

# GS日本株式 インデックス・ プラス

追加型投信／国内／株式

第41期(決算日2026年3月23日)

作成対象期間：2025年9月23日～2026年3月23日

## 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「GS日本株式インデックス・プラス」は、このたび、第41期の決算を行いました。本ファンドは、日本株式市場に広く分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）との連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益を安定的に獲得することをめざして運用を行っております。今期の運用経過等について、以下のとおり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。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒105-5543

東京都港区虎ノ門2-6-1 虎ノ門ヒルズステーションタワー

お問合せ先：03-4587-6000（代表）

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

www.gsam.co.jp

第41期末（2026年3月23日）		第41期	
基準価額	11,596円	騰落率	16.0%
純資産総額	11,049百万円	分配金合計	2,115円

(注)騰落率は収益分配金(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す。

本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／国内／株式
信託期間	原則として無期限
運用方針	国内の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を図ることを目標とします。独自開発の計量モデルを用いて、多様な評価基準に基づいて銘柄選択を行うことにより、グロース相場、バリュウ相場といったさまざまな市場局面においても安定した付加価値を獲得することと、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）を運用上のベンチマークとして、ベンチマークの動きからの乖離を抑制しつつ、ベンチマークを上回る収益を安定的に獲得することを目的とします。
主要投資対象	
本ファンド	日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド	日本の上場株式
運用方法・組入制限	①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入比率は高位に保ちます。 ②マザーファンドにおける株式の組入れ比率は原則としてフル・インベストメントとします。
分配方針	原則として毎計算期末（毎年3月20日および9月20日。休業日の場合は翌営業日。）に収益の分配を行います。投信会社が経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の中から基準価額水準、市場動向等を勘案して分配金を決定します。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			ベンチマーク		株式 組入比率	純資産 総額
	税引前 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	百万円
37期(2024年3月21日)	12,275	1,760	17.7	4,702.41	17.5	103.1	7,399
38期(2024年9月20日)	10,888	790	△4.9	4,495.69	△4.4	99.5	7,801
39期(2025年3月21日)	11,024	690	7.6	4,826.67	7.4	100.1	8,263
40期(2025年9月22日)	11,822	1,320	19.2	5,517.68	14.3	101.3	9,090
41期(2026年3月23日)	11,596	2,115	16.0	6,149.83	11.5	98.7	11,049

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

(注3) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率は、実質比率を記載しております。

## ■当期中の基準価額と市況推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率
	騰落率	騰落率			
(期首) 2025年9月22日	円	%		%	%
	11,822	—	5,517.68	—	101.3
9月末	11,849	0.2	5,523.68	0.1	97.1
10月末	12,679	7.2	5,865.99	6.3	97.6
11月末	13,066	10.5	5,949.55	7.8	98.0
12月末	13,274	12.3	6,010.98	8.9	98.1
2026年1月末	13,920	17.7	6,288.77	14.0	98.3
2月末	15,698	32.8	6,947.17	25.9	98.6
(期末) 2026年3月23日	13,711	16.0	6,149.83	11.5	98.7

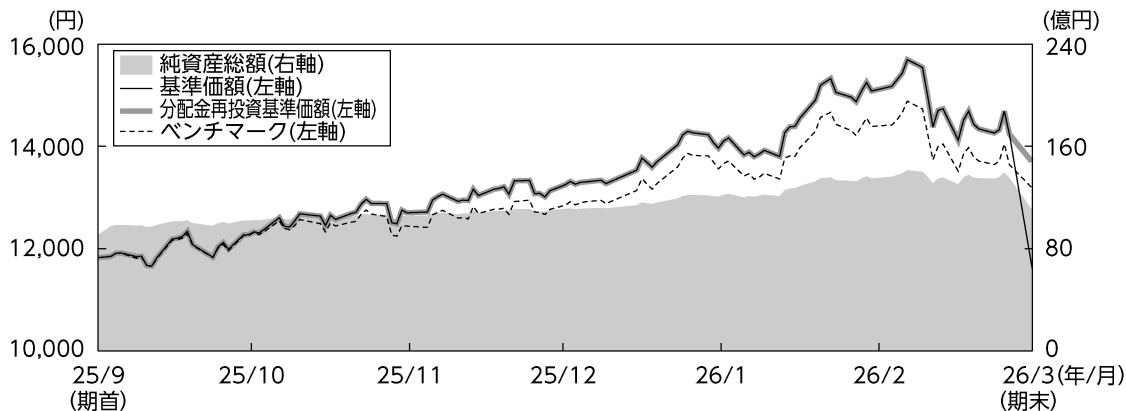
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

(注3) 本ファンドはマザーファンドを組入れますので、株式組入比率は、実質比率を記載しております。

## 運用経過

## ■基準価額等の推移について（2025年9月23日～2026年3月23日）



第41期首：11,822円

第41期末：11,596円

（当期中にお支払いした分配金：2,115円）

騰落率：+16.0%（分配金再投資ベース）

- (注1) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。  
東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）に係る標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社の知的財産です。
- (注2) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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3) 実際のファンドにおいては、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。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ない点にご留意ください。
- (注4) 分配金再投資基準価額、ベンチマークは、期首の基準価額を起点として指数化しています。
- (注5) 騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

## ■基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の11,822円から226円下落し、期末には11,596円となりました。

上昇要因

銘柄選択の4つの投資テーマすべてがプラス寄与となったことや当期の日本株式市場が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

当期中に分配金をお支払いしたことなどが、基準価額の下落要因となりました。

## ■投資環境について

当期の日本株式市場は上昇しました。

2025年9月下旬は、連日で史上最高値を更新する局面がありました。10月は、市場の関心が関税リスクから期待成長へとシフトし、PER（株価収益率）の上限を試す展開となりました。11月は、中間決算において約4割の企業が上方修正したことが、市場の強いファンダメンタルズを再確認させました。12月は、先物市場で2026年3月限への乗り換えが進むなか、デフレ脱却への期待が相場を下支えしました。2026年1月は、半導体関連株が米国市場と連動して大きく変動し、日本政府の政策期待も相まって、日本株式市場は大きく上昇しました。2月は、高市首相の総選挙勝利と大規模な財政出動への期待から、月間10.5%という極めて高いリターンを記録しました。3月に入ると、イスラエル・米国によるイラン攻撃を受け原油価格が高騰したことから、リスクオフの動きとなりました。

## ■ポートフォリオについて

### <本ファンド>

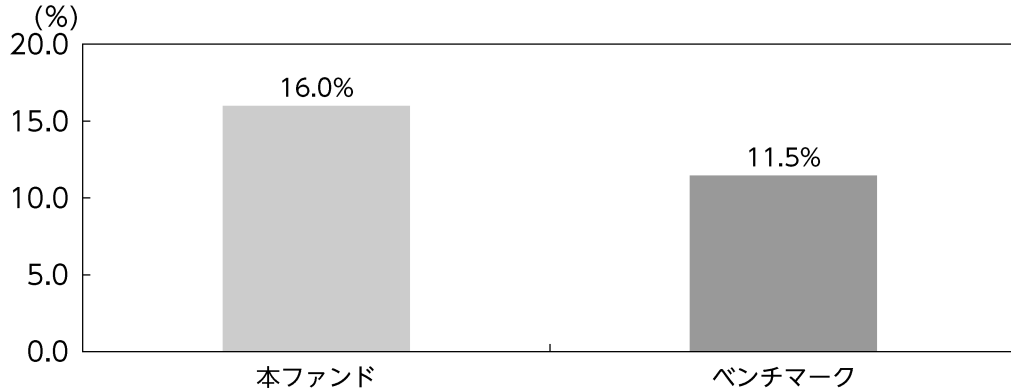
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンドを通じて、日本株式市場に広く分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）との連動性を維持しながら、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行いました。

### <本マザーファンド>

本マザーファンドでは、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）との連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益を安定的に獲得することをめざしました。また、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて銘柄選択を行うことにより、安定した付加価値の獲得を追求しました。

## ■ベンチマークとの差異について

<当期の基準価額とベンチマークの対比（騰落率）>



(注1) 基準価額の騰落率は収益分配金（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す。

(注2) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

当期の本ファンドのパフォーマンス（分配金再投資ベース）は+16.0%となり、ベンチマーク（+11.5%）を上回りました。

当運用では、財務諸表などの伝統的なデータに加え、ニュース記事やウェブ・アクセス量などの非伝統的データも活用し、4つの投資テーマを通じた多面的な評価基準に基づいて投資対象銘柄の評価を行います。当期は、投資テーマ「テーマおよびトレンド」、「センチメント」、「ファンダメンタル・ミスマプライス」、「ハイクオリティ・ビジネス」すべてがプラス寄与となりました。

## ■分配金について

収益分配金（1万口当たり、税引前）については、分配方針および基準価額の水準などを勘案し、当期は2,115円としました。収益分配金に充てなかった収益については、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

## 今後の運用方針について

<本ファンド>

今後も引き続き本マザーファンド受益証券を高位に組入れ、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

<本マザーファンド>

従来通りの運用を継続します。また、個別銘柄のリターン予測モデル、ポートフォリオのリスク管理モデルなどの計量モデルに関する研究・開発は継続的に実施しており、将来のモデル改良への布石としています。

## ■1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2025年9月23日～2026年3月23日		
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	74円 (33)	0.548% (0.247)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ファンドの運用、受託会社への指図、基準価額の算出、目論見書・運用報告書等の作成等の対価 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、分配金・換金代金・償還金の支払い業務等の対価 ファンドの財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(販売会社)	(37)	(0.274)	
(受託会社)	(4)	(0.027)	
売買委託手数料 (株式)	5 (5)	0.035 (0.034)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
その他費用 (監査費用)	1 (0)	0.006 (0.001)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用
(その他)	(1)	(0.005)	
合計	80	0.589	

期中の平均基準価額は13,414円です。

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、本ファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、本ファンドに対応するものを含みます。

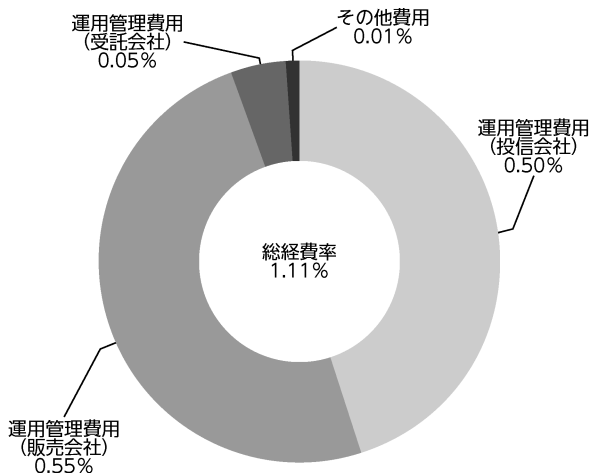
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.11%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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。

### ■売買及び取引の状況(2025年9月23日から2026年3月23日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド	736,247	4,163,194	514,067	2,757,811

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	26,594,108千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,164,103千円
(c) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	1.75

(注1) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) マザーファンドの金額および割合は、当該子ファンドの計算期間で算出。

### ■利害関係人との取引状況等(2025年9月23日から2026年3月23日まで)

利害関係人との取引はありません。

(注) 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(2026年3月23日現在)

親投資信託残高

種 類	前期末	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド	2,042,164	2,264,344	13,129,121

## ■投資信託財産の構成

2026年3月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド	13,129,121	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	48,236	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	13,177,357	100.0

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2026年3月23日
(A) 資 産	13,177,357,294円
日本株計量運用ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	13,129,121,624
未 収 入 金	48,235,670
(B) 負 債	2,127,488,699
未 払 収 益 分 配 金	2,015,450,354
未 払 解 約 金	48,235,670
未 払 信 託 報 酬	63,136,030
そ の 他 未 払 費 用	666,645
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	11,049,868,595
元 本	9,529,316,097
次 期 繰 越 損 益 金	1,520,552,498
(D) 受 益 権 総 口 数	9,529,316,097口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,596円

## ■損益の状況

項 目	当 期
	自2025年9月23日 至2026年3月23日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,385,353,094円
売 買 益	1,565,976,540
売 買 損	△ 180,623,446
(B) 信 託 報 酬 等	△ 63,802,675
(C) 当 期 損 益 金 ( A + B )	1,321,550,419
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	796,951,379
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,417,501,054
( 配 当 等 相 当 額 ) (	3,314,571,988)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (△	1,897,070,934)
(F) 計 ( C + D + E )	3,536,002,852
(G) 収 益 分 配 金	△ 2,015,450,354
次 期 繰 越 損 益 金 ( F + G )	1,520,552,498
追 加 信 託 差 損 益 金	1,417,501,054
( 配 当 等 相 当 額 ) (	3,325,836,068)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (△	1,908,335,014)
分 配 準 備 積 立 金	103,051,444

(注1) 損益の状況の中で (A) 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) 損益の状況の中で (B) 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引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程において、マザーファンドの配当等収益を繰入れております。

(注5) 期首元本額は7,689,034,697円、当作成期間中において、追加設定元本額は3,104,697,130円、同解約元本額は1,264,415,730円です。

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第41期
1万口当たり分配金	2,115円

- ◇分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金(特別分配金)があります。
- ◇分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。
- ◇税率は、個人の受益者については原則20.315% (所得税15.315%、地方税5%) です。ただし、外国税額控除の適用となった場合には、軽減される場合があります。
- ◇税法が改正された場合等には、上記内容が変更になる場合もあります。

## ■分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項目	第41期
	2025年9月23日～2026年3月23日
当期分配金	2,115
(対基準価額比率)	15.426
当期の収益	1,386
当期の収益以外	728
翌期繰越分配対象額	3,598

- (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(税引前)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(税引前)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。

# 日本株計量運用 ポートフォリオ・ マザーファンド

## 親投資信託

第27期(決算日2026年3月23日)

作成対象期間：2025年3月22日～2026年3月23日

## 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

法令・諸規則に基づき、親投資信託(マザーファンド)の期中の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。

## 本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	親投資信託
信託期間	原則として無期限
運用方針	国内の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。計量分析を通じた投資対象のリターン予測を行うと同時に、ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数)(配当込み))に対するポートフォリオのリターン・リスク特性の最適化プロセスを経ることによってリスク管理し、安定的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。個別銘柄の選択は、独自開発の計量モデルを使用します。
主要投資対象	日本の上場株式
組入制限	株式の組入比率は原則としてフル・インベストメントとします。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
23期(2022年3月22日)	24,814	1.5	3,087.43	△0.8	97.4	11,879
24期(2023年3月20日)	25,608	3.2	3,164.37	2.5	95.8	8,221
25期(2024年3月21日)	40,107	56.6	4,702.41	48.6	89.8	12,187
26期(2025年3月21日)	41,508	3.5	4,826.67	2.6	93.7	12,003
27期(2026年3月23日)	57,982	39.7	6,149.83	27.4	83.1	16,626

(注) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

## ■当期中の基準価額と市況推移

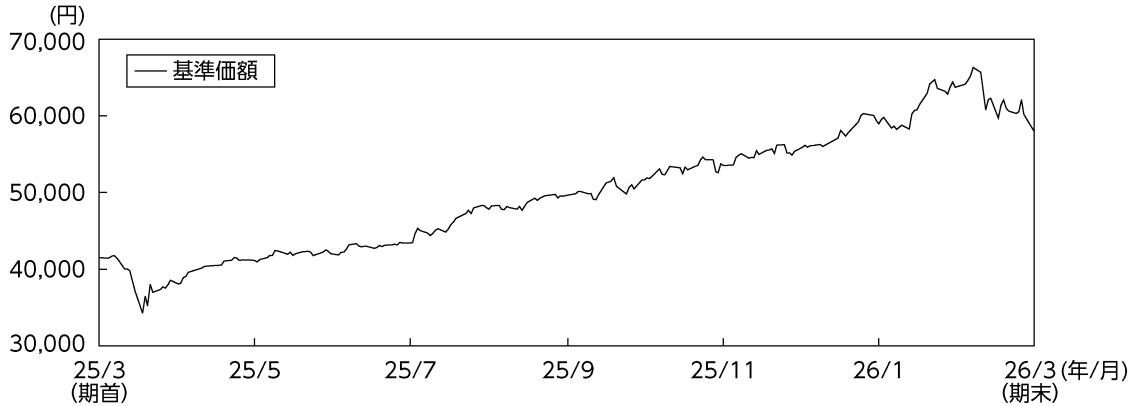
年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率
		騰落率		騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2025年3月21日	41,508	—	4,826.67	—	93.7
3月末	40,028	△3.6	4,626.52	△4.1	97.5
4月末	40,106	△3.4	4,641.96	△3.8	97.1
5月末	42,364	2.1	4,878.83	1.1	97.8
6月末	43,322	4.4	4,974.53	3.1	97.9
7月末	45,059	8.6	5,132.22	6.3	98.2
8月末	48,028	15.7	5,363.98	11.1	98.0
9月末	49,852	20.1	5,523.68	14.4	97.1
10月末	53,393	28.6	5,865.99	21.5	97.5
11月末	55,064	32.7	5,949.55	23.3	97.8
12月末	55,993	34.9	6,010.98	24.5	97.8
2026年1月末	58,765	41.6	6,288.77	30.3	98.0
2月末	66,301	59.7	6,947.17	43.9	98.2
(期末)					
2026年3月23日	57,982	39.7	6,149.83	27.4	83.1

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

## 運用経過

## ■ 基準価額の推移について（2025年3月22日～2026年3月23日）



## ■ 基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の41,508円から16,474円上昇し、期末には57,982円となりました。

上昇要因

銘柄選択の4つの投資テーマすべてがプラス寄与となったことや当期の日本株式市場が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

運用上、特筆すべきものはございません。

## ■投資環境について

当期の日本株式市場は上昇しました。

2025年3月下旬から4月にかけて、米国の相互関税導入を受けて大幅な下落を記録しました。5月は、企業決算の発表時期を迎え、業績に基づいた個別銘柄の選別が進む時期となりました。6月は、株主総会シーズンに伴い、企業の資本効率改善やガバナンス改革への関心が改めて高まりました。7月は、市場の材料が乏しくなるなか、TOPIX（東証株価指数）改革を見据えた企業の動きが注視されました。8月は、取引が細る「夏枯れ」の様相を呈し、市場の動きは限定的となりました。9月は、月半ばから連日で史上最高値を更新するなど、上昇基調で推移しました。10月は、市場の関心が関税リスクから期待成長へとシフトし、PER（株価収益率）の上限を試す展開となりました。11月は、中間決算において約4割の企業が上方修正したことが、市場の強いファンダメンタルズを再確認させました。12月は、先物市場で2026年3月限への乗り換えが進むなか、デフレ脱却への期待が相場を下支えしました。2026年1月は、半導体関連株が米国市場と連動して大きく変動し、日本政府の政策期待も相まって指数は大きく上昇しました。2月は、高市首相の総選挙勝利と大規模な財政出動への期待から、月間10.5%という極めて高いリターンを記録しました。3月に入ると、イスラエル・米国によるイラン攻撃を受け原油価格が高騰したことから、リスクオフの動きとなりました。

## ■ポートフォリオについて

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）との連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益を安定的に獲得することをめざしました。また、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて銘柄選択を行うことにより、安定した付加価値の獲得を追求しました。

### ■ベンチマークとの差異について

当期の本ファンドのパフォーマンスは+39.7%となり、ベンチマーク（+27.4%）を上回りました。

当運用では、財務諸表などの伝統的なデータに加え、ニュース記事やウェブ・アクセス量などの非伝統的データも活用し、4つの投資テーマを通じた多面的な評価基準に基づいて投資対象銘柄の評価を行います。当期は、投資テーマ「テーマおよびトレンド」、「センチメント」、「ファンダメンタル・ミスプライス」、「ハイクオリティ・ビジネス」すべてがプラス寄与となりました。

### 今後の運用方針について

従来通りの運用を継続します。また、個別銘柄のリターン予測モデル、ポートフォリオのリスク管理モデルなどの計量モデルに関する研究・開発は継続的に実施しており、将来のモデル改良への布石としています。

## ■1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2025年3月22日～2026年3月23日		
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	32円 (32) ( 1)	0.065% (0.064) (0.001)	有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
その他費用 (その他)	0 ( 0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 信託事務処理等に要するその他の諸費用
合計	32	0.065	
期中の平均基準価額は49,856円です。			

(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は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。

## ■売買及び取引の状況(2025年3月22日から2026年3月23日まで)

## (1)株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		9,933	22,134,052	10,391	23,712,594
		(499)	(一)		

(注1) 金額は受渡し代金。

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

## (2)先物取引の銘柄別取引状況

			買 建		売 建	
			新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株式先物取引	T O P I X	百万円 9,573	百万円 9,587	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受渡し代金。

### ■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	45,846,647千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	13,515,226千円
(c) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	3.39

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

### ■主要な売買銘柄(2025年3月22日から2026年3月23日まで)

株 式

当 期							
買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ソニーグループ	98	377,556	3,852	三菱商事	85.9	369,359	4,299
三菱商事	106.3	317,910	2,990	三菱重工業	96.6	334,513	3,462
東京エレクトロン	11.8	314,742	26,673	日立製作所	75.9	333,005	4,387
SOMPOホールディングス	64.4	314,036	4,876	トヨタ自動車	93.8	286,200	3,051
HOYA	13.1	298,579	22,792	東京エレクトロン	10.3	272,612	26,467
富士通	76.5	293,084	3,831	コナミグループ	12.6	269,734	21,407
日本たばこ産業	57.8	274,852	4,755	キーエンス	4.2	238,274	56,731
三井不動産	175.2	271,235	1,548	ファーストリテイリング	4.4	234,431	53,279
三菱重工業	64.8	264,229	4,077	武田薬品工業	40.5	226,076	5,582
東海旅客鉄道	71.4	260,114	3,643	信越化学工業	43.9	221,333	5,041

(注) 金額は受渡し代金。

### ■利害関係人との取引状況等(2025年3月22日から2026年3月23日まで)

利害関係人との取引はありません。

(注) 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(2026年3月23日現在)

## (1) 国内株式

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.3%)</b>			
U m i o s	1.4	—	—
ホクト	—	22	41,668
<b>建設業(3.3%)</b>			
安藤・間	29.3	—	—
東建コーポレーション	1.4	—	—
オリエンタル白石	66.1	—	—
大成建設	—	5.2	80,938
大林組	68.2	30.6	112,822
清水建設	—	11.7	32,098
松井建設	—	7.9	12,655
不動テトラ	0.8	—	—
戸田建設	12.1	12.1	17,424
ピーエス・コンストラクション	24.3	—	—
東亜建設工業	18.3	—	—
世紀東急工業	—	17.5	26,827
住友林業	—	27	37,665
大和ハウス工業	—	6.6	33,316
積水ハウス	40.4	—	—
ユアテック	4.4	—	—
中電工	12.9	12.5	56,000
きんでん	6	—	—
トーエネック	—	3.3	6,345
太平電業	1.1	—	—
高砂熱学工業	—	3.5	15,417
大気社	—	9.1	30,348
<b>食料品(3.2%)</b>			
中部飼料	—	35.4	60,746
フィード・ワン	4.2	—	—
井村屋グループ	—	1.7	4,085
亀田製菓	1.2	—	—
丸大食品	—	31.3	69,955

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	31.8	12.5	29,875
サントリー食品インターナショナル	7.5	—	—
Jーオイルミルズ	0.6	—	—
キッコーマン	19.1	—	—
味の素	—	10.2	42,595
アリアケジャパン	0.9	—	—
日本たばこ産業	19.5	41.9	238,536
ケンコーマヨネーズ	7.3	—	—
理研ビタミン	8	—	—
<b>繊維製品(0.8%)</b>			
グンゼ	1	—	—
ユニチカ	—	11.4	15,127
シキボウ	—	20.2	21,553
日本毛織	—	2.6	4,599
帝人	3.2	—	—
小松マテーレ	—	67.4	53,515
ワールド	—	2.8	3,978
ルックホールディングス	—	2.6	6,245
<b>化学(5.5%)</b>			
旭化成	—	18.3	26,983
レゾナック・ホールディングス	—	1.5	15,630
住友化学	—	114	52,326
住友精化	3	—	—
日産化学	—	6.1	36,099
石原産業	—	5.3	14,999
東ソー	—	4.4	10,012
セントラル硝子	—	3.5	13,475
信越化学工業	1.8	—	—
堺化学工業	—	15.7	54,479
日本酸素ホールディングス	—	7.9	45,985
日本触媒	16.5	—	—
大日精化工業	2	—	—

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱ケミカルグループ	116.4	—	—
日本ゼオン	—	7.6	13,436
UBE	—	13.3	32,252
リケンテクノス	—	21.8	35,948
ダイキョーニシカワ	—	8.6	7,120
日本化薬	6.5	—	—
日油	16.1	—	—
花王	—	22.7	136,313
日本ペイントホールディングス	—	21.4	20,772
藤倉化成	43	43	43,258
D I C	1.8	—	—
富士フイルムホールディングス	9.5	43.1	124,623
ライオン	7.2	8.8	14,040
長谷川香料	2.5	—	—
デクセリアルズ	—	8.7	18,696
有沢製作所	13.4	2	4,688
ユニ・チャーム	46.3	45.6	41,395
<b>医薬品 (4.6%)</b>			
武田薬品工業	8	21.9	122,136
アステラス製薬	51.6	86.1	203,282
住友ファーマ	—	12.9	22,826
塩野義製薬	20.6	15.4	50,142
日本新薬	—	4.2	20,689
中外製薬	7	2.8	22,251
科研製薬	4.3	—	—
エーザイ	—	6.7	31,362
小野薬品工業	—	1.8	4,197
持田製薬	—	5.1	17,773
参天製薬	31.9	—	—
ツムラ	—	0.8	2,969
東和薬品	5.6	—	—
第一三共	38.4	46.3	137,094
大塚ホールディングス	10	—	—
サワイグループホールディングス	5.3	—	—

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>石油・石炭製品 (1.8%)</b>			
ENEOSホールディングス	—	139.2	180,055
コスモエネルギーホールディングス	—	15.4	66,851
<b>ゴム製品 (0.1%)</b>			
TOYO TIRE	5.7	3.8	13,539
住友ゴム工業	10	—	—
住友理工	3	—	—
<b>ガラス・土石製品 (2.2%)</b>			
AGC	9.6	23.6	125,316
日本電気硝子	—	4.1	24,366
太平洋セメント	1.9	—	—
アジアパイルホールディングス	15.2	15.5	21,281
東海カーボン	—	5.9	5,363
ノリタケ	2.6	—	—
日本碍子	42.9	35.4	134,236
<b>鉄鋼 (—%)</b>			
神戸製鋼所	13.8	—	—
合同製鐵	3.8	—	—
東京鐵鋼	2.2	—	—
三菱製鋼	9	—	—
<b>非鉄金属 (4.3%)</b>			
J X金属	—	4.1	13,812
日本軽金属ホールディングス	13.4	15.8	40,195
三井金属	4.3	1.3	37,947
三菱マテリアル	—	6.4	30,291
住友金属鉱山	—	7.5	62,790
DOWAホールディングス	—	0.7	6,097
UACJ	—	5.1	10,914
古河電気工業	3	—	—
住友電気工業	50.1	22.4	206,393
フジクラ	2.8	3.4	82,722
SWCC	—	0.5	6,150
平河ヒューテック	—	25.7	97,917
リョービ	5.5	2.1	5,050

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	—	41.7	69,847
川田テクノロジーズ	8.8	—	—
RS Technologies	3.5	—	—
東洋製罐グループホールディングス	4.5	1.5	5,320
リンナイ	—	3.2	11,628
東ブレ	3.3	—	—
東京製綱	2.1	—	—
<b>機械 (5.1%)</b>			
ツガミ	—	15.5	50,530
F U J I	13.5	1.8	8,719
旭ダイヤモンド工業	36.1	—	—
ソディック	30	—	—
ディスコ	—	1.6	104,480
リケンNPR	—	1.2	4,506
タツモ	4	—	—
ナブテスコ	—	2.2	8,943
三井海洋開発	13.9	—	—
レオン自動機	2.4	—	—
日本エアータック	—	4.3	5,160
小松製作所	4.9	0.6	3,569
住友重機械工業	8.1	6.1	29,145
日立建機	4	4.8	24,868
井関農機	—	6.8	10,288
北川鉄工所	—	3.6	5,770
クボタ	27.3	34.5	83,714
新東工業	39.7	—	—
小森コーポレーション	13.7	—	—
椿本チエイン	5.4	—	—
平和	18.9	—	—
SANKYO	3.6	—	—
アマノ	2.1	—	—
グローリー	9.2	—	—
日本精工	—	45.6	50,319

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジェイテクト	—	6.8	11,043
マキタ	—	2.6	13,314
三菱重工業	91.7	59.9	270,568
I H I	—	4.1	14,227
<b>電気機器 (21.5%)</b>			
キオクシアホールディングス	—	1.8	38,637
イビデン	—	3	22,620
ブラザー工業	1.8	25.1	71,924
ミネベアミツミ	—	13.6	34,557
日立製作所	109.1	65.8	315,840
三菱電機	26.4	43.2	222,220
富士電機	2.6	7.8	81,939
デンヨー	—	5	17,325
PHCホールディングス	12	—	—
KOKUSAI ELECTRIC	—	3.6	18,997
芝浦メカトロニクス	1.6	—	—
マブチモーター	—	17.4	27,065
トレックス・セミコンダクター	—	3.8	5,988
東光高岳	3	—	—
大崎電気工業	—	4.6	7,622
オムロン	9.5	—	—
日東工業	—	6.1	25,833
B U F F A L O	4.1	—	—
日本電気	12.5	44.7	175,581
富士通	39.9	70	228,760
ルネサスエレクトロニクス	17.3	48.3	109,930
セイコーエプソン	1.1	5.6	10,813
アルバック	7.7	—	—
日本信号	27	—	—
ホーチキ	1.8	—	—
ソニーグループ	74.8	116.5	371,868
TDK	22.2	93.2	190,361
鈴木	10.5	30.6	81,518
ホシデン	—	5.1	13,606

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヒロセ電機	—	0.8	16,540
TOA	8.2	—	—
マクセル	—	3.7	7,252
横河電機	23.4	—	—
新電元工業	—	3.9	11,934
アズビル	17	—	—
アドバンテスト	—	9.4	213,662
キーエンス	3.7	0.1	5,628
イリソ電子工業	—	1.4	4,634
レーザーテック	0.8	1.1	35,233
山一電機	33	4.7	38,023
ファナック	—	28.5	161,053
ローム	—	10.1	31,330
三井ハイテック	11.8	—	—
村田製作所	33.4	44.6	156,456
双葉電子工業	8.7	—	—
ニチコン	—	7.3	12,884
KOA	—	7.3	10,935
キャノン電子	4	—	—
キャノン	—	21.7	92,724
東京エレクトロン	1.2	2.7	103,410
<b>輸送用機器 (5.2%)</b>			
モリタホールディングス	4.8	—	—
デンソー	—	28.5	53,124
名村造船所	6	—	—
いすゞ自動車	30.4	69.7	158,950
トヨタ自動車	138.9	107.7	350,132
新明和工業	18.2	—	—
ティラド	1.1	—	—
NOK	17.8	14.7	41,968
フタバ産業	—	26.7	25,845
プレス工業	—	50.9	40,974
アイシン	20.1	—	—
本田技研工業	18.3	—	—

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スズキ	33.6	—	—
SUBARU	22.4	17	42,440
<b>精密機器 (2.5%)</b>			
テルモ	—	13.3	27,351
日機装	—	3.4	7,497
島津製作所	—	5.3	19,567
オリンパス	53.3	—	—
タムロン	0.6	—	—
HOYA	4.9	7	190,855
ノーリツ鋼機	2.7	18	36,900
朝日インテック	—	17.1	54,685
セイコーグループ	3.9	1.1	12,331
<b>その他製品 (2.8%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	22.9	—	—
パイロットコーポレーション	—	3.5	16,100
萩原工業	—	3.2	5,318
TOPPANホールディングス	—	0.4	1,812
大日本印刷	12.3	39.4	110,320
共同印刷	2.4	28.8	45,734
アシックス	16	—	—
ヤマハ	—	75.3	82,453
ビジョン	2.8	—	—
リンテック	14.6	—	—
任天堂	10.4	9.8	92,433
ナカバヤシ	—	32.2	18,998
オカムラ	—	6.2	15,394
<b>電気・ガス業 (1.6%)</b>			
中部電力	11.1	—	—
関西電力	7.8	4.7	11,644
北陸電力	21.4	—	—
東北電力	—	10.9	12,240
四国電力	25	25	41,712
九州電力	—	27.2	46,716
東京瓦斯	—	9	63,720

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪瓦斯	—	7.4	45,399
西部ガスホールディングス	2.8	—	—
<b>陸運業 (1.3%)</b>			
東急	59.7	—	—
京王電鉄	3.1	—	—
東海旅客鉄道	15.1	39	160,563
鴻池運輸	—	4.3	12,435
阪急阪神ホールディングス	8	—	—
セイノーホールディングス	8.2	—	—
<b>海運業 (0.1%)</b>			
日本郵船	29.3	—	—
商船三井	4.9	—	—
川崎汽船	32.7	7.4	19,073
<b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b>			
日新	5.3	—	—
上組	—	2.3	12,247
<b>情報・通信業 (4.3%)</b>			
クロスキャット	—	6.3	5,966
日鉄ソリューションズ	5.8	—	—
T I S	4.4	—	—
ブロードリーフ	13.9	—	—
システムリサーチ	2.3	—	—
S R Aホールディングス	5.6	4.2	19,530
朝日ネット	6	—	—
g u m i	23	—	—
オークネット	—	2.1	4,893
野村総合研究所	13.4	—	—
クレスコ	9.8	—	—
オービック	14	—	—
日本オラクル	6.9	—	—
アルファシステムズ	0.7	—	—
T B Sホールディングス	15.4	—	—
日本テレビホールディングス	—	9.4	29,215
スカパーJ S A Tホールディングス	7.6	—	—

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テレビ東京ホールディングス	—	16.4	65,682
N T T	1,096.3	555.3	87,182
K D D I	16.3	26.5	70,596
ソフトバンク	324.6	291.1	62,964
東宝	—	13.5	21,579
D T S	4.3	—	—
スクウェア・エニックス・ホールディングス	—	2	5,014
シーイーシー	15.7	—	—
S C S K	8	—	—
N S W	2.4	—	—
アイネス	1.8	—	—
コナミグループ	4.8	—	—
J B C Cホールディングス	1.7	—	—
ソフトバンクグループ	18.7	65	227,955
<b>卸売業 (6.1%)</b>			
双日	1.6	—	—
ラサ商事	—	6.2	11,780
ラクト・ジャパン	2.7	—	—
明治電機工業	—	2	4,514
ユニソルホールディングス	6	—	—
ヤマエグループホールディングス	—	3.9	10,923
三菱食品	7.8	—	—
メディカルホールディングス	2.1	—	—
S P K	—	4.2	10,437
ドウシシャ	0.9	0.9	3,006
伊藤忠商事	4	35.2	68,974
丸紅	25.5	2.4	12,453
長瀬産業	7.9	—	—
三井物産	5.6	25.6	150,374
カメイ	2.2	—	—
住友商事	26.3	37.9	207,388
内田洋行	1.3	—	—
三菱商事	16	36.4	191,900
第一実業	3.1	3.3	10,510

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西華産業	5.6	—	—
神鋼商事	5.7	21.1	48,424
カナデン	—	2.2	4,562
極東貿易	—	20	37,280
アステナホールディングス	17	28.8	13,363
G S I クレオス	—	3.7	9,002
東邦ホールディングス	7.8	—	—
トーホー	—	15.3	19,431
ヤマタネ	—	3.8	8,234
ジェコス	—	13.6	24,044
<b>小売業(1.2%)</b>			
キャンドウ	—	2	6,390
大黒天物産	1.5	—	—
J. フロント リテイリング	11.3	—	—
物語コーポレーション	—	1.6	7,488
三越伊勢丹ホールディングス	25.5	—	—
綿半ホールディングス	—	2.2	3,106
セブン&アイ・ホールディングス	31.8	—	—
ツルハホールディングス	2.5	—	—
ノジマ	—	25.1	26,806
エコス	0.8	—	—
サイゼリヤ	2	—	—
V T ホールディングス	15.3	—	—
スギホールディングス	3	—	—
ライフコーポレーション	4.8	—	—
高島屋	28.8	—	—
エイチ・ツー・オー リテイリング	9.8	—	—
ケーズホールディングス	—	27.6	44,173
ヤマダホールディングス	16.4	—	—
ケーユーホールディングス	18.7	—	—
パローホールディングス	—	1.4	4,921
ファーストリテイリング	0.6	1.1	68,013
<b>銀行業(9.5%)</b>			
いよぎんホールディングス	14.1	—	—

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
しずおかフィナンシャルグループ	26.2	—	—
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	20.1	39.2	107,192
京都フィナンシャルグループ	1.6	—	—
めぶきフィナンシャルグループ	—	46.6	53,823
富山第一銀行	1.2	2.2	5,231
横浜フィナンシャルグループ	—	105.6	140,764
西日本フィナンシャルホールディングス	—	4.9	18,291
三菱UFJフィナンシャル・グループ	109.6	122.9	315,177
三井住友トラストグループ	41	—	—
三井住友フィナンシャルグループ	43.5	43.5	217,891
千葉銀行	—	21.9	42,661
群馬銀行	—	3.7	7,533
七十七銀行	—	1.2	10,527
ふくおかフィナンシャルグループ	—	16.5	97,267
スルガ銀行	5.4	—	—
八十二長野銀行	7.3	17	33,209
滋賀銀行	—	0.2	1,666
ほくほくフィナンシャルグループ	1.2	—	—
山陰合同銀行	—	9.3	15,000
百十四銀行	3.7	—	—
大分銀行	4.3	—	—
宮崎銀行	6.9	5.8	50,808
佐賀銀行	5	—	—
みずほフィナンシャルグループ	9.6	23.4	138,738
山口フィナンシャルグループ	—	9.5	22,614
名古屋銀行	—	3.4	17,544
北日本銀行	—	1.2	5,304
トモニホールディングス	—	7.2	5,925
<b>証券、商品先物取引業(1.8%)</b>			
S B I ホールディングス	34.4	—	—
大和証券グループ本社	105.1	95.5	139,955
野村ホールディングス	86.8	47	57,034
丸三証券	12.5	—	—
岩井コスモホールディングス	—	12.9	46,762

銘柄	前期末	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>保険業 (2.5%)</b>			
SOMPOホールディングス	8.1	38.8	218,870
MS&ADインシュアランスグループホール	58.4	—	—
ソニーフィナンシャルグループ	—	217.5	31,254
第一生命ホールディングス	27.2	—	—
東京海上ホールディングス	25.1	15.7	91,954
T&Dホールディングス	6.3	—	—
<b>その他金融業 (2.4%)</b>			
クレディセゾン	4.2	5	20,215
東京センチュリー	—	9.5	19,308
アコム	24.2	—	—
オリックス	51.3	48	218,976
三菱HCキャピタル	8.3	—	—
日本取引所グループ	—	36.9	67,434
<b>不動産業 (3.7%)</b>			
大東建託	—	32.8	113,225
ヒューリック	15.5	—	—
東急不動産ホールディングス	3.8	—	—
三井不動産	—	121.6	204,896
三菱地所	—	22.8	97,994
住友不動産	—	21.2	92,092
<b>サービス業 (1.6%)</b>			
E・Jホールディングス	2	—	—
オープンアップグループ	4.1	—	—
コシダカホールディングス	8	—	—
カカクコム	8.8	—	—
ディー・エヌ・エー	9.5	—	—

銘柄	前期末	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ユー・エス・エス	—	5.5	9,039	
楽天グループ	96	—	—	
セントラルスポーツ	—	4	9,508	
ジャパンマテリアル	—	3.9	6,306	
リクルートホールディングス	22	13.4	84,567	
エラン	5.6	—	—	
日本郵政	59.9	—	—	
エアトリ	7.8	—	—	
キュービネットホールディングス	—	14.7	19,271	
カープスホールディングス	6.6	—	—	
東祥	20.5	4	3,320	
TREホールディングス	10.6	—	—	
エイチ・アイ・エス	3.6	3.7	3,785	
ラックランド	—	15.4	23,177	
共立メンテナンス	—	12.4	29,741	
スペース	—	8	12,000	
トランス・コスモス	4.1	—	—	
藤田観光	2.2	7.6	14,759	
セコム	24.7	—	—	
丹青社	37.6	—	—	
合計	株 数 ・ 金 額	5,682	5,723	13,811,221
	銘柄数<比率>	266	248	<83.1%>

(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。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) -印は組入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

国	銘柄別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	T O P I X	百万円 172	百万円 —

(注) -印は組入れなし。

## ■投資信託財産の構成

2026年3月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	13,811,221	82.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,903,069	17.4
投 資 信 託 財 産 総 額	16,714,290	100.0

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2026年3月23日
(A) 資 産	16,714,290,758円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	365,545,522
株 式 ( 評 価 額 )	13,811,221,140
未 収 入 金	2,493,638,810
未 収 配 当 金	23,462,050
未 収 利 息	6,351
差 入 委 託 証 拠 金	20,416,885
(B) 負 債	87,781,291
前 受 金	2,997
未 払 金	39,542,624
未 払 解 約 金	48,235,670
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	16,626,509,467
元 本	2,867,552,379
次 期 繰 越 損 益 金	13,758,957,088
(D) 受 益 権 総 口 数	2,867,552,379口
1万口当たり基準価額 (C/D)	57,982円

## ■損益の状況

項 目	当 期
	自2025年3月22日 至2026年3月23日
(A) 配 当 等 収 益	347,883,227円
受 取 配 当 金	346,486,223
受 取 利 息	1,381,150
そ の 他 収 益 金	15,854
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,146,332,277
売 買 益	5,151,367,151
売 買 損	△ 1,005,034,874
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	48,147,587
取 引 益	120,199,020
取 引 損	△ 72,051,433
(D) そ の 他 費 用 等	△ 11,655
(E) 当 期 損 益 金 ( A + B + C + D )	4,542,351,436
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	9,111,575,616
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,611,457,390
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 4,506,427,354
(I) 計 ( E + F + G + H )	13,758,957,088
次 期 繰 越 損 益 金 ( I )	13,758,957,088

- (注1) 損益の状況の中で (B) 有価証券売買損益および (C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) 損益の状況の中で (G) 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引いた差額分をいいます。
- (注3) 損益の状況の中で (H) 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引いた差額分をいいます。
- (注4) 期首元本額は2,891,796,891円、当作成期間中において、追加設定元本額は1,101,373,984円、同解約元本額は1,125,618,496円です。
- (注5) 元本の内訳
- |                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| G S 日本株式インデックス・プラス             | 2,264,344,387円 |
| V Aインデックス・プラスRH日本株計量運用ポートフォリオ  | 489,925,371円   |
| グローバル・ダイバーシファイドV A (適格機関投資家専用) | 113,282,621円   |

## 〈お知らせ〉

約款変更について

- 投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、運用報告書にかかる記載変更を行いました。