROUP (アメリカ)		1.391	3,776	2,715
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)		10.548	387,196	36,708	KYNDRYL HOLDINGS INC (アメリカ)		1.404	3,633	2,588
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		16.169	337,929	20,899	GAP INC/THE (アメリカ)		1.686	3,442	2,041

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年9月7日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口 <td>千円 <td>円 <td></td> <td></td> <td>千口 <td>千円 <td>円 </td></td></td></td></td>	千円 <td>円 <td></td> <td></td> <td>千口 <td>千円 <td>円 </td></td></td></td>	円 <td></td> <td></td> <td>千口 <td>千円 <td>円 </td></td></td>			千口 <td>千円 <td>円 </td></td>	千円 <td>円 </td>	円
ISHARES CORE S&P 500 ETF (アメリカ)		832.338	44,248,596	53,161	ISHARES CORE S&P 500 ETF (アメリカ)		806.604	42,920,955	53,211
SPDR S&P 500 ETF TRUST (アメリカ)		307.515	16,797,842	54,624	SPDR S&P 500 ETF TRUST (アメリカ)		307.515	16,327,989	53,096

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS		7.84	15.12	253	36,326	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC		12.43	23.47	383	54,930	情報技術
SYNCHRONY FINANCIAL		36.49	64.68	200	28,696	金融
ABBOTT LABORATORIES		119.91	225.84	2,319	331,981	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC		26.38	48.51	168	24,112	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC		10.94	20.37	380	54,426	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP		22.17	44.35	157	22,501	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A		40.32	77.02	560	80,270	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC		2.9	5.66	237	33,932	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		41.84	78.78	704	100,798	情報技術
QORVO INC		7.6	13.99	124	17,779	情報技術
AFLAC INC		42.62	76.44	455	65,126	金融
DARDEN RESTAURANTS INC		8.83	16.09	198	28,372	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC		9.75	17.66	157	22,477	コミュニケーション・サービス

銘柄	柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ADOBE INC		32.25	60.94	2,244	321,221	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		14.47	26.91	276	39,638	素材
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		24.42	-	-	-	金融
GARMIN LTD		10.11	19.68	172	24,726	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		14.93	28.6	704	100,763	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		46.87	87.8	1,629	233,223	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP		9.46	27.02	177	25,406	金融
AUTOZONE INC		1.46	2.56	545	78,071	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC		15.64	29.04	401	57,484	一般消費財・サービス
PINNACLE WEST CAPITAL		7.61	14.58	108	15,552	公益事業
CELANESE CORP		7.59	13.97	148	21,259	素材
DR HORTON INC		22.13	41.32	289	41,390	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC		14.73	27.79	86	12,353	ヘルスケア
AUTODESK INC		14.85	28.06	556	79,588	情報技術
MOODY'S CORP		10.86	20.7	595	85,292	金融

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
DEVON ENERGY CORP	40.17	79.17	550	78,794	エネルギー
ALBEMARLE CORP	7.88	15.11	402	57,675	素材
ATMOS ENERGY CORP	8.86	17.93	204	29,307	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	16.94	32.35	197	28,316	公益事業
CITIGROUP INC	139.42	250.47	1,207	172,855	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	28.71	53.88	1,283	183,637	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	33.73	66.24	672	96,281	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	2.63	4.65	168	24,142	一般消費・サービス
HESS CORP	18.53	35.73	426	61,077	エネルギー
DAVITA INC	4.74	7.81	68	9,865	ヘルスケア
DANAHER CORP	42.84	83.46	2,274	325,471	ヘルスケア
FORTIVE CORP	22.84	46.23	291	41,729	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	37.98	72.01	719	102,967	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12.16	-	-	-	一般消費・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	11.48	-	-	-	一般消費・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	37.7	72.58	622	89,022	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	22.28	41.55	511	73,203	情報技術
APPLE INC	1,058.24	1,983.22	30,646	4,386,155	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20.57	36.24	353	50,564	金融
BOEING CO/THE	37.1	71.73	1,093	156,443	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10.11	19.24	187	26,770	金融
BECTON DICKINSON AND CO	19.62	36.77	926	132,652	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	9	17.63	165	23,617	資本財・サービス
NISOURCE INC	26.46	52.34	154	22,113	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8.97	16.42	185	26,531	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	54.44	95.86	394	56,441	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	279.37	541.68	2,226	318,628	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	127.87	233.35	6,454	923,729	金融
ANSYS INC	5.88	11.22	270	38,741	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	90.74	171.73	790	113,107	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	150.73	274.61	1,885	269,809	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	204.19	378.83	4,308	616,677	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	15.3	29.32	347	49,793	金融
LKQ CORP	18.75	33.56	172	24,625	一般消費・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12.37	23.58	167	23,970	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	18.77	35.57	596	85,433	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7.82	14.18	380	54,488	金融
DOLLAR GENERAL CORP	15.91	29.51	707	101,283	一般消費・サービス
SERVICENOW INC	13.33	25.86	1,113	159,320	情報技術
CATERPILLAR INC	36.97	68.8	1,242	177,889	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	-	30.22	191	27,403	金融
CHARLES RIVER LABORATORIES	3.39	6.55	131	18,763	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	19.53	37.42	252	36,080	公益事業
MOSAIC CO/THE	23.46	46.69	252	36,090	素材
DELTA AIR LINES INC	43.17	82.69	257	36,912	資本財・サービス
CORNING INC	52.3	98.05	321	46,013	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	284.34	535.81	2,382	341,018	情報技術
MORGAN STANLEY	100.39	180.5	1,536	219,917	金融
MSCI INC	5.56	10.46	478	68,516	金融
BROADCOM INC	27.56	52.66	2,623	375,478	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
DTE ENERGY COMPANY	13.07	24.99	327	46,924	公益事業
CENTENE CORP	39.32	75.44	666	95,369	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7.2	13.7	166	23,821	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28.74	63.26	225	32,331	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13.86	27.1	490	70,163	金融
GARTNER INC	5.8	10.39	301	43,185	情報技術
DOMINION ENERGY INC	54.43	104.64	852	122,055	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	24.97	48.51	429	61,505	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	9.07	16.77	93	13,414	資本財・サービス
DEERE & CO	21.04	36.01	1,300	186,081	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	9.4	18.54	260	37,217	資本財・サービス
POOL CORP	2.72	5.17	173	24,822	一般消費・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	19.92	36.31	458	65,649	情報技術
NASDAQ INC	7.78	44.61	270	38,703	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	23.13	45.7	446	63,934	公益事業
TELEFLEX INC	3.15	6.05	134	19,196	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5.63	10.81	180	25,869	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4.98	9.55	277	39,773	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	1.45	2.79	133	19,083	ヘルスケア
CATALENT INC	11.5	23.12	205	29,439	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	-	7.57	256	36,694	ヘルスケア
IDEX CORP	5.12	9.8	196	28,181	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	57.08	108.08	840	120,297	生活必需品
ROLLINS INC	12.74	29.22	104	14,963	資本財・サービス
AMETEK INC	15.58	29.78	355	50,936	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	16.55	31.31	251	35,951	生活必需品
GENERAC HOLDINGS INC	4.25	8.23	185	26,562	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	-	4.89	213	30,541	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17.37	33.38	268	38,491	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	2.75	5.35	194	27,839	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	29.83	57.17	2,966	424,572	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	-	7.37	302	43,334	情報技術
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1.9	3.61	590	84,452	一般消費・サービス
CUMMINS INC	9.86	18.2	386	55,336	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	52.44	100.85	774	110,908	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	9.46	17.43	295	42,250	情報技術
SIGNATURE BANK	-	8.12	136	19,566	金融
SVB FINANCIAL GROUP	3.67	7.59	291	41,674	金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6.41	11.84	322	46,091	資本財・サービス
HANESBRANDS INC	20.26	-	-	-	一般消費・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5.01	9.4	182	26,154	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	18.8	35.9	455	65,185	一般消費・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.06	-	-	-	情報技術
DEXCOM INC	6.53	50.63	415	59,440	ヘルスケア
NORDSON CORP	-	6.95	156	22,435	資本財・サービス
COPART INC	14.05	27.57	321	45,953	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	12.26	21.52	288	41,274	エネルギー
ALIGN TECHNOLOGY INC	4.86	9.45	225	32,323	ヘルスケア
TRANSDEGM GROUP INC	3.7	6.69	402	57,581	資本財・サービス
BIO-TECHNE INC	2.62	5.06	166	23,828	ヘルスケア

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NIELSEN HOLDINGS PLC	24.19	46.39	129	18,497	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	131.42	251.52	446	63,967	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	17.73	29.35	589	84,309	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2.56	4.87	118	16,907	金融
COTERRA ENERGY INC	23.01	103.93	303	43,373	エネルギー
T-MOBILE US INC	39.55	75.99	1,078	154,336	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	261.86	503.23	3,078	440,632	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	11.44	21.64	217	31,153	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	18.53	36.11	93	13,390	金融
CSX CORP	153.27	280.44	883	126,390	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6.59	11.96	270	38,701	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	9.55	19.55	197	28,217	一般消費・サービス
AMAZON.COM INC	28.91	1,128.59	14,232	2,036,976	一般消費・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	41.94	80.19	714	102,212	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	285.68	543.34	5,159	738,357	エネルギー
AES CORP	44.95	86.14	224	32,115	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	2.71	5.09	139	19,989	金融
EOG RESOURCES INC	39.38	75.55	908	130,087	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	11	20.68	183	26,237	情報技術
ABIOMED INC	3.06	5.88	155	22,207	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	9.98	19.45	284	40,647	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	20.47	38.71	500	71,634	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	264.61	509.34	765	109,563	一般消費・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC. SERIES	9.35	-	-	-	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC.-C	20.3	-	-	-	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	9.15	85.95	426	61,075	情報技術
NEXTERA ENERGY INC	132.36	253.39	2,213	316,848	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	98.91	186.93	525	75,230	素材
US BANCORP	91.44	174.39	790	113,112	金融
UNITED RENTALS INC	4.88	9.24	269	38,625	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	4.03	7.8	120	17,304	情報技術
FASTENAL CO	38.76	74.24	373	53,444	資本財・サービス
FISERV INC	40.25	75.04	781	111,864	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	74.05	141.97	1,024	146,620	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	24.98	54.06	72	10,305	一般消費・サービス
GENERAL MOTORS CO	86.17	188.06	727	104,188	一般消費・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	15.44	29.73	667	95,545	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22.95	44.3	1,446	207,001	金融
ALPHABET INC-CL A	20.29	775.8	8,286	1,185,938	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	19.2	711.4	7,646	1,094,313	コミュニケーション・サービス
GENERAL MILLS INC	41.15	77.67	584	83,704	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	36.71	73.64	292	41,862	公益事業
GENUINE PARTS CO	9.75	18.26	287	41,131	一般消費・サービス
IHS MARKIT LTD	25.28	-	-	-	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	47.48	88.49	294	42,135	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13.83	24.88	571	81,817	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	43.28	83.78	110	15,851	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	60.05	116.34	343	49,152	エネルギー

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HOME DEPOT INC	71.71	133.29	3,859	552,339	一般消費・サービス
ASSURANT INC	4.09	6.98	110	15,849	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	100.93	185.63	244	34,989	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2.33	5.17	118	16,950	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	9.88	18.83	419	60,030	生活必需品
HUMANA INC	8.71	16.32	782	112,004	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	18.6	33.87	544	77,923	情報技術
HENRY SCHEIN INC	9.5	17.81	126	18,092	ヘルスケア
HP INC	80.92	135.87	371	53,145	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	88.15	167.69	220	31,559	情報技術
KRAFT HEINZ CO/THE	43.74	91.56	342	49,048	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	9.18	17.42	510	73,004	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60.29	116.01	1,470	210,397	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	26.43	47.8	192	27,590	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	9.37	16.87	100	14,447	資本財・サービス
ZOETIS INC	32.04	60.7	952	136,252	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	16.14	30.16	472	67,561	資本財・サービス
ALLEGION PLC	6.07	11.33	107	15,346	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	9.04	-	-	-	一般消費・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	22.11	41.67	115	16,555	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	7.39	13.99	193	27,757	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	177.71	339.4	5,538	792,645	ヘルスケア
ABBVIE INC	119.18	227.93	3,136	448,837	ヘルスケア
HOLOGIC INC	17.29	32.17	217	31,082	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	22.77	43.46	546	78,191	生活必需品
KROGER CO	51.08	84.62	410	58,761	生活必需品
KLA CORP	10.34	19.25	636	91,076	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	16.5	30.55	1,276	182,666	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5.62	9.98	208	29,857	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	15.86	28.66	106	15,303	一般消費・サービス
LOWE'S COS INC	47.63	85.27	1,645	235,485	一般消費・サービス
ELI LILLY & CO	53.71	101.72	3,120	446,673	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	9.62	17.89	763	109,268	情報技術
LOEWYS CORP	15.09	25.08	138	19,860	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	12.14	20.85	95	13,738	金融
MCDONALD'S CORP	50.35	95.39	2,426	347,298	一般消費・サービス
3M CO	39.12	73.4	855	122,488	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	161.65	295.82	4,689	671,222	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	16.26	44.77	1,597	228,612	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4.21	8.04	273	39,072	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	-	7.14	198	28,447	情報技術
PHILLIPS 66	29.55	62.05	538	77,048	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	27.55	45.61	149	21,391	一般消費・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	17.18	31.53	83	11,913	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTD SHRS	16.8	32.27	265	37,963	生活必需品
METLIFE INC	50.19	89.16	579	83,007	金融
ARISTA NETWORKS INC	3.72	29.03	341	48,839	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11.45	21.58	525	75,227	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1.57	2.93	358	51,273	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	49.08	120.64	300	42,975	エネルギー

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7.83	15	357	51,149	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	170.87	326.17	2,818	403,421	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	35.89	65.59	355	50,925	素材
MASCO CORP	17.11	30.43	149	21,453	資本財・サービス
M & T BANK CORP	8.68	23.14	414	59,287	金融
MARSH & MCLENNAN COS	34.32	64.74	1,046	149,704	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	18.02	35.46	540	77,328	一般消費・サービス
NETAPP INC	15.02	28.7	202	29,040	情報技術
NIKE INC -CL B	86.04	163.65	1,720	246,277	一般消費・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	16.88	30.74	737	105,548	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18.47	71.71	457	65,427	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8.25	25.07	259	37,100	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	10.08	18.85	904	129,424	資本財・サービス
PENN ENTERTAINMENT INC	10.01	18.48	57	8,162	一般消費・サービス
APTIV PLC	18.25	34.95	310	44,473	一般消費・サービス
NEWMONT CORP	54.06	102.37	426	61,110	素材
MCKESSON CORP	10.67	18.75	676	96,820	ヘルスケア
XYLEM INC	12.15	23.23	214	30,753	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105.17	199.94	1,881	269,271	生活必需品
NUCOR CORP	20.2	34.32	461	66,040	素材
WESTERN UNION CO	27.6	-	-	-	情報技術
NEWELL BRANDS INC	25.51	47.47	81	11,603	一般消費・サービス
EVERGY INC	15.47	29.6	201	28,815	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56.68	114.84	768	109,923	エネルギー
LINDE PLC	35.1	64.91	1,797	257,275	素材
PAYCHEX INC	21.64	41.44	503	72,125	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4.71	8.48	599	85,869	一般消費・サービス
ALTRIA GROUP INC	124.85	233.53	1,040	148,965	生活必需品
PFIZER INC	377.78	723.71	3,311	473,970	ヘルスケア
CIGNA CORP	23.13	40.92	1,167	167,055	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	36.32	70.25	522	74,843	公益事業
STERIS PLC	6.62	12.91	254	36,471	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	10.33	16.21	49	7,087	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	22.03	40.2	132	18,969	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	22.12	43.41	880	125,952	ヘルスケア
DOW INC	50.41	93.91	456	65,306	素材
PARKER HANNIFIN CORP	8.71	16.56	441	63,169	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15.71	29.02	693	99,260	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	165.16	309.47	4,197	600,723	生活必需品
EXELON CORP	65.94	126.43	554	79,417	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	25.2	52.36	249	35,722	資本財・サービス
NVR INC	0.23	0.4	161	23,128	一般消費・サービス
CONOCOPHILLIPS	91.04	166.83	1,812	259,372	エネルギー
PAYCOM SOFTWARE INC	3.31	6.21	214	30,744	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	-	17.72	105	15,140	情報技術
PEPSICO INC	93.24	178.34	3,023	432,657	生活必需品
CORTEVA INC	49.72	93.34	563	80,580	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26.58	48.37	455	65,198	金融
AMCOR PLC	103.99	193.83	229	32,873	素材
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12.25	23.44	347	49,790	公益事業

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ACCENTURE PLC-CL A	42.9	81.7	2,315	331,447	情報技術
PENTAIR PLC	11.21	21.33	93	13,392	資本財・サービス
QUALCOMM INC	76.09	144.46	1,829	261,891	情報技術
INVESCO LTD	25.53	43.43	71	10,212	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	4.42	7.88	136	19,549	一般消費・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17.06	30.31	225	32,287	金融
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.06	13.93	799	114,430	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	14.21	26.89	387	55,437	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	2.77	5.24	950	136,104	一般消費・サービス
ROSS STORES INC	24.07	45.32	393	56,248	一般消費・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	6.41	12.09	164	23,563	素材
RESMED INC	9.82	18.87	416	59,593	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	8.81	15.14	189	27,165	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	7.61	14.25	109	15,724	資本財・サービス
MODERNA INC	20.6	44.63	580	83,087	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	3.28	5.97	53	7,647	一般消費・サービス
PERKINELMER INC	7.56	16.27	215	30,783	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	55.12	109.41	440	63,104	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	27.21	54.53	393	56,253	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	64.85	120.53	253	36,242	金融
MATCH GROUP INC	-	36.84	198	28,382	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	130.44	253.43	3,981	569,888	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	25.61	49.17	323	46,354	公益事業
ETSY INC	8.58	16.4	170	24,377	一般消費・サービス
TESLA INC	52.01	324.72	8,910	1,275,337	一般消費・サービス
NORTONLIFELOCK INC	39.18	75.05	165	23,748	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	10.9	19.47	166	23,769	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	10.29	19.75	645	92,382	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9.28	14.94	593	84,887	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	81.57	156.37	147	21,059	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A	22.65	42.16	324	46,431	不動産
TWITTER INC	53.86	98.39	380	54,425	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	71.44	137.05	1,065	152,562	公益事業
SYSCO CORP	34.52	65.71	528	75,639	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	16.97	30.95	501	71,705	金融
SCHLUMBERGER LTD	94.36	182.31	681	97,480	エネルギー
AT&T INC	481.82	923.38	1,550	221,886	コミュニケーション・サービス
APA CORP	21.87	43.63	165	23,616	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	39.91	76.48	280	40,214	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	-	56.04	370	52,975	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	14.07	27.65	120	17,253	一般消費・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16.14	30.87	705	100,900	素材
SEMPRA ENERGY	21.3	40.54	680	97,376	公益事業
ORGANON & CO	17.07	32.71	93	13,440	ヘルスケア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13.43	25.49	166	23,840	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	62.33	118.94	1,939	277,640	情報技術
SALESFORCE.COM INC	62.51	128.15	1,944	278,267	情報技術
WESTROCK CO	18.06	32.87	129	18,568	素材

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	48.34	89.73	493	70,619	資本財・サービス
TERADYNE INC	11.22	20.66	171	24,518	情報技術
UNION PACIFIC CORP	44.81	81	1,846	264,290	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	53.18	91.28	232	33,339	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	44.05	69.78	687	98,331	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	102.22	191.82	1,671	239,282	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	48.82	94.73	1,856	265,677	資本財・サービス
UNUM GROUP	13.91	-	-	-	金融
IQVIA HOLDINGS INC	12.93	24.41	511	73,245	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	17.25	33.31	307	43,964	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	63.68	121.01	6,264	896,567	ヘルスケア
VERISIGN INC	6.69	12.29	224	32,063	情報技術
VALERO ENERGY CORP	27.58	52.64	593	84,966	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	3.7	6.74	288	41,268	一般消費・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5.28	8.13	78	11,196	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	16.52	31.1	1,483	212,314	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	122.61	234.94	2,586	370,173	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	278.93	488.89	2,096	300,031	金融
WASTE MANAGEMENT INC	26.2	49.27	833	119,283	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	81.97	157.1	521	74,579	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7.78	14.43	271	38,834	一般消費・サービス
WHIRLPOOL CORP	4.24	7.25	109	15,668	一般消費・サービス
WALMART INC	92.61	181.08	2,396	342,974	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14.07	27.03	283	40,592	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	7.1	13.61	79	11,336	一般消費・サービス
WABTEC CORP	12.01	23.56	205	29,443	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	81.39	151.48	952	136,344	一般消費・サービス
WATERS CORP	4.16	7.77	231	33,126	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	21.85	42.14	154	22,061	資本財・サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3.61	6.77	196	28,091	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	48.41	92.47	326	46,743	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8.7	14.38	294	42,173	金融
WESTERN DIGITAL CORP	20.68	40.39	165	23,683	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	21.28	40.69	419	60,017	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	34.08	64.4	409	58,555	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	114.15	212.27	4,216	603,469	情報技術
PPL CORP	51.92	94.92	273	39,151	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	-	42.14	346	49,611	公益事業
PULTEGROUP INC	17.93	30.65	122	17,463	一般消費・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	-	284.85	359	51,489	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	16	30.46	376	53,921	素材
NORTHERN TRUST CORP	14.05	26.88	252	36,131	金融
NVIDIA CORP	168.2	322.97	4,348	622,398	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	28.67	53.34	834	119,373	金融
TYSON FOODS INC-CL A	19.89	37.6	274	39,315	生活必需品
NETFLIX INC	29.92	57.3	1,251	179,096	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26.52	50.49	2,752	393,932	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	16.51	30.61	124	17,869	公益事業
GLOBE LIFE INC	6.39	11.7	114	16,323	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11.88	23.15	342	49,088	金融
TEXTRON INC	15.28	27.74	171	24,587	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS B	5.11	13.47	22	3,236	コミュニケーション・サービス
NEWS CORP - CLASS A	26.39	50.11	82	11,797	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	14.55	26.54	175	25,050	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	-	16.59	198	28,470	資本財・サービス
ORACLE CORP	122.47	203.05	1,499	214,553	情報技術
MASTERCARD INC - A	59.02	110.77	3,589	513,777	情報技術
ONEOK INC	30.07	57.61	343	49,108	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	67.13	119.92	115	16,596	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	7.1	13.66	542	77,598	情報技術
YUM! BRANDS INC	20.1	36.78	413	59,251	一般消費・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7.81	20.39	243	34,881	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12.71	24.29	125	17,955	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	508.69	914.49	3,023	432,695	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3.15	6.04	221	31,700	情報技術
AMERICAN EXPRESS CO	43.9	78.68	1,169	167,333	金融
ANALOG DEVICES INC	36.29	67.5	1,000	143,199	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	82	209.02	1,645	235,490	情報技術
ALASKA AIR GROUP INC	7.21	16.26	71	10,216	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	57.89	102.18	535	76,571	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11.14	20.76	202	29,013	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14.77	28.94	121	17,325	一般消費・サービス
AVERY DENNISON CORP	5.6	10.54	193	27,685	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	35.58	67.22	418	59,858	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	40.47	76.62	624	89,382	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	15.23	27.39	770	110,243	金融
AMGEN INC	38.76	68.9	1,668	238,852	ヘルスケア
TAPESTRY INC	18.82	32.48	108	15,586	一般消費・サービス
EATON CORP PLC	26.89	51.46	712	101,975	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11.4	20.99	514	73,567	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	61.92	113.94	1,028	147,236	情報技術
CME GROUP INC	24.23	46.36	918	131,393	金融
NOV INC	26.59	-	-	-	エネルギー
ECOLAB INC	16.79	32.05	522	74,781	素材
EQUIFAX INC	8.21	15.78	295	42,318	資本財・サービス
GAP INC/THE	12.01	-	-	-	一般消費・サービス
GILEAD SCIENCES INC	84.62	161.78	1,025	146,772	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	-	95.14	357	51,156	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	19.08	36.55	170	24,350	生活必需品
STATE STREET CORP	23.46	47.35	322	46,122	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	101.22	194.53	1,370	196,196	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	33.93	64.95	355	50,809	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13.75	26.07	127	18,211	生活必需品
CARDINAL HEALTH INC	19.57	35.14	244	34,958	ヘルスケア
FEDEX CORP	16.47	30.75	627	89,853	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30.44	50.7	518	74,136	金融
FMC CORP	8.73	16.24	170	24,411	素材

S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CERNER CORP	20.32	-	-	-	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16.8	32.87	360	51,620	素材
CITRIX SYSTEMS INC	8.38	16.09	165	23,665	情報技術
INTEL CORP	272.41	527.41	1,601	229,166	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26.55	50.78	137	19,622	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	24.11	42.42	275	39,462	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	19.39	36.56	722	103,367	資本財・サービス
ILLUMINA INC	9.85	20.26	407	58,287	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	9.03	18.84	98	14,145	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	7.99	46.3	936	134,053	ヘルスケア
SNAP-ON INC	3.65	6.88	149	21,378	資本財・サービス
CARMAX INC	11.01	20.71	176	25,232	一般消費・サービス
COMERICA INC	9.42	16.87	134	19,313	金融
DUKE ENERGY CORP	51.9	99.3	1,060	151,725	公益事業
TARGET CORP	33.36	59.64	975	139,626	一般消費・サービス
DOVER CORP	9.71	18.59	238	34,138	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	2.95	5.54	311	44,512	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8.79	-	-	-	資本財・サービス
CINTAS CORP	5.95	11.22	464	66,424	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	32.36	61.9	209	29,979	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	9.87	18.63	145	20,794	生活必需品
CLOROX COMPANY	8.39	15.88	226	32,434	生活必需品
ENERGY CORP	13.54	26.23	303	43,407	公益事業
MICROSOFT CORP	507.94	964.66	24,430	3,496,423	情報技術
INCYTE CORP	12.62	24.28	167	24,015	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	88.86	169.14	1,669	238,998	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	90.78	173.03	1,491	213,466	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	75.68	144.03	795	113,848	情報技術
BLACKROCK INC	9.57	18.37	1,215	173,950	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	39.25	81.19	257	36,835	公益事業
HASBRO INC	8.63	16.91	131	18,787	一般消費・サービス
KELLOGG CO	17	32.68	236	33,801	生活必需品
KEYCORP	65.51	120.27	208	29,812	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	6.16	-	-	-	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	94.77	178.5	1,071	153,281	生活必需品
COOPER COS INC/THE	3.32	6.36	188	26,959	ヘルスケア
CHUBB LTD	30.34	54.65	1,040	148,944	金融
ALLSTATE CORP	20.19	35.47	430	61,673	金融
EBAY INC	43.68	72.21	310	44,480	一般消費・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	79.28	149.37	1,368	195,853	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	9.21	16.62	149	21,331	素材
XILINX INC	16.59	-	-	-	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	16.77	32.34	53	7,711	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	9.54	19.52	106	15,270	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15.65	29.9	735	105,334	生活必需品
TRIMBLE INC	16.93	32.26	194	27,803	情報技術
LENNAR CORP-A	18.61	33.36	255	36,543	一般消費・サービス
PROGRESSIVE CORP	39.48	75.44	923	132,241	金融
PACCAR INC	23.43	44.84	389	55,723	資本財・サービス
PVH CORP	4.11	7.78	41	5,994	一般消費・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BIOGEN INC	10.15	18.89	367	52,635	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	5.75	10.84	370	53,016	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	79.51	147.93	1,250	178,943	一般消費・サービス
PTC INC	7.1	13.58	155	22,294	情報技術
PERRIGO CO PLC	9.12	-	-	-	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	23.18	44.48	396	56,752	公益事業
INTUIT INC	18.44	36.48	1,527	218,635	情報技術
BORGWARNER INC	16.27	30.9	112	16,115	一般消費・サービス
BEST BUY CO INC	15.02	26.12	186	26,683	一般消費・サービス
BALL CORP	22.15	41.25	229	32,789	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	95.89	184.39	744	106,562	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	19.31	36.27	452	64,746	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	8.95	17.14	281	40,331	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17.46	32.99	921	131,815	ヘルスケア
VF CORP	21.7	41.63	167	23,981	一般消費・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	40.98	78.47	179	25,718	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	3.95	6.1	64	9,267	一般消費・サービス
CARNIVAL CORP	53.86	104.68	98	14,142	一般消費・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	309.42	576.62	2,003	286,694	コミュニケーション・サービス
ファンド合計	株数、金額 総額<比率>	19,307.48 477銘柄	39,588.53 473銘柄	412,846 59,086,634 <85.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで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。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
ISHARES CORE S&P 500 ETF	99,248	124,982	49,081	7,024,570
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	99,248 1銘柄	124,982 1銘柄	49,081 7,024,570 <10.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで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。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.942	1.803	373	53,448
SIMON PROPERTY GROUP INC	2.217	4.235	427	61,241
BOSTON PROPERTIES INC	0.962	1.839	149	21,326
VORNADO REALTY TRUST	0.902	2.053	54	7,739
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.738	1.391	444	63,619
EQUITY RESIDENTIAL	2.322	4.414	330	47,329
EQUINIX INC	0.605	1.174	741	106,163
AMERICAN TOWER CORP	3.071	5.994	1,523	218,051
HOST HOTELS & RESORTS INC	4.764	9.219	156	22,430
KIMCO REALTY CORP	2.925	7.971	169	24,287
VICI PROPERTIES INC	-	12.421	412	58,966
VENTAS INC	2.532	5.155	247	35,457
WEYERHAEUSER CO	5.056	9.603	322	46,124
CROWN CASTLE INTL CORP	2.917	5.585	945	135,269
IRON MOUNTAIN INC	1.949	3.748	193	27,748
PROLOGIS INC	4.992	9.548	1,182	169,173
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.929	1.916	292	41,864
CAMDEN PROPERTY TRUST	-	1.374	178	25,581
DUKE REALTY CORP	2.531	4.959	290	41,561
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.439	0.843	227	32,549
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.478	0.922	95	13,616
WELLTOWER INC	2.817	5.855	446	63,920
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3.636	6.959	182	26,064
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.776	1.489	249	35,676
REALTY INCOME CORP	2.52	7.76	525	75,243
PUBLIC STORAGE	1.027	1.97	668	95,686
REGENCY CENTERS CORP	1.073	2.001	122	17,566
UDR INC	2.002	3.86	177	25,456
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.9	3.672	438	62,696
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.903	1.732	350	50,189
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	57,925 28銘柄	131,465 30銘柄	11,920 1,706,054 <2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで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。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	百万円 1,902	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年9月7日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 59,086,634	% 84.7
投資信託受益証券	7,024,570	10.1
投資信託証券	1,706,054	2.4
コール・ローン等、その他	1,968,768	2.8
投資信託財産総額	69,786,026	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=143.12円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(68,098,435千円)の投資信託財産総額(69,786,026千円)に対する比率は、97.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月7日現在

項目	当期末
(A) 資産	71,370,129,741円
コール・ローン等	1,431,234,101
株式(評価額)	59,086,634,203
投資信託受益証券(評価額)	7,024,570,216
投資信託証券(評価額)	1,706,054,286
未収入金	1,695,351,227
未収配当金	89,561,167
差入委託証拠金	336,724,541
(B) 負債	1,892,134,847
未払金	1,892,134,847
(C) 純資産総額(A-B)	69,477,994,894
元本	31,294,873,140
次期繰越損益金	38,183,121,754
(D) 受益権総口数	31,294,873,140口
1万口当り基準価額(C/D)	22,201円

* 期首における元本額は17,557,370,950円、当作成期間中における追加設定元本額は13,863,101,626円、同解約元本額は125,599,436円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

iFree S & P 5 0 0 インデックス 31,173,015,270円

DCダイワ S & P 500 インデックス 121,857,870円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,201円です。

■損益の状況

当期 自2021年9月8日 至2022年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	725,530,193円
受取配当金	724,419,408
受取利息	124,181
その他収益金	1,340,396
支払利息	△ 353,792
(B) 有価証券売買損益	6,390,924,526
売買益	17,996,790,936
売買損	△11,605,866,410
(C) 先物取引等損益	△ 273,060,151
取引益	138,121,176
取引損	△ 411,181,327
(D) その他費用	△ 4,807,639
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	6,838,586,929
(F) 前期繰越損益金	16,680,153,639
(G) 解約差損益金	△ 135,808,188
(H) 追加信託差損益金	14,800,189,374
(I) 合計(E + F + G + H)	38,183,121,754
次期繰越損益金(I)	38,183,121,754

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約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。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

S&P500指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、この使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。