

■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(2023年10月27日設定)
運用方針	楽天・S&P500インデックス・マザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として米国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、S&P500インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。 ※マザーファンドにおいては、ベンチマークとの連動性を維持するため、米国株式の指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)、米国株式の指数を対象とした株価指数先物取引を利用することがあります。 ※マザーファンドの投資信託財産の規模やマザーファンドへの資金流入の規模によっては、ETFや株価指数先物取引への投資割合が相対的に大きくなる場合があります。
主要投資対象	楽天・S&P500インデックス・ファンド マザーファンド
主な投資制限	マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および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。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的、もしくはベンチマークとの連動性を維持する目的以外には利用しません。 デリバティブ取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への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。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的、もしくはベンチマークとの連動性を維持する目的以外には利用しません。 デリバティブ取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 留保益の運用については特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

運用報告書(全体版)

楽天・S&P500インデックス・ファンド

<愛称：楽天・S&P500>

第1期

決算日：2024年7月16日

受益者の皆様へ

平素は当ファンドにご投資いただき、厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは、このたび上記決算を行いましたので、当期間の運用状況につきまして、ご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

楽天投信投資顧問株式会社

<https://www.rakuten-toushin.co.jp/>

東京都港区南青山二丁目6番21号

本資料(運用報告書(全体版))の記載内容のお問い合わせ先

TEL：03-6432-7746

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

※お客様のお取引内容等につきましては販売会社にお問い合わせください。

Rakuten 楽天投信投資顧問

■本資料の表記に関する注記

- ・金額等の数値は表記未満切捨または四捨五入により表示しております。このため、各項目の合計の値が合計欄と一致しないことがあります。
- ・－印は、組入・売買が無いことを示します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	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	期中騰落率	期中騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2023年10月27日	10,000	—	—	10,000	—	—	—	—	1
1期(2024年 7月16日)	14,305	0	43.1	14,290	42.9	86.4	3.6	10.4	249,917

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物組入比率」、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

(注4) 設定日の基準価額には当初設定価額を、純資産総額には当初設定元本を用いています。

ベンチマークは、S & P 500 インデックス(円換算ベース)です。

S & P 500 インデックスは、米国の金融商品取引所に上場している企業のうち、時価総額や流動性などを勘案して選ばれた500社の株式で構成される浮動株調整済時価総額加重平均型の株価指数です。

なお、「S & P 500 インデックス(円換算ベース)」は、委託会社が「S & P 500 インデックス」に日々の為替レートを乗じて算出したものです。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2023年10月27日	10,000	—	10,000	—	—	—	—
10月末	9,901	△1.0	9,902	△1.0	72.9	64.7	266.2
11月末	10,644	6.4	10,651	6.5	81.0	13.9	7.8
12月末	10,806	8.1	10,807	8.1	72.3	12.9	19.3
2024年 1月末	11,582	15.8	11,583	15.8	92.0	5.4	4.0
2月末	12,192	21.9	12,188	21.9	89.4	6.8	4.7
3月末	12,711	27.1	12,706	27.1	93.1	3.9	3.6
4月末	12,834	28.3	12,827	28.3	92.9	3.3	4.1
5月末	13,136	31.4	13,126	31.3	94.1	3.6	2.6
6月末	14,150	41.5	14,137	41.4	94.8	3.2	2.3
(期末)							
2024年 7月16日	14,305	43.1	14,290	42.9	86.4	3.6	10.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。

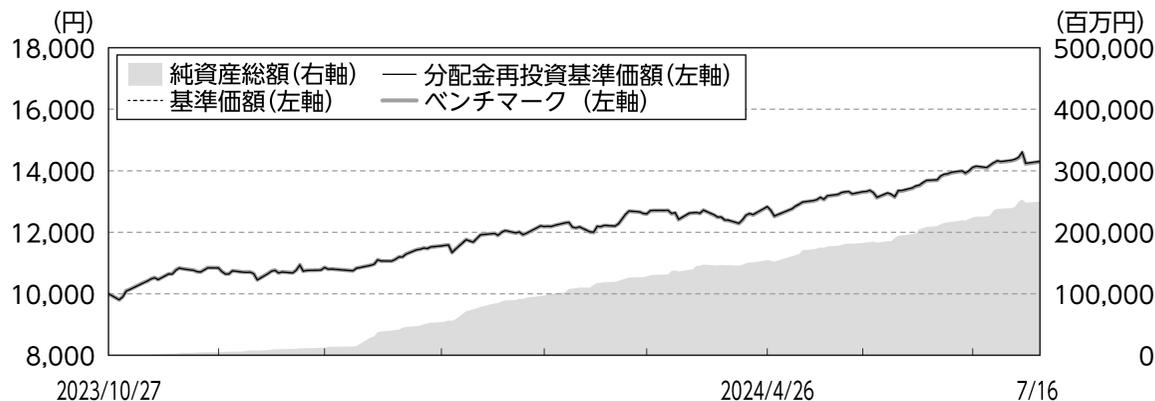
(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物組入比率」、「投資信託証券組入比率」は、実質組入比率を記載しています。

(注4) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：14,305円(既払分配金0円)

騰落率：43.1%(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込)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) ベンチマークは、S&P 500インデックス(円換算ベース)です。
- (注4) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、設定日の基準価額を起点として指数化しています。
- (注5) 設定日の基準価額には当初設定価額を、純資産総額には当初設定元本を用いています。

■ 基準価額の主な変動要因

当ファンドは「楽天・S&P 500インデックス・マザーファンド」受益証券(以下、「マザーファンド」)を通じて主として米国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、S&P 500インデックス(円換算ベース)(以下、「ベンチマーク」)に連動する投資成果を目標として運用を行っています。

当期の基準価額は大幅に上昇しました。米国株式市場が堅調に推移したほか、米ドルも対円で上昇し、基準価額を押し上げました。

■投資環境

当期の米国株式市場は、大きく上昇しました。期初より、FRB(米連邦準備制度理事会)に対する追加利上げ観測の後退や利下げ転換への期待が急速に広がり、金利低下圧力が強まるなかで、株式市場は上昇基調で推移しました。2024年に入ってから、金利が上昇基調に転じたものの、米国経済がソフトランディング(軟着陸)することへの期待などを背景に株式市場の騰勢は継続しました。4月には、物価や雇用関連指標の上振れにより早期利下げ観測が大きく後退したことなどから、株式市場は一時調整する局面があったもののすぐに反発し、AI(人工知能)関連の需要拡大見通しなどを背景に期末まで堅調な推移が継続しました。

当期の米ドル/円相場は、大幅に米ドル高/円安が進行しました。米金利の上昇が一服するなか、2023年末にかけては一時、1米ドル=141円割れの水準まで米ドル安/円高が進行したものの、年明け以降は、堅調な米雇用関連指標や燦るインフレ懸念、FRB高官による早期利下げけん制発言などを受けた米金利の上昇を受けて反転し、米ドル高/円安基調となりました。日本銀行が金融政策決定会合にてマイナス金利解除などの政策修正を決定したタイミングや、日本当局による為替介入があった際には、一時的にまとまって円高に振れる場面がありましたが、低い金利の円を借りて米ドル等の外貨に換え、期待リターンの高い資産に投資する円キャリー取引への需要が根強かったことなどから円安圧力は衰えず、2024年6月から7月にかけては1米ドル=160円を超える水準まで米ドル高/円安が進みました。

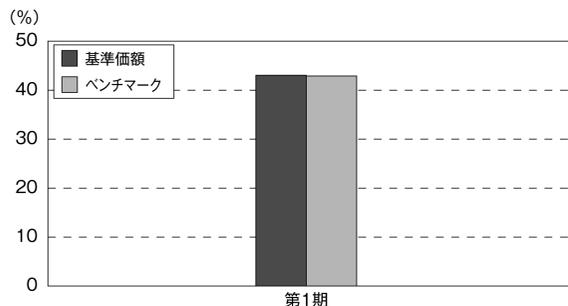
■当ファンドのポートフォリオ

追加設定・解約による資金フローを鑑みながら、マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

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

当期の基準価額の騰落率は+43.1%上昇し、ベンチマーク比では+0.1%となりました。主な差異要因としては、マザーファンドにおける継続的な資金流入に伴う現物株式やETF、株価指数先物取引の売買執行コストの積み重なり、保管費用等のコスト負担、ベンチマークと投資先ETFや株価指数先物取引とのパフォーマンスの差異、ベンチマークとマザーファンドで適用される配当課税の税率の差異、当ファンドにおける信託報酬等の要因が挙げられます。



■分配金

運用の基本方針等を勘案し、収益分配は見送らせていただきました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

●分配原資の内訳

(1万口当たり・税込)

項 目	第1期	
	2023年10月27日～2024年7月16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)		4,304

(注1) 「対基準価額比率」は「当期分配金」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 「当期の収益」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、「当期の収益以外」は収益調整金および分配準備積立金です。

(注3) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、円未満を切捨てて表示しているため、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

■今後の運用方針

引き続きマザーファンドの組入比率を高位に維持することで、ベンチマークに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	2023年10月27日～2024年7月16日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	7円	0.056%	(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11,995円です。
(a) 信託報酬	(2)	(0.020)	・委託した資金の運用の対価
(a) 信託報酬	(2)	(0.013)	・購入後の情報提供、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等の対価
(a) 信託報酬	(2)	(0.013)	・運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.010	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(b) 売買委託手数料	(1)	(0.009)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 売買委託手数料	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(c) 有価証券取引税	(0)	(0.000)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	1	0.007	(d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(d) その他費用	(1)	(0.005)	・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
(d) その他費用	(－)	(－)	・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
(d) その他費用	(0)	(0.000)	・印刷費用は、有価証券届出書、目論見書、運用報告書等の作成、印刷および提出等に係る費用
(d) その他費用	(0)	(0.002)	・その他は、金銭信託への預入金額に対する手数料、その他投資信託財産の運営にかかる費用等
合 計	9	0.073	

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

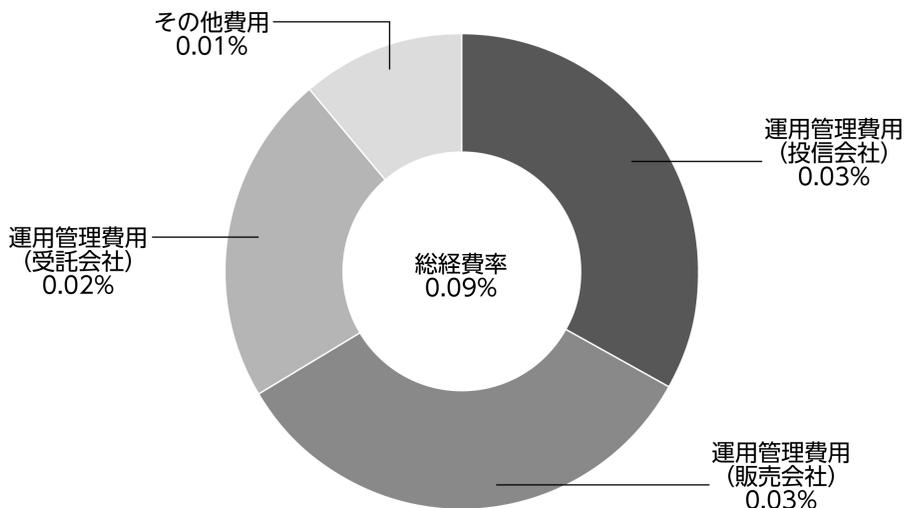
(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■（参考情報）総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.09%です。



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

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

■親投資信託受益証券の設定、解約状況

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
楽天・S&P500インデックス・マザーファンド	178,349,607	213,740,240	3,341	4,430

(注) 単位未満は切捨て。

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<楽天・S&P500インデックス・マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	188,029,863千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	89,637,747千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	2.09

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人[※]との取引状況等

該当事項はありません。

※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項に規定されている利害関係人です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当 元	初 設 定 本	当 元	期 解 約 本	当 元	期 末 残 高 本	取 引 の 理 由
	百万円		百万円		百万円	
	1		1		-	当初設定時における取得とその処分

(注) 単位未満は切捨て。

組入資産の明細

■親投資信託残高

	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
楽天・S&P500インデックス・マザーファンド	178,346,266	249,916,622

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の当期末現在の受益権口数は、178,347,265千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
楽天・S&P500インデックス・マザーファンド	249,916,622	99.9
短期金融資産、その他	307,227	0.1
投資信託財産総額	250,223,849	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 楽天・S&P500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資産(243,712,033千円)の投資信託財産総額(251,012,465千円)に対する比率は、97.1%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=158.45円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月16日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	250,223,849,783円
コール・ローン等	307,226,981
類・S&P500インデックス・マザーファンド(評価額)	249,916,622,718
未 収 利 息	84
(B) 負 債	306,564,895
未 払 解 約 金	271,114,804
未 払 信 託 報 酬	33,456,195
そ の 他 未 払 費 用	1,993,896
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	249,917,284,888
元 本	174,709,088,064
次 期 繰 越 損 益 金	75,208,196,824
(D) 受 益 権 総 口 数	174,709,088,064口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,305円

(注) 設定元本額

1,000,000円

期中追加設定元本額

186,768,897,832円

期中一部解約元本額

12,060,809,768円

■損益の状況

(自2023年10月27日 至2024年7月16日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△37,581円
受 取 利 息	7,112
支 払 利 息	△44,693
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	34,903,701,766
売 買 損 益	36,246,008,858
売 買 損 益	△1,342,307,092
(C) 信 託 報 酬 等	△58,996,812
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	34,844,667,373
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	40,363,529,451
(配 当 等 相 当 額)	(△248,884)
(売 買 損 益 相 当 額)	(40,363,778,335)
(F) 計 (D + E)	75,208,196,824
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	75,208,196,824
追 加 信 託 差 損 益 金	40,363,529,451
(配 当 等 相 当 額)	(163,891,175)
(売 買 損 益 相 当 額)	(40,199,638,276)
分 配 準 備 積 立 金	34,844,667,373

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価替えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

＜分配金の計算過程＞

項 目	当期
(A)配当等収益額（費用控除後）	845,873,719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）	33,998,793,654円
(C)収益調整金額	40,363,529,451円
(D)分配準備積立金額	－円
(E)分配対象収益額（A+B+C+D）	75,208,196,824円
(F)期末残存口数	174,709,088,064口
(G)収益分配対象額（1万口当たり） （E/F×10,000）	4,304.75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

信託報酬を引下げるため、投資信託約款へ所要の変更を行いました。

（約款変更実施日：2023年12月1日）

S & P 5 0 0 インデックス[®]は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが楽天投信投資顧問株式会社に付与されています。S&P[®]、S&P 500[®]、US 500[™]、The 500[™]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、楽天投信投資顧問株式会社に対し一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、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 & P 5 0 0 インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

楽天・S & P 5 0 0 インデックス・マザーファンド

第1期(2024年7月16日)

《運用報告書》

●当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限(2023年9月26日設定)
運用方針	米国の株式市場の動きをとらえることを目指して、S & P 5 0 0 インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	米国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への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。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的、もしくはベンチマークとの連動性を維持する目的以外には利用しません。 デリバティブ取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

当マザーファンドはこのたび上記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。

楽天投信投資顧問株式会社

東京都港区南青山二丁目6番21号

URL : <https://www.rakuten-toushin.co.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
(設定日) 2023年 9月26日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 99
1期(2024年 7月16日)	14,013	40.1	13,927	39.3	86.4	3.6	10.4	249,917

(注1) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注2) 設定日の基準価額には当初設定価額を、純資産総額には当初設定元本を用いています。

ベンチマークは、S&P500インデックス(円換算ベース)です。

S&P500インデックスは、米国の金融商品取引所に上場している企業のうち、時価総額や流動性などを勘案して選ばれた500社の株式で構成される浮動株調整済時価総額加重平均型の株価指数です。

なお、「S&P500インデックス(円換算ベース)」は、委託会社が「S&P500インデックス」に日々の為替レートを乗じて算出したものです。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物組入比率	投資信託証券組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(設定日) 2023年 9月26日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —
9月末	9,999	△0.0	9,956	△0.4	91.0	6.5	3.0
10月末	9,694	△3.1	9,651	△3.5	72.9	64.7	266.2
11月末	10,422	4.2	10,380	3.8	81.0	13.9	7.8
12月末	10,581	5.8	10,533	5.3	72.3	12.9	19.3
2024年 1月末	11,342	13.4	11,289	12.9	92.0	5.4	4.0
2月末	11,940	19.4	11,878	18.8	89.4	6.8	4.7
3月末	12,449	24.5	12,383	23.8	93.1	3.9	3.6
4月末	12,570	25.7	12,501	25.0	92.9	3.3	4.1
5月末	12,867	28.7	12,792	27.9	94.1	3.6	2.6
6月末	13,861	38.6	13,778	37.8	94.8	3.2	2.3
(期末) 2024年 7月16日	14,013	40.1	13,927	39.3	86.4	3.6	10.4

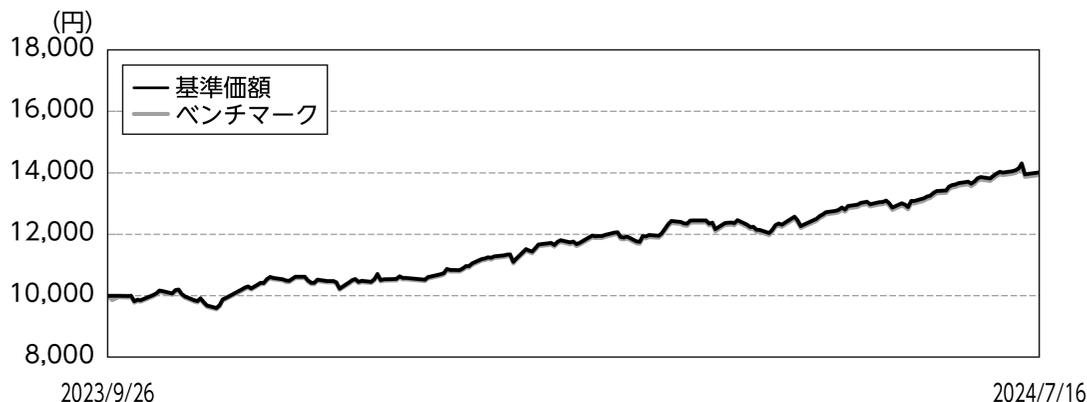
(注1) 騰落率は設定日比。

(注2) 株式先物組入比率=買建比率-売建比率

(注3) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



- (注1) ベンチマークは、S&P500インデックス(円換算ベース)です。
(注2) ベンチマークは、設定日の基準価額を起点として指数化しています。
(注3) 設定日の基準価額には当初設定価額を用いています。

■ 基準価額の主な変動要因

当ファンドは米国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とし、S&P500インデックス(円換算ベース)(以下、「ベンチマーク」)に連動する投資成果を目標として運用を行っています。

ベンチマークに連動する投資成果を目標として運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

当期の基準価額は大幅に上昇しました。米国株式市場が堅調に推移したほか、米ドルも対円で上昇し、基準価額を押し上げました。

■ 投資環境

当期の米国株式市場は、大きく上昇しました。期の初めは長期金利の上昇等が嫌気され、軟調地合いでの推移となりましたが、2023年11月以降は、FRB(米連邦準備制度理事会)に対する追加利上げ観測の後退や利下げ転換への期待が急速に広がり、金利低下圧力が強まるなかで、株式市場は上昇基調で推移しました。2024年に入ってから金利が上昇基調に転じたものの、米国経済がソフトランディング(軟着陸)することへの期待などを背景に株式市場の騰勢は継続しました。4月には、物価や雇用関連指標の上振れにより早期利下げ観測が大きく後退したことなどから、株式市場は一時調整する局面があったもののすぐに反発し、AI(人工知能)関連の需要拡大見通しなどを背景に期末まで堅調な推移が継続しました。

当期の米ドル/円相場は、大幅に米ドル高/円安が進行しました。米金利の上昇が一服するなか、2023年末にかけては一時、1米ドル=141円割れの水準まで米ドル安/円高が進行したものの、年明け以降は、堅調な米雇用関連指標や熾るインフレ懸念、FRB高官による早期利下げけん制発言などを受けた米金利の上昇を受けて反転し、米ドル高/円安基調となりました。日本銀行が金融政策決定会合にてマイナス金利解除などの政策修正を決定したタイミングや、日本当局による為替介入があった際には、一時的にまとまって円高に振れる場面がありましたが、低い金利の円を借りて米ドル等の外貨に換え、期待リターンの高い資産に投資する円キャリー取引への需要が根強かったことなどから円安圧力は衰えず、2024年6月から7月にかけては1米ドル=160円を超える水準まで米ドル高/円安が進みました。

■当ファンドのポートフォリオ

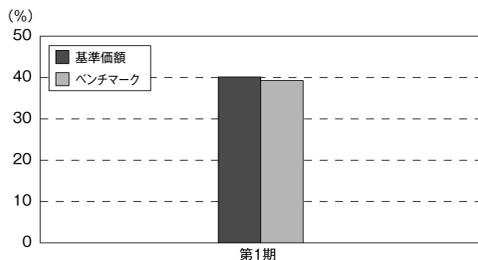
ベンチマークの構成銘柄である米国の株式を中心に投資を行いました。

またベンチマークとの連動性を維持するため、米国株式の指数との連動を目指すETF(上場投資信託証券)や米国株式の指数を対象とした株価指数先物取引にも一部投資を行いました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

当期の基準価額の騰落率は+40.1%上昇し、ベンチマーク比では+0.9%となりました。主な差異要因としては、継続的な資金流入に伴う現物株式やETF、株価指数先物取引の売買執行コストの積み重なり、保管費用等のコスト負担、ベンチマークと投資先ETFや株価指数先物取引とのパフォーマンスの差異、ベンチマークと当ファンドで適用される配当課税の税率の差異、売買タイミング等の要因が挙げられます。



■今後の運用方針

引き続き米国の株式等に投資することで、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

ベンチマークとの連動性を維持するため、米国株式の指数との連動を目指すETF(上場投資信託証券)や米国株式の指数を対象とした株価指数先物取引にも投資を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式) (投資信託証券) (先物・オプション)	1円 (1) (0) (0)	0.012% (0.010) (0.000) (0.001)
(b) 有価証券取引税 (株式)	0 (0)	0.000 (0.000)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	1 (1) (0)	0.006 (0.006) (0.000)
合計	2	0.018
期中の平均基準価額は11,572円です。		

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、費用項目については5ページ(1万口当たりの費用の明細の項目の概要)をご参照下さい。

(注2) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は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。

売買および取引の状況

■株式

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国		百株	千米ドル	百株	千米ドル
	ア メ リ カ	93,598 (7,611)	1,230,764 (△27)	228 (-)	1,142 (37)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■投資信託証券

			当 期			
			買 付		売 付	
			単位数又は口数	金 額	単位数又は口数	金 額
外 国	アメリカ	iシェアーズ・コア S&P 500 ETF SPDR S&P 500 ETF TRUST	千口	千米ドル	千口	千米ドル
			2,575	1,321,667	2,283	1,174,042
			358	185,366	358	185,892
		小 計	2,933	1,507,033	2,641	1,359,935

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■先物取引の種類別取引状況

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株 式 先 物 取 引	百万円 53,279	百万円 46,247	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

株式売買比率

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	188,121,266千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	80,683,072千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	2.33

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※との取引状況等

該当事項はありません。

※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項に規定されている利害関係人です。

組入資産の明細

■外国株式

銘 柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	501	5,162	818,033	ヘルステック機器・サービス
AES CORP	204	348	55,176	公益事業
INTERNATIONAL BUS MACH CORP	264	4,842	767,261	ソフトウェア・サービス
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES	45	576	91,341	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
ATR PRODUCTS & CHEMICALS INC	64	1,665	263,827	素材
BXP INC	41	284	45,133	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
ALLSTATE CORP	76	1,269	201,181	保険
HESS CORPORATION	79	1,199	190,101	エネルギー
AMERICAN EXPRESS CO	163	3,996	633,241	金融サービス
AFLAC INC	149	1,391	220,496	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	191	1,484	235,277	保険
VALERO ENERGY CORP	94	1,401	222,141	エネルギー
ALBEMARLE CORP	33	323	51,261	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	142	903	143,171	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	32	260	41,275	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千米ドル	千円		
AMEREN CORP	76	559	88,609	公益事業
AUTOZONE INC	4	1,467	232,571	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	23	508	80,519	素材
BALL CORP	89	546	86,623	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC	521	22,668	3,591,887	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	146	498	79,058	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	83	1,883	298,400	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	66	1,148	181,950	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	1,213	4,948	784,164	電気通信サービス
BERKLEY(W. R.)CORP	87	471	74,749	保険
BEST BUY CO INC	55	474	75,188	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO RAD LABORATORIES INC	5	177	28,147	ヘルスケア機器・サービス
YUM BRANDS INC	81	1,038	164,504	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	149	580	91,929	公益事業
BOEING CO	166	2,979	472,044	資本財
BORG WARNER INC	65	217	34,525	資本財
BOSTON SCIENTIFIC CORP	423	3,306	523,875	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	6	836	132,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	584	2,345	371,711	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	168	1,424	225,723	エネルギー
AVALONBAY COMMUNITIES INC	40	831	131,788	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
UNITED RENTALS INC	19	1,357	215,099	商業・専門サービス
SEMPRA	182	1,386	219,719	公益事業
FEDEX CORP	65	1,990	315,404	運輸
AMPHENOL CORP	346	2,413	382,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP	51	226	35,909	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES	42	1,085	172,005	資本財
COTERRA ENERGY INC	214	584	92,624	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	56	258	40,974	食品・飲料・タバコ
CAMDEN PROPERTY TRUST	30	335	53,180	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CONSTELLATION BRANDS INC	46	1,158	183,495	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH INC	70	658	104,283	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	140	4,874	772,335	資本財
JPMORGAN CHASE & CO.	827	17,386	2,754,885	銀行
CHURCH & DWIGHT	70	713	112,993	家庭用品・パーソナル用品
CLOROX CO	35	480	76,096	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	1,117	7,086	1,122,847	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	236	2,299	364,413	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	16	479	75,999	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	60	453	71,780	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	137	394	62,446	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	99	899	142,559	公益事業
CMS ENERGY CORP	86	519	82,259	公益事業
COOPER COS INC	57	507	80,491	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	222	1,016	161,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CUMMINS INC	39	1,139	180,514	資本財
DR HORTON INC	85	1,299	205,969	資本財
DANAHER CORP	190	4,678	741,326	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
MOODYS CORP	45	2,021	320,348	金融サービス
TARGET CORP	133	2,017	319,686	一般消費財・サービス流通・小売り
DEERE & CO	74	2,773	439,445	資本財
MORGAN STANLEY	360	3,796	601,591	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	59	1,187	188,083	商業・専門サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	7	665	105,478	耐久消費財・アパレル
WALT DISNEY COMPANY (THE)	525	5,090	806,561	メディア・娯楽
DOVER CORP	39	732	116,103	資本財
OMNICOM GROUP INC	56	529	83,854	メディア・娯楽
DTE ENERGY CO	59	674	106,925	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	34	492	78,091	消費者サービス
BANK OF AMERICA CORPORATION	1,961	8,215	1,301,680	銀行
CITIGROUP INC	549	3,581	567,472	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	33	331	52,462	素材
ECOLAB INC	73	1,771	280,740	素材
REVVITY INC	35	384	60,931	ヘルスケア機器・サービス
SALESFORCE INC	279	7,078	1,121,638	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	164	1,928	305,623	資本財
ATMOS ENERGY CORP	43	525	83,263	公益事業
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18	511	80,974	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
ENTERGY CORP	61	657	104,186	公益事業
EOG RESOURCES INC	165	2,197	348,190	エネルギー
EQUIFAX INC	35	922	146,203	金融サービス
EQUITY RESIDENTIAL	99	675	106,989	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
EQT CORPORATION	127	468	74,282	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES INC	67	678	107,537	耐久消費財・アパレル
EXXON MOBIL CORPORATION	1,293	14,896	2,360,429	エネルギー
FMC CORP	35	208	33,100	素材
NEXTERA ENERGY INC	592	4,202	665,940	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS	10	470	74,624	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	7	1,132	179,381	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	14	256	40,614	保険
M & T BANK CORP	48	761	120,668	銀行
FISERV INC	168	2,620	415,242	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	86	200	31,816	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	414	2,087	330,794	素材
GALLAGHER (ARTHUR J.) & CO	62	1,703	269,896	保険
General Dynamics Corp	65	1,870	296,358	資本財
GENERAL MILLS INC	162	1,022	162,081	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	40	567	89,847	自動車・自動車部品
GARTNER INC	22	1,018	161,355	商業・専門サービス
MCKESSON CORPORATION	37	2,166	343,319	ヘルスケア機器・サービス
GRAINGER W W INC	12	1,187	188,223	商業・専門サービス
HALLIBURTON CO	255	898	142,446	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92	4,575	724,952	金融サービス
HERSHEY COMPANY	42	803	127,370	食品・飲料・タバコ
JUNIPER NETWORKS	93	348	55,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOME DEPOT INC	285	10,239	1,622,491	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
HORMEL FOODS CORP	83	255	40,501	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	184	521	82,624	公益事業
HUMANA INC	34	1,334	211,429	ヘルスケア機器・サービス
IDEX CORP	21	450	71,460	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS INC	78	1,931	305,991	資本財
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES	73	708	112,187	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	100	441	70,023	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	108	320	50,851	メディア・娯楽
JABIL INC	34	400	63,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON & JOHNSON	693	10,352	1,640,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP INC	85	875	138,698	保険
DEVON ENERGY CORP	182	875	138,695	エネルギー
KELLANOVA	75	427	67,714	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	271	421	66,746	銀行
KIMCO REALTY CORP	192	403	63,888	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
KIMBERLY CLARK CORP	97	1,368	216,839	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	40	3,313	524,982	金融サービス
KROGER CO	192	1,005	159,346	生活必需品流通・小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	13	539	85,529	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	25	477	75,615	素材
LENNAR CORP	70	1,123	178,017	資本財
ELI LILLY AND COMPANY	230	21,871	3,465,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITED PARCEL SERVICE INC	210	3,030	480,200	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES INC	84	1,106	175,347	ヘルスケア機器・サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	61	2,855	452,403	資本財
LOEWS CORP	52	405	64,194	保険
CARNIVAL CORP	291	533	84,515	消費者サービス
LOWE'S COMPANIES INC	164	3,829	606,733	一般消費財・サービス流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	241	1,232	195,358	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	72	333	52,891	消費者サービス
MCCORMICK & COMPANY INC	72	527	83,641	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	207	5,225	827,906	消費者サービス
EVEREST GROUP LTD	12	496	78,672	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	173	1,554	246,314	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	142	3,102	491,624	保険
MASCO CORP	63	448	70,992	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	17	989	156,710	素材
METLIFE INC	172	1,281	203,059	保険
CVS HEALTH CORPORATION	361	2,122	336,385	ヘルスケア機器・サービス
LABCORP HOLDINGS INC	24	504	79,890	ヘルスケア機器・サービス
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	33	471	74,663	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
3M COMPANY	159	1,638	259,601	資本財
MOHAWK INDUSTRIES	15	195	30,949	資本財
CHARLES RIVER LABORATORIES	14	321	50,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FORD MOTOR CO	1,130	1,608	254,860	自動車・自動車部品
NEWMONT CORPORATION	332	1,573	249,371	素材
NVR INC	0.9	726	115,067	資本財
NIKE INC	349	2,490	394,552	耐久消費財・アパレル

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	1,483	235,008	運輸
NISOURCE INC	129	384	60,871	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	40	1,731	274,435	資本財
WELLS FARGO & COMPANY	1,004	5,801	919,214	銀行
NUCOR CORP	69	1,139	180,540	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	110	1,592	252,368	金融サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	191	1,188	188,294	エネルギー
ORACLE CORP	459	6,574	1,041,660	ソフトウェア・サービス
PARKER-HANNIFIN CORP	37	2,018	319,793	資本財
PPL CORP	212	594	94,243	公益事業
PFIZER INC	1,633	4,753	753,120	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONOCOPHILLIPS	337	3,862	611,976	エネルギー
PG&E CORP	615	1,088	172,462	公益事業
ALTRIA GROUP INC	495	2,362	374,349	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	114	1,938	307,153	銀行
BROWN & BROWN INC	68	636	100,806	保険
PPG INDUSTRIES INC	67	887	140,686	素材
QUEST DIAGNOSTICS INC	32	462	73,358	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	680	11,196	1,774,039	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP (OHIO)	168	3,665	580,732	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	143	1,070	169,568	公益事業
PULTE GROUP INC	60	704	111,669	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	73	732	115,988	金融サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	53	651	103,183	金融サービス
REALTY INCOME CORP	250	1,405	222,628	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
UDR INC	87	354	56,124	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
RESMED INC	42	869	137,737	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	449	1,904	301,825	銀行
ROLLINS INC	80	391	61,977	消費者サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	32	937	148,494	資本財
ROYAL CARIBBEAN GROUP	68	1,144	181,349	消費者サービス
TRAVELERS COMPANIES INC	66	1,408	223,201	保険
FIDELITY NATL INFORMATION SERVICES	160	1,220	193,352	金融サービス
MERCK & CO INC	730	9,353	1,482,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER LIMITED	411	1,975	313,081	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	430	3,230	511,858	金融サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	59	631	100,096	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE GLOBAL SA	40	450	71,343	食品・飲料・タバコ
CENCORA INC	47	1,060	168,010	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO	67	2,141	339,303	素材
CENTENE CORPORATION	153	1,015	160,860	ヘルスケア機器・サービス
SIMON PROPERTY GROUP INC	93	1,409	223,384	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
SMITH A O CORP	34	305	48,427	資本財
SNAP-ON INC	15	411	65,230	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	103	1,299	205,840	保険
EDISON INTERNATIONAL	110	810	128,364	公益事業
SOUTHERN CO.	315	2,522	399,759	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	172	477	75,738	運輸

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
AT&T INC	2,066	3,840	608,448	電気通信サービス
CHEVRON CORPORATION	494	7,807	1,237,122	エネルギー
STATE STREET CORPORATION	86	685	108,619	金融サービス
PUBLIC STORAGE	45	1,377	218,185	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
STRYKER CORP	97	3,211	508,785	ヘルスケア機器・サービス
SYSCO CORP	143	1,030	163,301	生活必需品流通・小売り
TELEFLEX INC	13	298	47,304	ヘルスケア機器・サービス
TEXTRON INC	54	500	79,339	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	110	5,993	949,608	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	14	202	32,118	ヘルスケア機器・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	12	637	101,026	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	82	473	75,070	食品・飲料・タバコ
MARATHON OIL CORPORATION	162	467	74,036	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	175	4,150	657,586	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	265	13,672	2,166,368	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC.	17	307	48,696	ヘルスケア機器・サービス
VENTAS INC	116	614	97,312	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
VULCAN MATERIALS CO	38	967	153,358	素材
WALMART INC	1,231	8,570	1,358,065	一般消費財・サービス流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	105	2,272	360,049	商業・専門サービス
WATERS CORP	17	518	82,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	21	672	106,515	ヘルスケア機器・サービス
SMUCKER (J. M.) CO	30	356	56,427	食品・飲料・タバコ
WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECH CORP	50	834	132,240	資本財
WEYERHAEUSER COMPANY	210	610	96,688	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
WILLIAMS COMPANIES INC	351	1,495	236,903	エネルギー
CARMAX INC	45	372	58,948	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COS INC	326	3,715	588,657	一般消費財・サービス流通・小売り
REGIONS FINANCIAL CORP	263	554	87,838	銀行
DOMINOS PIZZA INC	10	485	76,918	消費者サービス
EXTRA SPACE STORAGE INC	61	991	157,044	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
LAS VEGAS SANDS CORP	105	444	70,446	消費者サービス
DIGITAL REALTY TRUST INC	93	1,491	236,376	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CELANESE CORP	28	413	65,545	素材
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY	52	269	42,634	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	35	538	85,381	資本財
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	52	372	59,067	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	28	1,276	202,233	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	41	403	64,005	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL	396	2,241	355,206	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	16	2,003	317,414	資本財
MASTERCARD INCORPORATED	236	10,507	1,664,875	金融サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION INC	34	708	112,329	商業・専門サービス
DELTA AIR LINES INC	186	799	126,735	運輸
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	72	989	156,863	金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	215	1,416	224,425	金融サービス
INVESCO LTD	129	210	33,323	金融サービス
MSCI INC	22	1,145	181,492	金融サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	448	4,708	745,995	食品・飲料・タバコ
VISA INC	453	12,180	1,930,024	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS COMPANY INC	56	765	121,313	公益事業
CHUBB LIMITED	117	3,045	482,540	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	101	1,693	268,272	エネルギー
MOSAIC CO	92	267	42,348	素材
KINDER MORGAN INC	556	1,122	177,873	エネルギー
XYLEM INC	69	959	152,025	資本財
STANLEY BLACK & DECKER INC	44	385	61,080	資本財
LYONDELLBASELL INDUSTRIES N V	74	709	112,379	素材
GARMIN LTD	44	753	119,385	耐久消費財・アパレル
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	11	290	46,033	資本財
PROLOGIS INC	266	3,232	512,247	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
EPAM SYS INC	16	333	52,879	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC	181	5,760	912,792	商業・専門サービス
HCA HEALTHCARE INC	55	1,770	280,609	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	20	586	92,931	金融サービス
RALPH LAUREN CORP	11	192	30,492	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORPORATION	63	858	136,039	エネルギー
DOLLAR GENERAL CORP	63	803	127,379	一般消費財・サービス流通・小売り
MOTOROLA SOLUTIONS INC	48	1,895	300,394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAC HLDGS INC	17	270	42,856	資本財
TE CONNECTIVITY LTD	88	1,378	218,439	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO	328	1,621	256,899	自動車・自動車部品
CBRE GROUP INC	86	833	132,024	不動産管理・開発
APTIV PLC	78	566	89,787	資本財
PHILLIPS 66	122	1,711	271,211	エネルギー
AMERICAN TOWER CORP	134	2,810	445,400	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
DUKE ENERGY CORP	222	2,342	371,240	公益事業
SERVICENOW INC	59	4,537	718,923	ソフトウェア・サービス
EATON CORPORATION PLC	115	3,768	597,149	資本財
ABBVIE INC	509	8,552	1,355,179	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	131	2,340	370,898	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HLDGS LTD	123	242	38,348	消費者サービス
INVITATION HOMES INC	165	585	92,773	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
HUBBELL INC	15	579	91,822	資本財
LAMB WESTON HLDGS INC	41	320	50,713	食品・飲料・タバコ
IQVIA HOLDINGS INC	52	1,186	187,981	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEIDOS HOLDINGS INC	38	580	91,979	資本財
TAPESTRY INC	66	281	44,579	耐久消費財・アパレル
ALLEGION PLC	25	309	49,001	資本財
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	165	2,443	387,237	金融サービス
DAYFORCE INC	45	245	38,867	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	28	627	99,504	ヘルスケア機器・サービス
KKR & CO INC	191	2,205	349,444	金融サービス
THE CIGNA GROUP	81	2,713	429,980	ヘルスケア機器・サービス
DOW INC	202	1,079	171,083	素材
AMCOR PLC	416	409	64,955	素材

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	202	419	66,407	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
DUPONT DE NEMOURS INC	120	966	153,140	素材
CARRIER GLOBAL CORPORATION	241	1,626	257,789	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	116	1,158	183,623	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	602	4,353	689,884	消費者サービス
GLOBE LIFE INC	24	210	33,287	保険
CORTEVA INC	200	1,062	168,394	食品・飲料・タバコ
L3 HARRIS TECHNOLOGIES INC	54	1,282	203,169	資本財
TRANE TECHNOLOGIES PLC	65	2,224	352,501	資本財
BLACKSTONE INC	205	2,726	432,043	金融サービス
HOWMET AEROSPACE INC	111	881	139,731	資本財
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	385	1,596	253,006	銀行
GENERAL ELECTRIC CO	315	5,034	797,681	資本財
INGERSOLL-RAND INC	116	1,147	181,792	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	13	216	34,283	ソフトウェア・サービス
AON PLC (IE)	62	1,863	295,230	保険
PENTAIR PLC	47	383	60,705	資本財
RTX CORPORATION	383	3,894	617,048	資本財
SOLVENTUM CORP	39	192	30,431	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	73	2,636	417,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	21	228	36,280	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
JACOBS SOLUTIONS INC	36	522	82,746	資本財
BATH & BODY WORKS INC	64	237	37,592	一般消費財・サービス流通・小売り
LINDE PLC	138	6,071	962,016	素材
GE VERNOVA INC	79	1,401	222,111	資本財
CATALENT INC	52	301	47,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	115	587	93,015	金融サービス
VERALTO CORPORATION	63	620	98,333	商業・専門サービス
KENVUE INC	551	999	158,377	家庭用品・パーソナル用品
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	131	507	80,344	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	50	732	116,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELEVANCE HEALTH INC	66	3,554	563,272	ヘルスケア機器・サービス
CROWN CASTLE INC	125	1,291	204,650	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
MEDTRONIC PLC	382	2,950	467,440	ヘルスケア機器・サービス
IRON MOUNTAIN INC	84	826	130,969	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
EVERSOURCE ENERGY	101	601	95,334	公益事業
GODADDY INC	40	596	94,500	ソフトウェア・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	194	1,359	215,405	資本財
SMURFIT WESTROCK PLC	74	363	57,583	素材
FORTIVE CORP	101	773	122,561	資本財
S&P GLOBAL INC	92	4,452	705,496	金融サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	72	1,607	254,643	消費者サービス
WELLTOWER OP LLC	172	1,815	287,654	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	374	803	127,295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VICI PROPERTIES INC	300	910	144,314	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
HP INCORPORATION	248	928	147,185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEC ENERGY GROUP INC	91	724	114,827	公益事業
VISTRA CORP	94	811	128,565	公益事業

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
AMAZON COM INC	2,639	50,871	8,060,624	一般消費財・サービス流通・小売り
ADVANCED MICRO DEVICES INC	465	8,378	1,327,509	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	129	7,305	1,157,479	ソフトウェア・サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	187	4,049	641,574	資本財
AMGEN INC	154	5,104	808,852	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	151	1,381	218,937	公益事業
ANALOG DEVICES INC	142	3,397	538,408	半導体・半導体製造装置
COMCAST CORP	1,128	4,393	696,122	メディア・娯楽
ANSYS INC	25	823	130,545	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	4,154	97,386	15,430,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	239	5,880	931,832	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	61	1,561	247,347	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	117	2,862	453,551	商業・専門サービス
CH ROBINSON WORLDWIDE INC	33	293	46,540	運輸
TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	45	701	111,184	メディア・娯楽
VERISIGN	24	441	70,018	ソフトウェア・サービス
CSX CORP	563	1,949	308,926	運輸
CINCINNATI FINANCIAL CORP	45	556	88,141	保険
CINTAS CORP	24	1,777	281,584	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,167	5,532	876,583	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	252	1,379	218,658	商業・専門サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	69	1,705	270,310	消費者サービス
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	143	1,037	164,470	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	117	894	141,755	不動産管理・開発
DOLLAR TREE INC	59	620	98,266	一般消費財・サービス流通・小売り
EBAY INC	145	783	124,146	一般消費財・サービス流通・小売り
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	78	2,475	392,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRONIC ARTS INC	70	1,016	161,125	メディア・娯楽
EXPEDITORS INTERN OF WASHINGTON INC	40	484	76,780	運輸
FASTENAL	165	1,119	177,368	商業・専門サービス
FIFTH THIRD BANCORP	197	772	122,342	銀行
GILEAD SCIENCES INC	359	2,542	402,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	7,090	91,067	14,429,613	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	37	224	35,567	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	36	243	38,505	ヘルスケア機器・サービス
F5 INC	16	301	47,848	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	67	520	82,436	ヘルスケア機器・サービス
HUNT(J.B.) TRANSPORT SERVICES INC	23	398	63,159	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	417	573	90,880	銀行
BIOGEN INC	41	929	147,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	80	5,311	841,609	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	23	1,148	182,031	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	1,227	4,228	669,986	半導体・半導体製造装置
HENRY JACK & ASSOCIATES INC	21	351	55,718	金融サービス
INCYTE CORPORATION	53	345	54,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORPORATION	38	3,330	527,696	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	37	4,028	638,301	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES	43	422	66,958	ソフトウェア・サービス

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
HOST HOTELS & RESORTS INC	203	372	58,958	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
ON SEMICONDUCTOR CORP	124	947	150,062	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	2,142	97,251	15,409,555	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	319	4,177	661,883	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY	155	1,434	227,279	半導体・半導体製造装置
XCEL ENERGY INC	160	852	135,083	公益事業
NETAPP INC	59	775	122,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORDSON CORP	15	370	58,715	資本財
NORTHERN TRUST CORP	58	532	84,411	金融サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	51	1,002	158,894	運輸
PACCAR INC	151	1,579	250,278	資本財
EXELON CORP	288	1,018	161,454	公益事業
PAYCHEX INC	92	1,123	177,960	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	20	484	76,826	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	396	6,493	1,028,860	食品・飲料・タバコ
COSTCO WHOLESALE CORP	127	10,850	1,719,208	生活必需品流通・小売り
PRICE T ROWE GROUPS	64	764	121,089	金融サービス
QUALCOMM INC	322	6,708	1,062,977	半導体・半導体製造装置
REGENCY CENTERS CORP	47	304	48,210	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	30	3,308	524,154	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP	107	1,047	165,942	保険
ROSS STORES INC	96	1,431	226,772	一般消費財・サービス流通・小売り
ROPER TECHNOLOGIES INC	30	1,724	273,322	ソフトウェア・サービス
POOL CORPORATION	11	361	57,260	商業・専門サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	534	84,768	保険
STARBUCKS CORP	326	2,375	376,352	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	42	561	88,976	素材
NETFLIX INC	124	8,153	1,291,860	メディア・娯楽
SYNOPSIS INC	43	2,708	429,177	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	102	4,470	708,341	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	45	717	113,720	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	262	5,294	838,991	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY CO	31	841	133,378	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE INC	70	403	63,897	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTEX PHARMACEUTICAL	74	3,650	578,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	94	741	117,546	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	46	535	84,920	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	27	230	36,488	消費者サービス
NASDAQ INC	109	690	109,486	金融サービス
CME GROUP INC	103	2,044	323,962	金融サービス
LKQ CORPORATION	76	336	53,381	自動車・自動車部品
ALLIANT ENERGY CORP	73	395	62,692	公益事業
ZEBRA TECHNOLOGIES	14	485	76,904	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONOLITHIC POWER SYSTEM INC	14	1,221	193,607	半導体・半導体製造装置
MARKETAXESS HLDGS INC	10	239	38,003	金融サービス
DEXCOM INC	114	1,295	205,261	ヘルスケア機器・サービス
FIRST SOLAR INC	30	658	104,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUPER MICRO COMPUTER INC	14	1,303	206,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
INSULET CORPORATION	20	401	63,620	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	33	937	148,487	耐久消費財・アパレル
ULTA BEAUTY INC	13	546	86,531	一般消費財・サービス流通・小売り
VERISK ANALYTICS INC	41	1,141	180,804	商業・専門サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	94	420	66,552	運輸
NXP SEMICONDUCTORS N V	73	2,084	330,212	半導体・半導体製造装置
FORTINET INC	182	1,094	173,460	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	799	20,204	3,201,463	自動車・自動車部品
OREILLY AUTOMOTIVE INC NEW	16	1,770	280,458	一般消費財・サービス流通・小売り
ENPHASE ENERGY INC	39	443	70,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EXPEDIA GROUP INC	36	484	76,830	消費者サービス
META PLATFORMS INC	631	31,340	4,965,971	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	51	1,084	171,821	エネルギー
PALO ALTO NETWORKS INC	93	3,174	503,062	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTL INC	386	2,488	394,228	食品・飲料・タバコ
T-MOBILE US INC	148	2,701	428,000	電気通信サービス
PTC INC	34	636	100,932	ソフトウェア・サービス
NEWS CORP NEW	109	302	47,972	メディア・娯楽
NEWS CORP NEW	32	93	14,809	メディア・娯楽
CDW CORP	38	901	142,882	商業・専門サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	189	201	31,852	運輸
KEURIG DR PEPPER INC	300	982	155,742	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	29	776	122,962	保険
BAKER HUGHES COMPANY	287	1,027	162,765	エネルギー
BOOKING HOLDINGS INC	9	3,998	633,493	消費者サービス
AXON ENTERPRISE INC	20	631	100,008	資本財
BROADCOM INC	1,255	21,523	3,410,397	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	66	358	56,837	公益事業
MODERNA INC	96	1,167	184,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FOX CORP	66	239	37,996	メディア・娯楽
FOX CORP	38	127	20,216	メディア・娯楽
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	66	2,509	397,572	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	158	402	63,818	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	76	245	38,853	メディア・娯楽
PARAMOUNT GLOBAL	142	165	26,146	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	56	613	97,165	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	122	981	155,471	ヘルスケア機器・サービス
WARNER BROS DISCOVERY INC	642	476	75,564	メディア・娯楽
AIRBNB INC	127	1,873	296,859	消費者サービス
CONSTELLATION ENERGY CORPORATION	90	1,934	306,478	公益事業
VIATRIS INC	343	377	59,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC NEW	62	244	38,765	消費者サービス
APA CORPORATION	103	326	51,732	エネルギー
QORVO INC	27	351	55,702	半導体・半導体製造装置
BIO-TECHNE CORP	45	350	55,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	206	241	38,263	生活必需品流通・小売り
EQUINIX INC	27	2,201	348,835	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
ETSY INC	33	207	32,876	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千米ドル	千円	
KRAFT HEINZ CO	227	734	116,402	食品・飲料・タバコ
ALPHABET INC	1,693	31,581	5,004,160	メディア・娯楽
PAYPAL HOLDINGS INC	301	1,823	288,890	金融サービス
ALPHABET INC	1,408	26,508	4,200,203	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	204	1,019	161,521	食品・飲料・タバコ
SBA COMMUNICATIONS CORP	30	651	103,178	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHARTER COMMUNICATIONS INC	28	916	145,190	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	30	522	82,854	金融サービス
合 計	株 数 ・ 金 額	100,981	1,362,643	215,910,802
	銘柄数 <比率>	503	—	<86.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注3) 株数、評価額の単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満となる場合は小数で記載。

■外国投資信託証券

銘柄	当 期 末		
	単位数又は口数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千米ドル	千円
アメリカ i シェアーズ・コア S&P 500 ETF	291	164,709	26,098,166
合 計	口 数 ・ 金 額	291	164,709
	銘柄数 <比率>	1	—
			<10.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する各国別投資信託証券評価額の比率です。

(注3) 単位数又は口数、評価額の単位未満は切捨て。

■先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引		
S&P 500 EMIN	8,914	—

(注) 単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 215,910,802	% 86.0
投 資 信 託 受 益 証 券	26,098,166	10.4
短 期 金 融 資 産、そ の 他	9,003,497	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	251,012,465	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建資産(243,712,033千円)の投資信託財産総額(251,012,465千円)に対する比率は、97.1%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは、1米ドル=158.45円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年7月16日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	258,192,296,478円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,323,526,207
株 式(評価額)	215,910,802,826
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	26,098,166,151
未 収 入 金	7,415,801,589
未 収 配 当 金	137,600,191
未 収 利 息	1,715
差 入 委 託 証 拠 金	2,306,397,799
(B) 負 債	8,274,691,975
未 払 金	8,274,691,975
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	249,917,604,503
元 本	178,347,265,643
次 期 繰 越 損 益 金	71,570,338,860
(D) 受 益 権 総 口 数	178,347,265,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,013円

(注1) 設定元本額 99,990,000円

期中追加設定元本額 178,349,607,291円

期中一部解約元本額 102,331,648円

(注2) 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

楽天・S&P500インデックス・ファンド 178,346,266,123円

楽天・S&P500インデックス・ファンド(適格機関投資家専用) 999,520円

■損益の状況

(自2023年9月26日 至2024年7月16日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	858,198,916円
受 取 配 当 金	817,265,181
受 取 利 息	6,985,595
そ の 他 収 益 金	34,875,529
支 払 利 息	△927,389
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	33,788,528,767
売 買 益	36,880,740,173
売 買 損	△3,092,211,406
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,544,693,367
取 引 益	1,546,379,576
取 引 損	△1,686,209
(D) そ の 他 費 用	△4,597,547
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	36,186,823,503
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	35,390,632,709
(G) 解 約 差 損 益 金	△7,117,352
(H) 計 算(E+F+G)	71,570,338,860
次 期 繰 越 損 益 金(H)	71,570,338,860

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益及び(C)先物取引等取引損益は期末の評価替えによるものを含みます。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。