

投資家の皆さまへ

SOMPOアセットマネジメント株式会社

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）
運用報告書（全体版）第1期の記載内容の一部訂正とお詫び

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、表題ファンドについて、運用報告書（全体版）第1期（2022年9月30日決算）の記載内容の一部に誤りがございましたのでお知らせいたします。誤記載の内容は下記の通りとなります。本件は表題ファンドの運用方針および基準価額や分配金等をはじめとする運用状況に影響を生じさせるものではございません。

なお、投資家の皆さまに交付いたしました交付運用報告書には、今回の誤記載に関する項目が掲載されておらず、訂正はございません。

また、次回の運用報告書（全体版）にて再度お知らせをさせていただく予定です。今回のような不手際につきましては、誠に申し訳なく深くお詫び申し上げます。

正誤表

●**運用報告書（全体版）**

該当箇所：＜○**自社による当ファンドの設定・解約状況**＞（9頁）の表

対象決算期：第1期決算（2022年9月30日）

※点線で囲ったところが正誤箇所

（正）

＜○**自社による当ファンドの設定・解約状況**＞

○**自社による当ファンドの設定・解約状況**

（2021年9月30日～2022年9月30日）

設定時残高 （元本）	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 （元本）	取引の理由
万円 6,000	万円 -	万円 5,000	万円 1,000	当初設定時における取得とその処分

（誤）

＜○**自社による当ファンドの設定・解約状況**＞

○**自社による当ファンドの設定・解約状況**

（2021年9月30日～2022年9月30日）

設定時残高 （元本）	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 （元本）	取引の理由
万円 1,000	万円 -	万円 -	万円 1,000	当初設定時における取得

[本件に関するお問い合わせ先]

SOMPOアセットマネジメント株式会社 リテール営業部

電話番号 0120-69-5432（受付時間：平日※の午前9時～午後5時）

※土曜、日曜、祝日、振替休日、国民の休日を除いた日

以上

SOMPOアルジェブリス・ グローバル金融株式ファンド （円ヘッジなし）

第1期（決算日 2022年9月30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／内外／株式	
信託期間	2021年9月30日から2031年9月30日まで	
運用方針	<p>①SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド（以下「親投資信託」といいます。）受益証券を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>②親投資信託の組入比率は、原則として高位を基本とします。</p> <p>③親投資信託における株式等の運用指図に関する権限をアルジェブリス・インベストメンツ（US）インクに委託します。</p> <p>④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p>	
主要投資対象	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド受益証券
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式
主な組入制限	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準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。</p>	

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）」は、このたび第1期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			株組入比率	式率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税金	分配	騰落率				
(設定日)	円		円	%			百万円	
2021年9月30日	10,000		—	—	—	—	81	
1期(2022年9月30日)	11,288		0	12.9	76.1	0.7	577	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり（以下同じ）。

(注3) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額			株組入比率	式率	投資信託証券組入比率
		騰落	騰落率	騰落率			
(設定日)	円		%		%		%
2021年9月30日	10,000		—	—	—	—	—
10月末	10,418		4.2		84.9		—
11月末	9,811		△ 1.9		82.6		—
12月末	10,327		3.3		83.1		—
2022年1月末	10,899		9.0		80.1		—
2月末	10,953		9.5		77.6		0.9
3月末	11,189		11.9		78.1		0.6
4月末	10,788		7.9		85.0		0.5
5月末	11,744		17.4		81.7		0.8
6月末	11,202		12.0		80.9		1.1
7月末	11,078		10.8		79.6		—
8月末	11,486		14.9		80.9		—
(期末)							
2022年9月30日	11,288		12.9		76.1		0.7

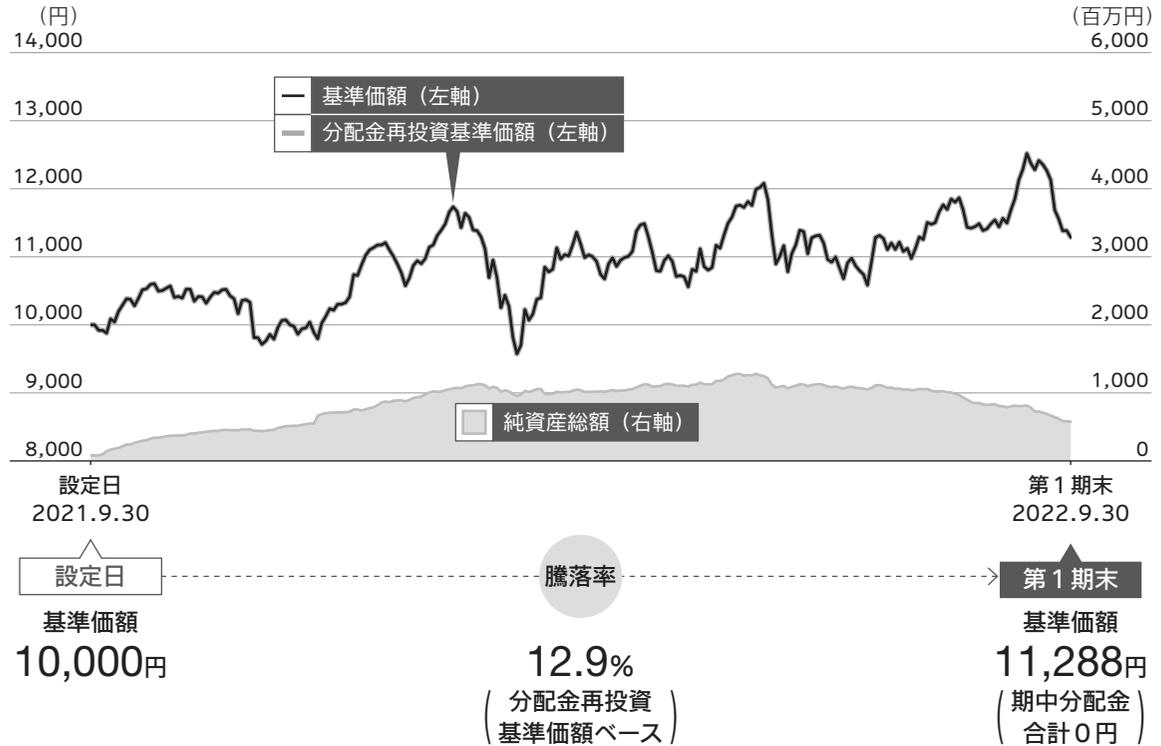
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。

(注2) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 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。
- 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、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）

当期は、投資しているSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドが上昇したことにより、当ファンドの基準価額も上昇しました。

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

期中の騰落率は+15.4%となりました。

円安が進行したことなどがプラスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

● 投資環境

○株式市場

米国をはじめ各国が金融緩和から金融引き締めへと舵を切る中、特にFRB（米連邦準備理事会）が利上げを開始した2022年3月以降、株価は軟調に推移しました。

夏場には、インフレがピークアウトするとの期待などを背景に、一時的に回復した局面もありました。しかし、8月のジャクソンホール会議の講演において、パウエルFRB議長が高い政策金利の長期化を示唆するなど、景気後退懸念を背景に期待が高まっていた早期の金融政策転換を牽制するとともに、高止まりするインフレの抑制が最優先課題であることを改めて示したことなどにより、再び株価は下落しました。

○為替市場

円は期初において、比較的安定した動きであったものの、2022年3月以降、徐々に各国がインフレへの警戒を強めて金融引き締めへと舵を切る中、日銀は金融緩和姿勢を維持したため、海外と日本の金融政策の格差が意識され、各国通貨に対して総じて円安が進行しました。

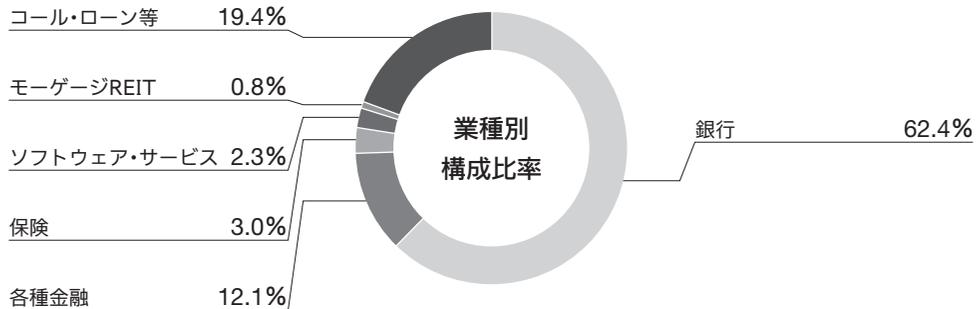
また、資源価格の上昇に伴い、日本の貿易赤字が拡大するとの見方も円安要因となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通してSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

期を通して株式の組入比率を高位に維持しました。



注1. 比率は、第1期末における純資産総額に対する割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比率が100%にならない場合があります。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳（単位：円、1万口当たり・税引前）

項目	第1期 2021.9.30~2022.9.30
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,287

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. 円未満は切り捨てており、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。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

● 今後の運用方針

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）

今後も、SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

引き続き、世界の景気回復局面などにおいて良好なパフォーマンスが期待される世界の金融セクターの株式に分散投資を行います。今後の金融引き締めによる利上げは、金融機関にとって好ましい収益環境になると考えています。また、新型コロナウイルス感染拡大による業績悪化への懸念から制限されてきた「自社株買い」や「配当（米国では増配）」が再開されていること、フリーキャッシュフローの増加や割安な株価、コスト削減効果の継続が想定されることなど、金融株式には引き続き魅力的な投資機会が存在していると考えています。

● 1万口当たりの費用明細

項目	第1期 2021.9.30~2022.9.30		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	216円	1.996%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率（年率） × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,824円です。
（投信会社）	(127)	(1.169)	ファンドの運用の対価
（販売会社）	(86)	(0.794)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(4)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	33	0.305	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(32)	(0.299)	
（投資信託証券）	(1)	(0.006)	
(c) 有価証券取引税	45	0.417	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(45)	(0.417)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	95	0.874	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（保管費用）	(91)	(0.844)	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
（監査費用）	(2)	(0.015)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	(2)	(0.014)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	389	3.592	

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、有価証券取引税およびその他費用は、この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、このファンドに対応するものを含みます。

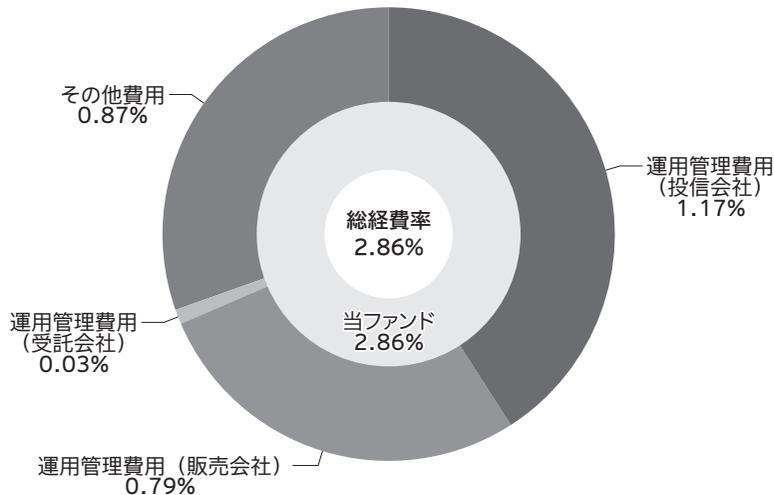
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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2.86%**です。



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

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料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. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 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

(2021年9月30日～2022年9月30日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	1,133,253 千口	1,200,200 千円	656,027 千口	773,130 千円

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2021年9月30日～2022年9月30日)

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
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,730,624千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	710,117千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.66

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月30日～2022年9月30日)

該当事項はございません。

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

(2021年9月30日～2022年9月30日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取引の理由
万円 1,000	万円 -	万円 -	万円 1,000	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2022年9月30日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド		477,225	550,623

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入はありません。

○投資信託財産の構成

(2022年9月30日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	550,623	88.7
コール・ローン等、その他	69,845	11.3
投資信託財産総額	620,468	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産（564,181千円）の投資信託財産総額（580,080千円）に対する比率は、97.3%です。

(注3) 外貨建資産は、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。

なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.81円、1カナダ・ドル=105.80円、1ユーロ=142.32円、1イギリス・ポンド=161.72円、1スウェーデン・クローナ=13.00円、1香港・ドル=18.45円、1韓国・ウォン=0.1012円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年9月30日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	620,468,078
コール・ローン等	49,844,858
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド(評価額)	550,623,220
未収入金	20,000,000
(B) 負債	42,865,581
未払解約金	32,422,272
未払信託報酬	10,365,208
未払利息	150
その他未払費用	77,951
(C) 純資産総額(A-B)	577,602,497
元本	511,700,353
次期繰越損益金	65,902,144
(D) 受益権総口数	511,700,353口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,288円

(注1) 信託財産に係る期首元本額81,420,000円、期中追加設定元本額1,363,552,930円、期中一部解約元本額933,272,577円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.1288円

○損益の状況（2021年9月30日～2022年9月30日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 16,354
支払利息	△ 16,354
(B) 有価証券売買損益	48,102,706
売買益	107,082,422
売買損	△ 58,979,716
(C) 信託報酬等	△ 17,201,451
(D) 当期損益金(A+B+C)	30,884,901
(E) 追加信託差損益金	35,017,243
(配当等相当額)	(△ 6,505)
(売買損益相当額)	(35,023,748)
(F) 計(D+E)	65,902,144
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	65,902,144
追加信託差損益金	35,017,243
(配当等相当額)	(2,920,162)
(売買損益相当額)	(32,097,081)
分配準備積立金	30,884,901

(注1) 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) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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4) SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の72の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程（2021年9月30日～2022年9月30日）は以下の通りです。

項 目	2021年9月30日～ 2022年9月30日
a. 配当等収益(費用控除後)	12,403,357円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	18,481,544円
c. 信託約款に規定する収益調整金	35,017,243円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	65,902,144円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,287円
g. 分配金	0円

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式 マザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2022年9月30日）

<計算期間 2021年9月30日～2022年9月30日>

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの第1期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。

信託期間	無期限
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。
主要投資対象	日本を含む世界の金融機関の株式
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	純 資 産 額			
(設定日)	円	%	%	%	百万円
2021年9月30日	10,000	—	—	—	78
1期(2022年9月30日)	11,538	15.4	79.8	0.8	550

(注1) 基準価額は1万口当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 組 入 比	式 率	投 証 組 入 比	信 託 券 率
		騰	落				
(設定日)	円		%		%		%
2021年9月30日	10,000		—		—		—
10月末	10,490		4.9		87.6		—
11月末	9,865	△	1.4		85.1		—
12月末	10,407		4.1		85.7		—
2022年1月末	11,017		10.2		82.6		—
2月末	11,084		10.8		80.6		0.9
3月末	11,339		13.4		81.1		0.6
4月末	10,921		9.2		87.8		0.6
5月末	11,950		19.5		84.5		0.8
6月末	11,422		14.2		83.4		1.1
7月末	11,303		13.0		81.6		—
8月末	11,739		17.4		81.2		—
(期 末)							
2022年9月30日	11,538		15.4		79.8		0.8

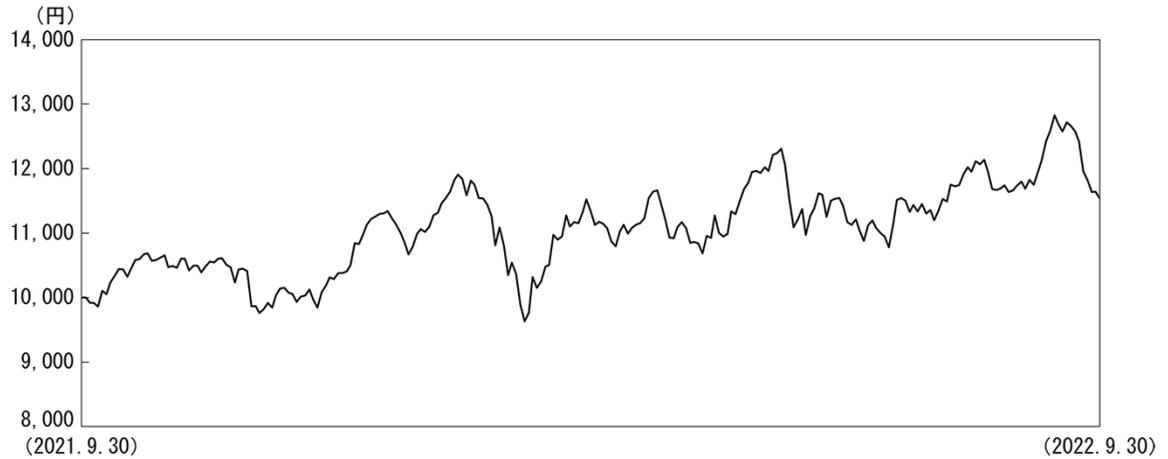
(注1) 騰落率は設定日比。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

○運用経過

(2021年9月30日～2022年9月30日)

■基準価額の推移



設定日：10,000円
期末：11,538円
騰落率：15.4%

P 2～P 6をご参照下さい。

○1万口当たりの費用明細

(2021年9月30日~2022年9月30日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	35	0.315	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(34)	(0.309)	
(投資信託証券)	(1)	(0.006)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	47	0.430	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(47)	(0.430)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	97	0.885	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 信託事務の処理にかかるその他の費用等
(保 管 費 用)	(96)	(0.871)	
(そ の 他)	(1)	(0.014)	
合 計	179	1.630	
期中の平均基準価額は10,961円です。			

(注1) 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2) 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

(2021年9月30日～2022年9月30日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 31	千円 28,469	千株 31	千円 29,390
外 国	アメリカ	百株 3,217 (2)	千アメリカ・ドル 9,234 (-)	百株 2,762	千アメリカ・ドル 7,519
	カナダ	232	千カナダ・ドル 506	232	千カナダ・ドル 491
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,218	964	971	820
	イタリア	4,983	1,683	4,321	1,369
	フランス	598	1,531	522	1,228
	オランダ	510	547	367	362
	スペイン	8,758	1,213	7,137	989
	アイルランド	1,900	639	1,566	607
	イギリス	11,269	千イギリス・ポンド 1,667	8,940 (32)	千イギリス・ポンド 1,442 (-)
	スイス	256 (-)	千スイス・フラン 560 (△ 4)	256	千スイス・フラン 566
	スウェーデン	207	千スウェーデン・クローナ 2,735	179	千スウェーデン・クローナ 2,319
	香港	803	千香港・ドル 1,702	752	千香港・ドル 1,384
	韓国	114	千韓国・ウォン 567,354	51	千韓国・ウォン 241,009

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()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。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千アメリカ・ドル	口	千アメリカ・ドル
	SIMON PROPERTY GROUP INC	567	55	567	60
	AGNC INVESTMENT CORP	14,194	167	10,765	131
小 計		14,761	222	11,332	191

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2021年9月30日～2022年9月30日)

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	4,730,624千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	710,117千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	6.66

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月30日～2022年9月30日)

該当事項はございません。

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項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年9月30日現在)

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	千アメリカ・ドル	千円	
AMERICAN INTERNATIONAL GP		10	48	7,053	保険
SLM CORP		16	22	3,289	各種金融
JP MORGAN CHASE & CO		13	145	21,091	銀行
COMERICA INC		9	67	9,816	銀行
BANK OF AMERICA CORP		25	78	11,357	銀行
CITIGROUP INC		11	48	6,997	銀行
WELLS FARGO COMPANY		28	113	16,456	銀行
FIDELITY NATIONAL INFO SERV		3	24	3,537	ソフトウェア・サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP		20	93	13,516	銀行
LAZARD LTD-CL A		2	8	1,185	各種金融
KKR & CO INC		9	39	5,649	各種金融
SCULPTOR CAPITAL MANAGEMENT		34	30	4,365	各種金融
Q2 HOLDINGS INC		19	63	9,247	ソフトウェア・サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC		39	104	15,198	各種金融
CADENCE BANK		24	62	8,993	銀行
GUILD HOLDINGS CO - CLASS A		24	23	3,341	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP		28	96	13,999	銀行
FIRST BANCSHARES INC/MS		15	45	6,620	銀行
FIFTH THIRD BANCORP		20	64	9,379	銀行
HANCOCK WHITNEY CORP		7	35	5,183	銀行
POPULAR INC		7	56	8,142	銀行
SEACOAST BANKING CORP/FL		6	19	2,800	銀行
CARLYLE GROUP INC/THE		40	107	15,571	各種金融
PERELLA WEINBERG PARTNERS		21	13	1,970	各種金融
JAMES RIVER GROUP HOLDINGS L		17	41	5,953	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	457	1,455	210,721	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	-	< 38.3% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		155	118	16,849	各種金融
COMMERZBANK AG		91	65	9,375	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	247	184	26,224	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	-	< 4.8% >	
(ユーロ…イタリア)					
BPER BANCA		318	49	7,058	銀行
BFF BANK SPA		27	17	2,550	各種金融
BANCO BPM SPA		226	59	8,514	銀行
UNICREDIT SPA EUR		89	91	12,957	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	662	218	31,080	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	-	< 5.6% >	
(ユーロ…フランス)					
SOCIETE GENERALE-A		51	104	14,870	銀行
BNP PARIBAS		23	101	14,425	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	75	205	29,296	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	-	< 5.3% >	

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ) ING GROEP N.V.	百株 143	千ユーロ 123	千円 17,599	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	143 1	123 — <3.2%>	
(ユーロ…スペイン) BANCO SANTANDER SA BANCO DE SABADELL SA	774 846	184 58	26,260 8,303	銀行 銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,621 2	242 — <6.3%>	
(ユーロ…アイルランド) BANK OF IRELAND GROUP PLC AIB GROUP PLC	122 211	76 49	10,908 7,007	銀行 銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	334 2	125 — <3.3%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,084 13	1,100 — <28.5%>	
(イギリス) STANDARD CHARTERED PLC GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC BARCLAYS PLC NATWEST GROUP PLC	63 1,277 691 265	千イギリス・ポンド 35 51 100 58	5,688 8,408 16,175 9,482	銀行 銀行 銀行 銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,296 4	245 — <7.2%>	
(スウェーデン) NORDEA BANK	28	千スウェーデン・クローナ 265	3,456	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	28 1	265 — <0.6%>	
(香港) PING AN INSURANCE GROUP CO-H	51	千香港・ドル 196	3,618	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	51 1	196 — <0.7%>	
(韓国) HANA FINANCIAL GROUP INC KB FINANCIAL GROUP INC	35 27	千韓国・ウォン 127,786 122,351	12,931 12,381	銀行 銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	62 2	250,137 — <4.6%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,980 46	— — <79.8%>	

(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) 邦貨換算金額の〈 〉内は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。

外国投資信託証券

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) AGNC INVESTMENT CORP	口	千アメリカ・ドル	千円	%
	3,429	29	4,310	0.8
合計	口数・金額	29	4,310	
	銘柄数 < 比率 >	1	< 0.8% >	

(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) 比率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。

○投資信託財産の構成

(2022年9月30日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	439,546	75.8
投資証券	4,310	0.7
コール・ローン等、その他	136,224	23.5
投資信託財産総額	580,080	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純資産（564,181千円）の投資信託財産総額（580,080千円）に対する比率は、97.3%です。

(注3) 外貨建資産は、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。

なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.81円、1カナダ・ドル=105.80円、1ユーロ=142.32円、1イギリス・ポンド=161.72円、1スウェーデン・クローナ=13.00円、1香港・ドル=18.45円、1韓国・ウォン=0.1012円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月30日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	580,080,445
コール・ローン等	96,607,896
株式(評価額)	439,546,668
投資証券(評価額)	4,310,084
未収入金	38,969,866
未収配当金	645,931
(B) 負債	29,436,862
未払金	9,436,597
未払解約金	20,000,000
未払利息	19
その他未払費用	246
(C) 純資産総額(A-B)	550,643,583
元本	477,225,880
次期繰越損益金	73,417,703
(D) 受益権総口数	477,225,880口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,538円

(注1) 信託財産に係る期首元本額78,970,000円、期中追加設定元本額1,054,283,403円、期中一部解約元本額656,027,523円

(注2) 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ごとの元本の内訳

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式会社マザーファンド(円ヘッジなし) 477,225,880円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.1538円

○損益の状況 (2021年9月30日～2022年9月30日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	28,719,406
受取配当金	28,732,041
その他収益金	6,580
支払利息	△ 19,215
(B) 有価証券売買損益	101,934,260
売買益	294,448,630
売買損	△192,514,370
(C) 保管費用等	△ 7,080,083
(D) 当期損益金(A+B+C)	123,573,583
(E) 追加信託差損益金	66,946,597
(F) 解約差損益金	△117,102,477
(G) 計(D+E+F)	73,417,703
次期繰越損益金(G)	73,417,703

(注1) 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) 追加信託差損益金とは、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) 解約差損益金とは、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。