

ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略 ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

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	
信託期間	2027年5月28日まで(設定日:2017年5月22日)	
決算日	3月20日および9月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)	
運用方針	<p>①米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド受益証券(以下「親投資信託」といいます。)への投資を通じて、主として、米国の小型株式に投資し、信託財産の成長を図ることを目標として積極的な運用を行います。</p> <p>②主として、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルを活用しながら、企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。</p> <p>【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)】</p> <p>③実質外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。</p> <p>【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)】</p> <p>③実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④親投資信託の受益証券を通じて、効率的な運用や組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等へ投資する場合があります。</p> <p>⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ、エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に外国株式等(短期金融商品を含みます。)にかかる運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>	
主要投資対象	子投資信託	【ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)】 親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
	親投資信託	【米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド】 米国の小型株式を主要投資対象とします。
組入制限	<p>■株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>	
分配方針	<p>年2回の毎決算時(原則として3月20日と9月20日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないこともあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>	

第15期 運用報告書(全体版)

(決算日:2024年9月20日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますよう

お願い申し上げます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するご問合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

子投資信託(決算日:2024年9月20日)

「ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド
(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2024年9月20日)

「米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(税引後 配当込み、 円ヘッジ円ベース)	期中 騰落率				
11期(2022年9月20日)	円 12,620	円 0	% △14.1	2,284.70	% △14.0	% 96.2	% 2.5	% 5.1	百万円 6,788
12期(2023年3月20日)	11,983	0	△ 5.0	2,144.28	△ 6.1	89.9	2.2	5.1	5,800
13期(2023年9月20日)	12,105	0	1.0	2,213.27	3.2	94.0	2.2	5.1	5,468
14期(2024年3月21日)	13,499	0	11.5	2,432.33	9.9	94.1	2.2	4.0	5,255
15期(2024年9月20日)	14,427	0	6.9	2,555.95	5.1	91.5	2.2	5.1	4,999

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰落率		(税引後 配当込み、 円ヘッジ円ベース)	騰落率			
(期首) 2024年3月21日	円 13,499	% -	2,432.33	% -	% 94.1	% 2.2	% 4.0
3月末	13,849	2.6	2,488.64	2.3	94.6	2.3	4.0
4月末	13,148	△2.6	2,347.10	△3.5	97.3	2.6	4.2
5月末	13,302	△1.5	2,381.53	△2.1	94.5	2.4	3.8
6月末	13,025	△3.5	2,351.96	△3.3	97.6	1.8	4.3
7月末	14,286	5.8	2,570.17	5.7	89.2	2.0	4.6
8月末	14,123	4.6	2,506.91	3.1	89.2	2.1	4.8
(期末) 2024年9月20日	14,427	6.9	2,555.95	5.1	91.5	2.2	5.1

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	税 込 配 金	期 中 騰 落 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
11期(2022年9月20日)	17,609	0	4.4	376,191.20	5.3	92.7	2.4	4.9	12,776
12期(2023年3月20日)	15,803	0	△10.3	333,541.42	△11.3	92.4	2.3	5.3	10,190
13期(2023年9月20日)	18,396	0	16.4	395,538.46	18.6	92.7	2.2	5.1	10,620
14期(2024年3月21日)	21,607	0	17.5	460,860.35	16.5	93.8	2.2	4.0	11,286
15期(2024年9月20日)	22,414	0	3.7	476,091.37	3.3	92.6	2.3	5.2	10,875

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰 落 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	騰 落 率				
(期首) 2024年3月21日	円	%		%	%	%	%
	21,607	-	460,860.35	-	93.8	2.2	4.0
3月末	22,278	3.1	474,050.59	2.9	93.8	2.3	4.0
4月末	22,031	2.0	466,326.05	1.2	93.6	2.5	4.0
5月末	22,395	3.6	475,639.48	3.2	94.1	2.4	3.8
6月末	22,633	4.7	484,887.99	5.2	94.5	1.7	4.1
7月末	23,659	9.5	505,379.02	9.7	93.6	2.1	4.8
8月末	22,197	2.7	471,890.81	2.4	93.5	2.2	5.0
(期末) 2024年9月20日	22,414	3.7	476,091.37	3.3	92.6	2.3	5.2

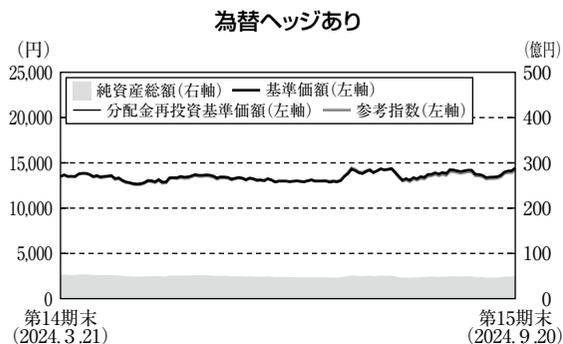
(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率 = 買建比率 - 売建比率。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率等」、「株式先物組入比率」、「投資証券組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注4) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

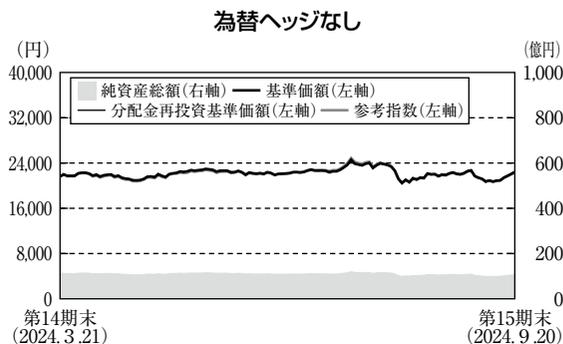
■当期中の基準価額等の推移について(第15期:2024年3月22日~2024年9月20日)



第15期首：13,499円

第15期末：14,427円(既払分配金0円)

騰落率：6.9%(分配金再投資ベース)



第15期首：21,607円

第15期末：22,414円(既払分配金0円)

騰落率：3.7%(分配金再投資ベース)

* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(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、ファンドの購入価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。

* 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)です。

* 分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

* 分配金再投資基準価額は、収益分配金(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、ファンドの購入価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。

* 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)です。

* 分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

当期(2024年3月22日から2024年9月20日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで上昇しました。当期の株式市場は、マクロ面では引き続き米国金融政策見通しの変化の影響を受けた一方で、個別株式面では、AIや半導体関連への期待などに基づく個別銘柄選択が強い環境でした。米国金融政策面では、23年末の連邦準備制度理事会の金融政策決定会合以降利下げ期待が市場で高まっていたものの、関係者からは市場の利下げ期待をけん制するような発言が多く、市場参加者のセンチメントの重石となり、株式市場内の需給動向にも影響を及ぼしました。一方で、個別銘柄レベルでは、AIや半導体関連を中心に、期待先行で株価が上昇する場面もありましたが、期待を裏付けるような決算が発表されると市場参加者のセンチメントを下支えしました。また期末に向けて決算発表を

経るごとに決算内容や今後の見通しに基づいて幅広く内容が精査される環境となりました。

ポートフォリオについて

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)＞

当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組み入れた運用を行いました。また、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りました。

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)＞

当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組み入れた運用を行いました。

<米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド>

当期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに有効性を発揮しました。当期は、米金利見通しの変化の影響を受けたものの、決算内容や今後の見通しなどの業績に基づく個別銘柄精査の動きが強い環境でした。このような市場環境に於いてファンダメンタルズでは、主に財務や企業体質等に着目したが有効性を発揮しました。規制当局への提出書類を分析し、今後の業績の方向性を評価するや、加えて従業員の満足度に着目したなども有効性を発揮しました。センチメントでは、今後の業績期待需給動向に着目した投資アイデアが有効性を発揮しました。証券会社のアナリストのレポートや決算発表時の経営陣のコメントを分析し、アナリストや経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア、決算サプライズに着目した投資アイデアなどに加え、空売り動向に着目した投資アイデアなども有効性を発揮しました。

基準価額の主な変動要因**<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>**

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+6.9%となりました。「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」が上昇したことが当ファンドのプラス要因となりました。

■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	4.6%

<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>

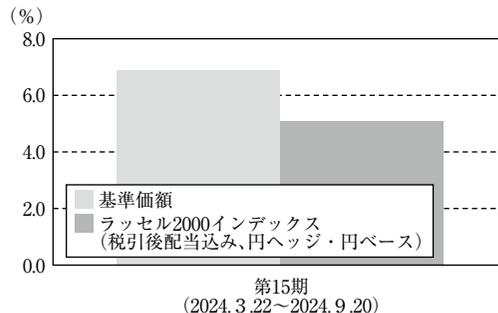
当ファンドの基準価額の期中騰落率は+3.7%となりました。当期、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」が上昇したことが当ファンドのプラス要因となりました。

■組入ファンドの当期間中の騰落率

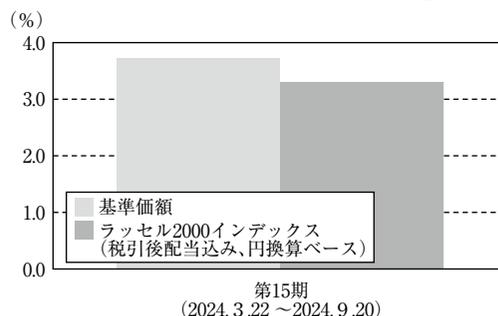
組入ファンド	騰落率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	4.6%

ベンチマークとの差異について**<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)>**

当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。後記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

【基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)】**<ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)>**

当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。後記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

【基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)】

分配金について

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)＞

収益分配につきましては、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2024年3月22日 ～2024年9月20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	-
翌期繰越分配対象額	6,122

- (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。

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)＞

収益分配につきましては、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2024年3月22日 ～2024年9月20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	-
翌期繰越分配対象額	12,413

- (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。

今後の運用方針について

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)＞

引き続き、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組入れた運用を行う方針です。また、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図る方針です。

＜ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)＞

引き続き、「米国小型株式ビッグデータ戦略マザーファンド」を高位に組入れた運用を行う方針です。

＜米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド＞

当ファンドでは、引き続き、ビッグデータ等を活用し、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルにより企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。また、有望な銘柄の選定のみならず、取引コスト、市場環境に応じた取るべきリスク量も勘案して運用を行っていく方針です。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第15期		項目の概要
	(2024. 3. 22～2024. 9. 20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 107	% 0.797	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13,467円です。
(投信会社)	(52)	(0.386)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(52)	(0.386)	販売会社分は、交付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
(受託銀行)	(3)	(0.025)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	6	0.044	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 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)	(6)	(0.041)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／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)	(0.002)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	8	0.056	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(5)	(0.035)	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
(印刷費用・監査費用等)	(2)	(0.014)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	121	0.898	

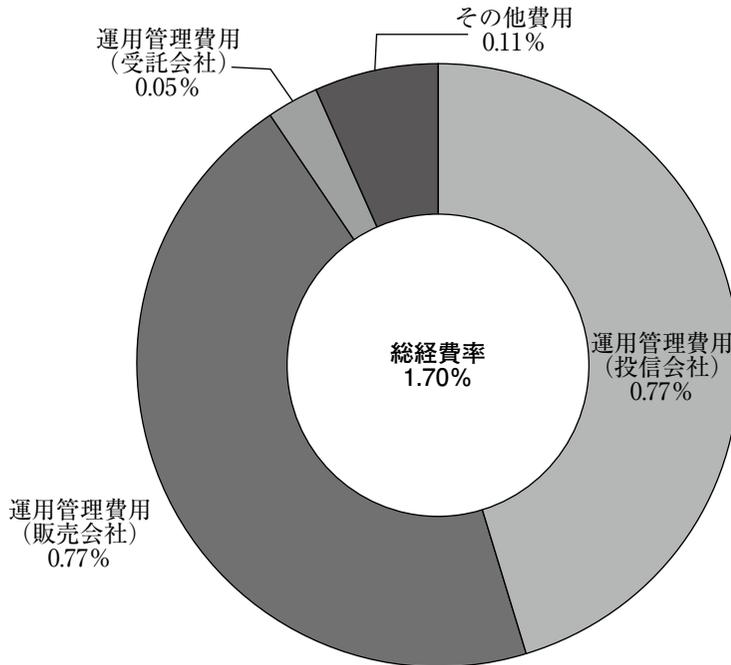
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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1.7%です。

(注1) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 194,136	千円 467,872	千口 422,767	千円 1,048,744

(注) 単位未満は切捨て。

■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(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	22,192,615千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,373,586千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.44

(注1) (b)は親投資信託の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(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

上記期間における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

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 2,204,702	千口 1,976,071	千円 4,983,256

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は6,324,451千口です。

■ 1万口当りの費用明細

項目	第15期		項目の概要
	(2024. 3. 22～2024. 9. 20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 177	% 0.797	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22,178円です。
(投信会社)	(86)	(0.386)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(86)	(0.386)	販売会社分は、交付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
(受託銀行)	(6)	(0.025)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	10	0.045	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 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)	(9)	(0.042)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(1)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／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)	(0.002)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	11	0.048	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(8)	(0.035)	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
(印刷費用・監査費用等)	(2)	(0.008)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	198	0.892	

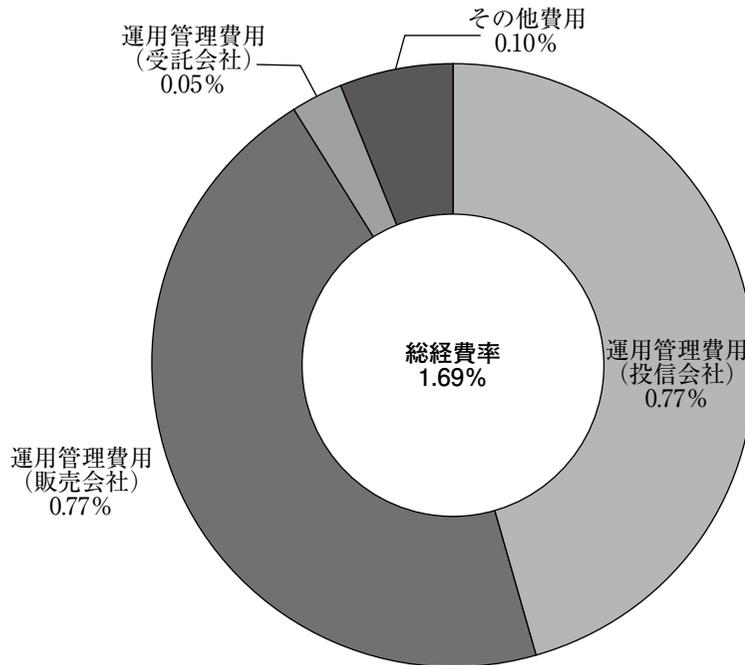
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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1.69%です。

(注1) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 34,760	千円 86,302	千口 401,114	千円 986,765

(注) 単位未満は切捨て。

■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(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	22,192,615千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,373,586千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.44

(注1) (b)は親投資信託の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(2024年3月22日から2024年9月20日まで)

上記期間における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

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千口 4,714,734	千口 4,348,380	千円 10,965,745

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は6,324,451千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千円 4,983,256	% 98.8
コーラル・ローン等、その他	58,804	1.2
投資信託財産総額	5,042,061	100.0

(注1) 米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(15,943,727千円)の投資信託財産総額(16,054,818千円)に対する比率は、99.3%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=142.76円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,358,639,244円
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド(評価額)	4,983,256,624
未 収 入 金	5,375,382,620
(B) 負 債	5,359,536,161
未 払 金	5,318,061,959
未 払 解 約 金	1,352,355
未 払 信 託 報 酬	39,407,617
そ の 他 未 払 費 用	714,230
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,999,103,083
元 本	3,465,183,865
次 期 繰 越 損 益 金	1,533,919,218
(D) 受 益 権 総 口 数	3,465,183,865口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	14,427円

<注記事項>

期首元本額 3,893,668,969円

期中追加設定元本額 1,410,102円

期中一部解約元本額 429,895,206円

■損益の状況

自2024年3月22日 至2024年9月20日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	360,733,409円
売 買 益	993,990,837
売 買 損	△ 633,257,428
(B) 信 託 報 酬 等	△ 40,159,895
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	320,573,514
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	872,126,628
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	341,219,076
(配 当 等 相 当 額)	(318,474,627)
(売 買 損 益 相 当 額)	(22,744,449)
(F) 合 計(C+D+E)	1,533,919,218
次 期 繰 越 損 益 金(F)	1,533,919,218
追 加 信 託 差 損 益 金	341,219,076
(配 当 等 相 当 額)	(318,475,930)
(売 買 損 益 相 当 額)	(22,743,146)
分 配 準 備 積 立 金	1,780,443,345
繰 越 損 益 金	△ 587,743,203

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、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3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(注4) 親投資信託の投資信託財産の運用指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額は、9,545,059円です。

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第15期計算期末における、費用控除後の配当等収益(24,563,344円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(22,743,146円)、収益調整金(その他収益調整金)(318,475,930円)、分配準備積立金(1,755,880,001円)により、分配対象収益は2,121,662,421円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

■投資信託財産の構成

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド	千円 10,965,745	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	30,004	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	10,995,750	100.0

(注1) 米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(15,943,727千円)の投資信託財産総額(16,054,818千円)に対する比率は、99.3%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=142.76円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,995,750,029円
米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド(評価額)	10,965,745,617
未 収 入 金	30,004,412
(B) 負 債	119,864,695
未 払 解 約 金	30,004,412
未 払 信 託 報 酬	88,975,663
そ の 他 未 払 費 用	884,620
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,875,885,334
元 本	4,852,374,704
次 期 繰 越 損 益 金	6,023,510,630
(D) 受 益 権 総 口 数	4,852,374,704口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	22,414円

<注記事項>

期首元本額	5,223,721,901円
期中追加設定元本額	39,010,340円
期中一部解約元本額	410,357,537円

■損益の状況

自2024年3月22日 至2024年9月20日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	477,801,648円
売 買 益	499,751,424
売 買 損	△ 21,949,776
(B) 信 託 報 酬 等	△ 89,860,283
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	387,941,365
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	4,884,191,648
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	751,377,617
(配 当 等 相 当 額)	(629,470,104)
(売 買 損 益 相 当 額)	(121,907,513)
(F) 合 計(C+D+E)	6,023,510,630
次 期 繰 越 損 益 金(F)	6,023,510,630
追 加 信 託 差 損 益 金	751,377,617
(配 当 等 相 当 額)	(629,566,374)
(売 買 損 益 相 当 額)	(121,811,243)
分 配 準 備 積 立 金	5,272,133,013

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、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3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

(注4) 親投資信託の投資信託財産の運用指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額は、21,551,159円です。

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第15期計算期末における、費用控除後の配当等収益(52,022,731円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(335,918,634円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(121,811,243円)、収益調整金(その他収益調整金)(629,566,374円)、分配準備積立金(4,884,191,648円)により、分配対象収益は6,023,510,630円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

運用報告書

－第8期－ 決算日 2024年9月20日
 計算期間(2023年9月21日～2024年9月20日)

米国小型株式 ビッグデータ戦略マザーファンド

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

決 算 日	9月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)
運 用 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ①米国の小型株式に投資を行います。 ②主として、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルを活用しながら、企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④効率的な運用や組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等へ投資する場合があります。 ⑤ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に外国株式等(短期金融商品を含みます。)にかかる運用の指図に関する権限を委託します。 ⑥資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主 要 運 用 対 象	米国の小型株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ■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。

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率	純資産
	期 騰 落	中 率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	期 騰 落				
	円	%		%	%	%	%	百万円
4期(2020年9月23日)	11,335	△ 3.3	224,301.76	△ 5.8	90.9	3.2	5.0	21,650
5期(2021年9月21日)	17,439	53.9	343,189.42	53.0	92.3	2.1	4.7	24,083
6期(2022年9月20日)	19,198	10.1	376,191.20	9.6	92.0	2.3	4.9	19,977
7期(2023年9月20日)	20,389	6.2	395,538.46	5.1	92.0	2.2	5.0	16,297
8期(2024年9月20日)	25,218	23.7	476,091.37	20.4	91.8	2.2	5.1	15,948

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注4) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(参考指数) ラッセル2000インデックス		株式組入 比率等	株式先物 組入比率	投資証券 組入比率
	騰 落	率	(税引後配当込み、 円換算ベース)	騰 落			
(期首) 2023年9月20日	円	%		%	%	%	%
	20,389	-	395,538.46	-	92.0	2.2	5.0
9月末	20,387	△ 0.0	393,322.61	△ 0.6	93.0	2.2	4.8
10月末	18,712	△ 8.2	361,108.04	△ 8.7	93.1	2.2	4.7
11月末	20,208	△ 0.9	389,430.37	△ 1.5	93.3	2.1	4.6
12月末	22,326	9.5	429,110.39	8.5	93.9	1.7	4.4
2024年1月末	22,838	12.0	433,095.71	9.5	93.6	2.1	4.1
2月末	23,515	15.3	452,369.03	14.4	93.8	2.1	4.0
3月末	24,876	22.0	474,050.59	19.8	93.7	2.3	4.0
4月末	24,634	20.8	466,326.05	17.9	93.4	2.5	4.0
5月末	25,075	23.0	475,639.48	20.3	93.8	2.4	3.8
6月末	25,371	24.4	484,887.99	22.6	94.1	1.7	4.1
7月末	26,554	30.2	505,379.02	27.8	93.1	2.1	4.8
8月末	24,954	22.4	471,890.81	19.3	92.8	2.1	5.0
(期末) 2024年9月20日	25,218	23.7	476,091.37	20.4	91.8	2.2	5.1

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 株式先物組入比率＝買建比率－売建比率。

(注3) ラッセル2000インデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■基準価額の推移

(2023年9月20日～2024年9月20日)



(注1) 参考指数は、ラッセル2000インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)です。

(注2) 参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

通期では、当ファンドの基準価額は+23.7%の上昇となりました。

<上半期(2023年9月21日～2024年3月21日)>

投資環境について

当上半期(2023年9月21日から2024年3月21日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで上昇しました。当上半期の株式市場は、マクロ面では米地銀の破綻が一巡した一方、中東情勢が重石となる場面がありました。加えて金融政策や金利見通しの影響が強まり、連邦準備制度理事会が利下げを示唆すると市場参加者は急速にリスクテイク姿勢を強めました。その際には、業績などの企業ファンダメンタルズを度外視する動きが強まり、株式市場内の変動が大きくなりました。一方、個別銘柄レベルでは、各種決算がA I関連への期待の裏付けともなり、A I銘柄への買いが継続するなどしました。但し、市場参加者はA I関連銘柄以外にも決算内容や今後の見通しなどの企業ファンダメンタルズに基づく個別銘柄を強める場面もありました。

ポートフォリオについて

当上半期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに有効性を発揮しました。当上半期は、金利が高位で推移する一方、年末以降利下げ期待の高まりによるリスクテイク姿勢が強まるなど変化しました。また業績内容に基づく個別銘柄精査も強まりました。このような市場環境に於いてファンダメンタルズでは、バリュエーション(割安・割高度合い)に着目する投資アイデアに加え財務や企業体質等に着目した投資アイデアも有効性を発揮しました。特に金利が上昇するなかで割高銘柄が売られ割安銘柄が好まれるような動きをバリュエーションに着目する投資アイデアが上手く捉えました。また、金利が高位で推移するなかで、企業の金利負担への懸念が強まった面もあり、この動きを社債の償還期限の長短に着目した投資アイデアが上手く捉えました。加えて従業員の多様性に着目した投資アイデアなども有効性を発揮しました。センチメントでは、今後の業績期待に着目する投資アイデアと需給動向に着目した投資アイデアがともに有効性を発揮しました。決算発表時の経営陣のコメントを機械学習により分析し、経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア、決算サプライズに着目した投資アイデアなどに加え、空売り動向に着目した投資アイデアなども有効性を発揮しました。

<下半期(2024年3月22日～2024年9月20日)>

投資環境について

当下半期(2024年3月22日から2024年9月20日まで)、米国の株式市場は米ドルベースで上昇しました。当下半期の株式市場は、マクロ面では引き続き米国金融政策見通しの変化の影響を受けた一方で、個別株式面では、A Iや半導体関連への期待などに基づく個別銘柄選択が強い環境でした。米国金融政策面では、23年末の連邦準備制度理事会の金融政策決定会合以降利下げ期待が市場で高まっていたものの、関係者からは市場の利下げ期待をけん制するような発言が多く、市場参加者のセンチメントの重石となり、株式市場内の需給動向にも影響をましました。一方で、個別銘柄レベルでは、A Iや半導体関連中心に、期待先行で株価が上昇する場面もありましたが、期待を

裏付けるような決算が発表されると市場参加者のセンチメントを下支えしました。また下半期末に向けて決算発表を経るごとに決算内容や今後の見通しに基づいて幅広く内容が精査される環境となりました。

ポートフォリオについて

当下半期、ファンダメンタルズ、センチメントがともに有効性を発揮しました。当下半期は、米金利見通しの変化の影響を受けたものの、決算内容や今後の見通しなどの業績に基づく個別銘柄精査の動きが強い環境でした。このような市場環境に於いてファンダメンタルズでは、主に財務や企業体質等に着目した有効性を発揮しました。規制当局への提出書類を分析し、今後の業績の方向性を評価するや、加えて従業員の満足度に着目したなども有効性を発揮しました。センチメントでは、今後の業績期待需給動向に着目した投資アイデアが有効性を発揮しました。証券会社のアナリストのレポートや決算発表時の経営陣のコメントを分析し、アナリストや経営陣のセンチメントを評価する投資アイデア、決算サプライズに着目した投資アイデアなどに加え、空売り動向に着目した投資アイデアなども有効性を発揮しました。

今後の運用方針について

当ファンドでは、引き続き、ビッグデータ等を活用し、ブラックロック・グループが独自に開発した計量モデルにより企業の収益成長や割安度等に着目し、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄へ投資します。また、有望な銘柄の選定のみならず、取引コスト、市場環境に応じた取るべきリスク量も勘案して運用を行っていく方針です。

◇ファンド状況

■1万口当りの費用明細

項 目	当 期
	円
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資証券)	23 (21) (0) (2)
(b) 有価証券取引税 (株式) (投資証券)	1 (1) (0)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	16 (14) (2)
合 計	39

(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、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 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

(b) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数

(c) その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2023年9月21日から2024年9月20日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 43,658 (△ 1,589)	千米・ドル 128,962 (△ 1,236)	百株 53,698	千米・ドル 150,112

(注1) 金額は受渡し代金。

(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含まれていません。

(2) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
ACADIA REALTY TRUST	-	-	18	264
AMERICAN ASSETS TRUST INC	15	282	31	683
APPLE HOSPITALITY REIT INC	-	-	13	214
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	-	-	0.527	5
BLACKSTONE MORTGAGE TRU-CL A	24	420	24	415
BRANDYWINE REALTY TRUST	22	102	4	18
CARETRUST REIT INC	0.218	6	-	-
CHATHAM LODGING TRUST	-	-	9	105
CHIMERA INVESTMENT CORP	0.524	7	-	-
COPT DEFENSE PROPERTIES	41	1,031	40	991
CTO REALTY GROWTH INC	25	493	-	-
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	0.346	1	11	38
EQUITY COMMONWEALTH	30	589	26	503
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	1	72	-	-
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	0.339	7	0.339	7
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	61	1	69
GRANITE POINT MORTGAGE TRUST	5	24	5	17
GREAT AJAX CORP	-	-	9	42
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	0.262	5	5	118
HERSHA HOSPITALITY TRUST	-	-	0.047	0
	(△1.401)	(△ 13)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	0.102	0	21	154
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	-	-	28	416
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	-	-	19	75
KILROY REALTY CORP	15	539	0.549	17
KIMCO REALTY CORP	-	-	2	46
	(2.271)	(41)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	-	-	1	36
LADDER CAPITAL CORP-REIT	-	-	7	79
LAMAR ADVERTISING CO-A	4	474	0.212	25
NET LEASE OFFICE PROPERTY	0.33	6	0.333	5
	(0.003)	(0)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL	5	181	5	209
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	17	90	19	51
OUTFRONT MEDIA INC	7	112	39	552
PARAMOUNT GROUP INC	23	107	9	44
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	11	182	-	-

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15	224	1	15
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	24	27	240
RLJ LODGING TRUST	-	-	50	490
RPT REALTY	0.006 (△3.754)	0 (△ 41)	3 (-)	40 (-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.404	41	0.345	35
SAUL CENTERS INC	0.974	37	-	-
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25	146	4	30
TPG RE FINANCE TRUST INC	4	40	-	-
TANGER INC	12	346	4	132
TERRENO REALTY CORP	0.311	16	0.311	18
WASHINGTON REIT	-	-	4	59

(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) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(3) 先物取引の種類別取引状況

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		4,222	4,257	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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(2023年9月21日から2024年9月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	42,005,889千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,104,380千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.78

(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。

■主要な売買銘柄(2023年9月21日から2024年9月20日まで)

(1) 株式

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
ONTO INNOVATION INC	5	194,023	33,285	SUPER MICRO COMPUTER INC	2	297,136	111,079
FLOWSERVE CORP	26	171,477	6,423	WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	8	236,173	28,434
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7	170,770	24,343	HOULIHAN LOKEY INC	10	174,899	17,477
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	5	167,470	28,544	EMCOR GROUP INC	4	171,335	41,485
TELADOC HEALTH INC	74	150,752	2,011	HEARTLAND FINANCIAL USA INC	33	169,100	5,102
TXNM ENERGY INC	24	141,366	5,673	COMMERCIAL METALS CO	24	167,873	6,860
TOLL BROTHERS INC	8	132,854	15,374	Q2 HOLDINGS INC	26	165,636	6,322
MAXIMUS INC	10	130,554	12,662	BOISE CASCADE CO	7	164,498	21,291
COMFORT SYSTEMS USA INC	2	129,425	47,917	MICROSTRATEGY INC-CL A	1	162,934	162,771
RALPH LAUREN CORP	5	128,683	25,629	TEREX CORP	16	152,758	9,382

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
COPT DEFENSE PROPERTIES	41	157,313	3,809	COPT DEFENSE PROPERTIES	40	146,087	3,621
EQUITY COMMONWEALTH	30	84,888	2,757	AMERICAN ASSETS TRUST INC	31	104,213	3,282
KILROY REALTY CORP	15	78,315	5,045	OUTFRONT MEDIA INC	39	79,312	1,983
LAMAR ADVERTISING CO-A	4	71,804	16,764	EQUITY COMMONWEALTH	26	78,291	3,005
CTO REALTY GROWTH INC	25	71,218	2,747	RLJ LODGING TRUST	50	71,958	1,433
BLACKSTONE MORTGAGE TRU-CL A	24	64,066	2,656	BLACKSTONE MORTGAGE TRU-CL A	24	63,303	2,625
TANGER INC	12	54,057	4,161	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28	59,357	2,085
AMERICAN ASSETS TRUST INC	15	41,872	2,703	ACADIA REALTY TRUST	18	39,490	2,114
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15	35,121	2,315	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27	35,240	1,294
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	11	27,272	2,301	NEXPOINT RESIDENTIAL	5	32,357	5,880

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
AAON INC	13	—	—	—	資本財
AAR CORP	—	2	15	2,144	資本財
ADMA BIOLOGICS INC	58	176	347	49,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACM RESEARCH INC-CLASS A	—	55	97	13,878	半導体・半導体製造装置
ALX ONCOLOGY HOLDINGS INC	11	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANI PHARMACEUTICALS INC	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATN INTERNATIONAL INC	—	38	116	16,653	電気通信サービス
AARON'S INC	146	12	12	1,785	一般消費財・サービス流通・小売り
ABCELLERA BIOLOGICS INC	92	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	34	34	473	67,663	一般消費財・サービス流通・小売り
ACADEMY SPORTS & OUTDOORS IN	18	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
ACADIA PHARMACEUTICALS INC	22	168	277	39,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCEL ENTERTAINMENT INC	69	—	—	—	消費者サービス
ACCOLADE INC	67	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ACCURAY INC	186	196	37	5,334	ヘルスケア機器・サービス
ACI WORLDWIDE INC	—	193	954	136,303	ソフトウェア・サービス
ACRIVON THERAPEUTICS INC	—	3	2	342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACUITY BRANDS INC	—	4	110	15,842	資本財
ADAPTIVE BIOTECHNOLOGIES	209	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADAPTHEALTH CORP	27	33	38	5,436	ヘルスケア機器・サービス
ADDUS HOMECARE CORP	—	43	575	82,093	ヘルスケア機器・サービス
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS IN	—	26	417	59,665	資本財
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES	21	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AEROVIRONMENT INC	—	7	138	19,803	資本財
AGENUS INC	236	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGIOS PHARMACEUTICALS INC	—	25	122	17,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGILON HEALTH INC	—	44	17	2,464	ヘルスケア機器・サービス
AKERO THERAPEUTICS INC	3	33	92	13,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALAMO GROUP INC	—	4	89	12,725	資本財
ALARM.COM HOLDINGS INC	24	41	230	32,921	ソフトウェア・サービス
ALBANY INTL CORP-CL A	1	—	—	—	資本財
ALCOA CORP	—	48	171	24,417	素材
ALECTOR INC	260	260	159	22,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALERUS FINANCIAL CORP	—	29	66	9,559	金融サービス
ALIGNMENT HEALTHCARE INC	74	65	74	10,692	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGiant TRAVEL CO	—	24	106	15,263	運輸
ALLIENT INC	13	42	88	12,567	資本財
VERADIGM INC	0.27	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ALPHA METALLURGICAL RESOURCE	—	8	190	27,152	素材
AMALGAMATED FINANCIAL CORP	73	108	354	50,580	銀行
AMBAC FINANCIAL GROUP INC	52	39	45	6,529	保険

銘柄	期首(前期末)	当期				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	-	54	109	15,639	一般消費財・サービス流通・小売り	
AMERICAN PUBLIC EDUCATION	-	1	2	413	消費者サービス	
AMERICAN SUPERCONDUCTOR CORP	-	6	15	2,176	資本財	
AMERICAN WOODMARK CORP	33	15	145	20,740	資本財	
AMERIS BANCORP	8	26	170	24,401	銀行	
AMICUS THERAPEUTICS INC	44	210	231	33,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMKOR TECHNOLOGY INC	91	7	24	3,438	半導体・半導体製造装置	
AMPHASTAR PHARMACEUTICALS IN	14	11	59	8,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMLYX PHARMACEUTICALS INC	-	97	28	4,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANAPTYSBIO INC	-	41	156	22,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANDERSONS INC/THE	34	-	-	-	生活必需品流通・小売り	
ANGIODYNAMICS INC	125	288	222	31,720	ヘルスケア機器・サービス	
ANIKA THERAPEUTICS INC	53	56	142	20,393	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANNEXON INC	-	8	5	831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANTERO RESOURCES CORP	-	41	112	16,054	エネルギー	
APELLIS PHARMACEUTICALS INC	-	32	117	16,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
APOGEE ENTERPRISES INC	19	16	116	16,566	資本財	
APPFOLIO INC - A	20	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
APPLIED INDUSTRIAL TECH INC	39	9	220	31,473	資本財	
ARCELLX INC	-	7	67	9,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCHROCK INC	146	86	181	25,897	エネルギー	
ARCOSA INC	11	-	-	-	資本財	
ARDELYX INC	-	38	22	3,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCUS BIOSCIENCES INC	39	65	109	15,649	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCUTIS BIOTHERAPEUTICS INC	-	18	18	2,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCTURUS THERAPEUTICS HOLDIN	-	61	128	18,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARROWHEAD PHARMACEUTICALS IN	14	3	6	914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARVINAS INC	73	52	135	19,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASANA INC - CL A	90	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	-	1	45	6,426	一般消費財・サービス流通・小売り	
ASTEC INDUSTRIES INC	35	-	-	-	資本財	
ASTRIA THERAPEUTICS INC	-	57	71	10,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASTRONICS CORP	-	5	11	1,660	資本財	
ATEA PHARMACEUTICALS INC	77	418	159	22,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATKORE INC	71	18	163	23,382	資本財	
ATMUS FILTRATION TECHNOLOGIE	-	15	57	8,177	資本財	
ATRICURE INC	19	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
ATRION CORPORATION	0.84	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
AURORA INNOVATION INC	108	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
AVIDITY BIOSCIENCES INC	-	23	105	15,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVISTA CORP	-	31	120	17,219	公益事業	
AVNET INC	-	84	441	63,024	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AXCELIS TECHNOLOGIES INC	47	28	292	41,754	半導体・半導体製造装置	
AXOGEN INC	56	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
AXSOME THERAPEUTICS INC	1	3	36	5,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXOS FINANCIAL INC	25	-	-	-	銀行
AXONICS INC	11	20	141	20,147	ヘルスケア機器・サービス
AZEK CO INC/THE	-	107	503	71,815	資本財
BCB BANCORP INC	-	55	71	10,141	銀行
BWX TECHNOLOGIES INC	-	5	55	7,878	資本財
BACKBLAZE INC-A	5	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BADGER METER INC	1	11	250	35,712	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BALLY'S CORP	52	-	-	-	消費者サービス
BANCFIRST CORP	-	0.47	5	740	銀行
BANDWIDTH INC-CLASS A	54	63	111	15,859	電気通信サービス
BANK OZK	-	19	84	12,133	銀行
BANK7 CORP	-	34	139	19,856	銀行
BASSETT FURNITURE INDS	1	-	-	-	耐久消費財・アパレル
BEACON ROOFING SUPPLY INC	-	0.48	4	599	資本財
BEAM THERAPEUTICS INC	106	13	35	5,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEAZER HOMES USA INC	7	-	-	-	耐久消費財・アパレル
BELLRING BRANDS INC	39	3	18	2,613	家庭用品・パーソナル用品
BENCHMARK ELECTRONICS INC	23	20	93	13,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BIOCRYST PHARMACEUTICALS INC	101	284	231	33,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BJ'S RESTAURANTS INC	5	-	-	-	消費者サービス
BLACK DIAMOND THERAPEUTICS I	7	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK HILLS CORP	-	96	588	84,063	公益事業
BLACKLINE INC	56	32	170	24,269	ソフトウェア・サービス
BLUE BIRD CORP	-	28	154	22,067	資本財
BLUELIX HOLDINGS INC	1	32	357	51,087	資本財
BLUEPRINT MEDICINES CORP	67	33	307	43,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOISE CASCADE CO	105	70	1,016	145,149	資本財
BOOT BARN HOLDINGS INC	6	24	402	57,398	一般消費財・サービス流通・小売り
BOX INC - CLASS A	137	103	338	48,373	ソフトウェア・サービス
BRAZE INC-A	3	68	247	35,347	ソフトウェア・サービス
BRIDGEBIO PHARMA INC	15	44	120	17,136	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT	-	2	36	5,163	消費者サービス
BRIGHTCOVE	89	161	33	4,723	ソフトウェア・サービス
BRIGHTSPHERE INVESTMENT GROU	-	55	144	20,646	金融サービス
BRINKER INTERNATIONAL INC	-	13	106	15,252	消費者サービス
BROOKFIELD BUSINESS-CL A	-	20	49	7,074	資本財
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	45	-	-	-	公益事業
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	16	-	-	-	資本財
BUMBLE INC-A	253	-	-	-	メディア・娯楽
C3.AI INC-A	9	75	180	25,711	ソフトウェア・サービス
C4 THERAPEUTICS INC	164	15	10	1,487	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CRA INTERNATIONAL INC	-	9	158	22,648	商業・専門サービス
CNO FINANCIAL GROUP INC	75	42	151	21,642	保険

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
CSG SYSTEMS INTL INC	-	1	7	1,133		商業・専門サービス
CSW INDUSTRIALS INC	-	2	81	11,597		資本財
CVB FINANCIAL CORP	62	-	-	-		銀行
CVR ENERGY INC	99	-	-	-		エネルギー
CABALETTA BIO INC	-	12	5	842		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CABLE ONE INC	-	7	249	35,563		メディア・娯楽
CABOT CORP	29	40	444	63,509		素材
CACI INTERNATIONAL INC -CL A	-	3	154	22,087		商業・専門サービス
CADRE HOLDINGS INC	-	3	11	1,706		資本財
CAL-MAINE FOODS INC	59	-	-	-		食品・飲料・タバコ
CALIFORNIA RESOURCES CORP	19	-	-	-		エネルギー
CALIX INC	100	52	204	29,177		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CALLON PETROLEUM CO	2	-	-	-		エネルギー
CAPITAL CITY BANK GROUP INC	79	77	275	39,361		銀行
CAPITOL FEDERAL FINANCIAL IN	-	49	30	4,302		銀行
CAREDX INC	108	59	178	25,423		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CARGURUS INC	123	-	-	-		メディア・娯楽
CARPARTS.COM INC	146	254	22	3,235		一般消費財・サービス流通・小売り
CARPENTER TECHNOLOGY	-	13	204	29,252		素材
CARROLS RESTAURANT GROUP INC	175	-	-	-		消費者サービス
CARVANA CO	25	7	121	17,306		一般消費財・サービス流通・小売り
CASTLE BIOSCIENCES INC	-	28	85	12,255		ヘルスケア機器・サービス
CATALYST PHARMACEUTICALS INC	-	143	306	43,792		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLEX THERAPEUTICS INC	-	2	11	1,704		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTRAL GARDEN & PET CO	4	-	-	-		家庭用品・パーソナル用品
CENTRAL GARDEN AND PET CO-A	41	-	-	-		家庭用品・パーソナル用品
CENTURY ALUMINUM COMPANY	-	127	187	26,829		素材
CENTURY COMMUNITIES INC	47	64	688	98,295		耐久消費財・アパレル
CERUS CORP	141	141	25	3,707		ヘルスケア機器・サービス
CHAMPIONX CORP	33	32	100	14,399		エネルギー
CHART INDUSTRIES INC	-	9	115	16,468		資本財
CHEGG INC	110	-	-	-		消費者サービス
CHEWY INC - CLASS A	-	20	63	9,026		一般消費財・サービス流通・小売り
CHICO'S FAS INC	135	-	-	-		一般消費財・サービス流通・小売り
CHUY'S HOLDINGS INC	20	6	25	3,698		消費者サービス
CINEMARK HOLDINGS INC	27	-	-	-		メディア・娯楽
CIRCOR INTERNATIONAL INC	8	-	-	-		資本財
CIRRUS LOGIC INC	2	-	-	-		半導体・半導体製造装置
CITI TRENDS INC	21	-	-	-		一般消費財・サービス流通・小売り
CIVISTA BANCSHARES INC	0.65	160	290	41,490		銀行
CIVITAS RESOURCES INC	-	38	209	29,898		エネルギー
CLEANSARK INC	28	-	-	-		ソフトウェア・サービス
CLEAR SECURE INC -CLASS A	24	17	57	8,160		ソフトウェア・サービス
CLEARWAY ENERGY INC-A	303	-	-	-		公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
CLEARWAY ENERGY INC-C	138	-	-	-	公益事業
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	156	188	26,923	素材
COASTAL FINANCIAL CORP/WA	-	22	120	17,168	銀行
CODEXIS INC	343	164	52	7,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COEUR MINING INC	646	101	69	9,989	素材
COGENT COMMUNICATIONS HOLDIN	6	-	-	-	電気通信サービス
COHERUS BIOSCIENCES INC	307	241	27	3,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COHU INC	8	-	-	-	半導体・半導体製造装置
COLLEGIUM PHARMACEUTICAL INC	108	18	71	10,276	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLONY BANKCORP	-	38	60	8,672	銀行
COMFORT SYSTEMS USA INC	33	20	785	112,103	資本財
COMMERCIAL METALS CO	243	10	54	7,839	素材
COMMUNITY TRUST BANCORP INC	0.71	-	-	-	銀行
COMMVAULT SYSTEMS INC	38	26	401	57,356	ソフトウェア・サービス
COMPASS MINERALS INTERNATION	2	-	-	-	素材
COMPASS THERAPEUTICS INC	-	228	39	5,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONFLUENT INC-CLASS A	-	23	48	6,883	ソフトウェア・サービス
CONNECTONE BANCORP INC	51	237	622	88,911	銀行
CONN'S INC	144	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
CONSTRUCTION PARTNERS INC-A	33	-	-	-	資本財
CONTAINER STORE GROUP INC/TH	55	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
COOPER-STANDARD HOLDING	21	-	-	-	自動車・自動車部品
CORCEPT THERAPEUTICS INC	177	146	598	85,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CORE MOLDING TECHNOLOGIES IN	2	-	-	-	素材
CORECIVIC INC	93	62	79	11,416	商業・専門サービス
CORVEL CORP	-	10	344	49,248	ヘルスケア機器・サービス
COUCHBASE INC	-	0.99	1	199	ソフトウェア・サービス
COURSERA INC	-	27	23	3,300	消費者サービス
COVENANT LOGISTICS GROUP INC	27	32	173	24,733	運輸
CRAWFORD & COMPANY -CL A	43	14	15	2,146	保険
CRINETICS PHARMACEUTICALS IN	-	11	60	8,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROCS INC	35	-	-	-	耐久消費財・アパレル
CROSS COUNTRY HEALTHCARE INC	34	54	81	11,573	ヘルスケア機器・サービス
CULLINAN ONCOLOGY INC	43	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYTOKINETICS INC	70	36	201	28,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYTEK BIOSCIENCES INC	-	114	60	8,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DMC GLOBAL INC	-	1	2	324	エネルギー
DHI GROUP INC	24	-	-	-	メディア・娯楽
DANA INC	216	86	90	12,867	自動車・自動車部品
DAY ONE BIOPHARMACEUTICALS I	-	11	16	2,287	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DECIPHERA PHARMACEUTICALS IN	92	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DELEK US HOLDINGS INC	-	45	91	13,053	エネルギー
DENALI THERAPEUTICS INC	141	112	348	49,686	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DESIGN THERAPEUTICS INC	-	69	40	5,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期			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	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DILLARDS INC-CL A	0.39	0.23	8	1,206	一般消費財・サービス流通・小売り
DIME COMMUNITY BANCSHARES IN	—	13	41	5,967	銀行
DIODES INC	2	35	217	31,069	半導体・半導体製造装置
DOCUSIGN INC	—	7	41	5,985	ソフトウェア・サービス
DOMO INC - CLASS B	31	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DONEGAL GROUP INC-CL A	3	—	—	—	保険
DONNELLEY FINANCIAL SOLUTION	—	28	199	28,412	金融サービス
DUCOMMUN INC	44	—	—	—	資本財
DULUTH HOLDINGS INC - CL B	79	76	30	4,299	一般消費財・サービス流通・小売り
DUOLINGO	4	—	—	—	消費者サービス
DYCOM INDUSTRIES INC	—	26	524	74,834	資本財
DYNAVAX TECHNOLOGIES CORP	165	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNE THERAPEUTICS INC	—	34	126	18,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELF BEAUTY INC	26	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
EL POLLO LOCO HOLDINGS INC	92	—	—	—	消費者サービス
EAGLE BANCORP INC	—	9	21	3,129	銀行
EAGLE PHARMACEUTICALS INC	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EHOSTAR CORPORATION - A	157	47	124	17,743	電気通信サービス
EDGEWISE THERAPEUTICS INC	—	61	182	26,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EDITAS MEDICINE INC	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EHEALTH INC	67	—	—	—	保険
8X8 INC	317	240	45	6,486	ソフトウェア・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	52	78	11,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMBECTA CORP	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EMCOR GROUP INC	50	8	378	54,026	資本財
EMERGENT BIOSOLUTIONS INC	313	17	11	1,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENACT HOLDINGS INC	—	9	33	4,757	金融サービス
ENCORE WIRE CORP	30	—	—	—	資本財
ENCORE ENERGY CORP	82	80	29	4,210	エネルギー
ENCOMPASS HEALTH CORP	—	7	69	9,883	ヘルスケア機器・サービス
ENERGIZER HOLDINGS INC	—	3	9	1,350	家庭用品・パーソナル用品
ENERSYS	43	35	365	52,166	資本財
ENGAGESMART INC	202	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ENLIVEN THERAPEUTICS INC	—	11	25	3,711	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENOVA INTERNATIONAL INC	122	64	549	78,469	金融サービス
ENSIGN GROUP INC/THE	65	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ENTERPRISE BANCORP INC	8	92	297	42,515	銀行
ENTERPRISE FINANCIAL SERVICE	106	82	439	62,709	銀行
ENTRAVISION COMMUNICATIONS-A	46	—	—	—	メディア・娯楽
ENTRADA THERAPEUTICS INC	—	31	47	6,773	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENVISTA HOLDINGS CORP	—	14	27	3,959	ヘルスケア機器・サービス
EPLUS INC	59	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ETHAN ALLEN INTERIORS INC	7	—	—	—	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
EURONET WORLDWIDE INC	-	57	572	81,739	金融サービス	
EVERCORE INC - A	-	28	725	103,548	金融サービス	
EVERBRIDGE INC	47	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
EVERI HOLDINGS INC	163	31	41	5,960	消費者サービス	
EVERQUOTE INC - CLASS A	-	112	251	35,969	メディア・娯楽	
EVOLENT HEALTH INC - A	-	20	63	9,029	ヘルスケア機器・サービス	
EXLSERVICE HOLDINGS INC	291	326	1,196	170,770	商業・専門サービス	
EXP WORLD HOLDINGS INC	8	-	-	-	不動産管理・開発	
EXPONENT INC	39	7	82	11,821	商業・専門サービス	
EXPENSIFY INC - A	92	89	20	2,876	ソフトウェア・サービス	
EXTREME NETWORKS INC	68	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EZCORP INC-CL A	670	360	391	55,824	金融サービス	
FB FINANCIAL CORP	-	79	393	56,210	銀行	
FIGS INC-CLASS A	91	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
FS BANCORP INC	7	5	27	3,899	銀行	
FTI CONSULTING INC	-	26	592	84,640	商業・専門サービス	
FARO TECHNOLOGIES INC	-	23	42	6,085	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FASTLY INC - CLASS A	83	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
FATE THERAPEUTICS INC	456	171	68	9,769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FEDERAL SIGNAL CORP	31	8	80	11,467	資本財	
FEDERATED HERMES INC	37	75	274	39,185	金融サービス	
FINANCIAL INSTITUTIONS INC	28	-	-	-	銀行	
FIRST BANK/HAMILTON NJ	59	-	-	-	銀行	
FIRST BUSINESS FINANCIAL SER	12	23	109	15,610	銀行	
FIRST FINL BANKSHARES INC	-	38	150	21,513	銀行	
FIRST FINANCIAL NORTHWEST	134	-	-	-	銀行	
FIRST HORIZON CORP	-	43	70	10,120	銀行	
FIRST INTERNET BANCORP	21	18	64	9,245	銀行	
FIRST INTERSTATE BANCOSYS-A	96	-	-	-	銀行	
FIRST OF LONG ISLAND CORP	-	145	197	28,139	銀行	
FIRST MERCHANTS CORP	12	-	-	-	銀行	
1ST SOURCE CORP	-	34	213	30,445	銀行	
FIRSTCASH HOLDINGS INC	38	36	431	61,651	金融サービス	
FLUOR CORP	86	-	-	-	資本財	
FLOWERVE CORP	-	256	1,239	176,901	資本財	
FLUSHING FINANCIAL CORP	-	49	75	10,835	銀行	
FOOT LOCKER INC	-	54	158	22,658	一般消費財・サービス流通・小売り	
FORMFACTOR INC	40	4	19	2,838	半導体・半導体製造装置	
FORUM ENERGY TECHNOLOGIES IN	-	124	204	29,211	エネルギー	
FOSSIL GROUP INC	15	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
4D MOLECULAR THERAPEUTICS IN	-	43	58	8,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FOX FACTORY HOLDING CORP	1	-	-	-	自動車・自動車部品	
FRANKLIN ELECTRIC CO INC	28	-	-	-	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	-	38	79	11,345	金融サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期 末				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
FRESHPET INC	-	10	142	20,365	食品・飲料・タバコ	
FRESHWORKS INC-CL A	43	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
FRONTDOOR INC	131	44	218	31,143	消費者サービス	
FULCRUM THERAPEUTICS INC	-	102	35	5,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GATX CORP	25	-	-	-	資本財	
G-III APPAREL GROUP LTD	-	48	155	22,257	耐久消費財・アパレル	
GMS INC	49	-	-	-	資本財	
GAIA INC	3	3	1	220	メディア・娯楽	
GAP INC/THE	-	32	66	9,498	一般消費財・サービス流通・小売り	
GENERAC HOLDINGS INC	-	6	86	12,302	資本財	
GENESCO INC	-	40	119	17,040	一般消費財・サービス流通・小売り	
GENTHERM INC	36	-	-	-	自動車・自動車部品	
GERON CORP	-	17	8	1,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIBRALTAR INDUSTRIES INC	61	57	425	60,790	資本財	
GITLAB INC-CL A	-	13	71	10,246	ソフトウェア・サービス	
GLAUKOS CORP	8	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
GLOBAL INDUSTRIAL CO	31	26	90	12,960	資本財	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	83	173	144	20,694	自動車・自動車部品	
GRAY TELEVISION INC	8	17	8	1,279	メディア・娯楽	
GREEN BRICK PARTNERS INC	-	1	14	2,135	耐久消費財・アパレル	
GRID DYNAMICS HOLDINGS INC	-	7	9	1,413	ソフトウェア・サービス	
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	41	13	526	75,174	一般消費財・サービス流通・小売り	
GUARDANT HEALTH INC	84	55	140	19,997	ヘルスケア機器・サービス	
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	30	-	-	-	資本財	
HBT FINANCIAL INC/DE	154	57	135	19,344	銀行	
HACKETT GROUP INC/THE	-	0.75	2	287	ソフトウェア・サービス	
HAEMONETICS CORP/MASS	-	1	9	1,286	ヘルスケア機器・サービス	
HALOZYME THERAPEUTICS INC	78	53	319	45,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HAMILTON LANE INC-CLASS A	21	4	75	10,796	金融サービス	
HANCOCK WHITNEY CORP	205	47	248	35,535	銀行	
HARBORONE BANCORP INC	-	1	2	296	銀行	
HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	95	79	309	44,128	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENVIRI CORP	35	-	-	-	商業・専門サービス	
HASHICORP INC-CL A	-	8	30	4,307	ソフトウェア・サービス	
HEALTHCARE SERVICES GROUP	207	110	130	18,636	商業・専門サービス	
HEALTHSTREAM INC	26	26	76	10,975	ヘルスケア機器・サービス	
HEALTH CATALYST INC	58	107	95	13,567	ヘルスケア機器・サービス	
HEALTHEQUITY INC	17	18	145	20,722	ヘルスケア機器・サービス	
HEARTLAND FINANCIAL USA INC	347	16	99	14,143	銀行	
HECLA MINING CO	-	321	215	30,697	素材	
HELIX ENERGY SOLUTIONS GROUP	251	-	-	-	エネルギー	
HELMERICH & PAYNE	83	50	163	23,330	エネルギー	
HERITAGE COMMERCE CORP	483	58	59	8,542	銀行	
HERC HOLDINGS INC	22	30	476	68,010	資本財	

銘柄	期首(前期末)	当期			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
HERITAGE FINANCIAL CORP	2	15	35	5,086	銀行
HILTON GRAND VACATIONS INC	8	-	-	-	消費者サービス
HIMS & HERS HEALTH INC	153	81	137	19,700	ヘルスケア機器・サービス
HOMETRUST BANCSHARES INC	91	91	333	47,641	銀行
HORIZON BANCORP INC/IN	506	122	203	29,010	銀行
HOSTESS BRANDS INC	61	-	-	-	食品・飲料・タバコ
HOULIHAN LOKEY INC	93	16	267	38,181	金融サービス
HUB GROUP INC-CL A	-	2	9	1,332	運輸
HUNTSMAN CORP	-	31	70	10,102	素材
HURON CONSULTING GROUP INC	16	0.9	-	-	商業・専門サービス
IDT CORP-CLASS B	-	-	3	503	電気通信サービス
HYSTER-YALE INC	-	0.84	5	748	資本財
ICU MEDICAL INC	-	4	83	11,852	ヘルスケア機器・サービス
IES HOLDINGS INC	-	5	103	14,839	資本財
I-80 GOLD CORP	264	264	30	4,346	素材
IRHYTHM TECHNOLOGIES INC	-	4	29	4,225	ヘルスケア機器・サービス
IDEAYA BIOSCIENCES INC	21	48	170	24,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IKENA ONCOLOGY INC	4	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IMMUNOGEN INC	50	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IMPINJ INC	-	11	224	32,002	半導体・半導体製造装置
INARI MEDICAL INC	19	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
INDEPENDENT BANK CORP - MICH	115	107	378	53,976	銀行
INDEPENDENT BANK GROUP INC	16	14	88	12,661	銀行
INFORMATICA INC - CLASS A	-	24	63	9,017	ソフトウェア・サービス
INFORMATION SERVICES GROUP	4	4	1	208	ソフトウェア・サービス
INSIGHT ENTERPRISES INC	26	12	274	39,149	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INSMED INC	19	47	359	51,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC	7	5	120	17,138	ヘルスケア機器・サービス
INSPERITY INC	95	80	739	105,571	商業・専門サービス
INSTALLED BUILDING PRODUCTS	16	15	376	53,747	耐久消費財・アパレル
INTELLIA THERAPEUTICS INC	92	117	268	38,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTAPP INC	26	19	96	13,738	ソフトウェア・サービス
INTEGRAL AD SCIENCE HOLDING	40	-	-	-	メディア・娯楽
INTERCEPT PHARMACEUTICALS INC	81	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTERDIGITAL INC	0.01	-	-	-	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL MONEY EXPRESS	-	6	13	1,905	金融サービス
INTRA-CELLULAR THERAPIES INC	-	11	87	12,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INVESTAR HOLDING CORP	11	113	217	31,021	銀行
INVESTORS TITLE CO	2	-	-	-	保険
IONIS PHARMACEUTICALS INC	-	45	196	28,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IOVANCE BIOTHERAPEUTICS INC	-	30	31	4,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IRADIMED CORP	34	70	347	49,597	ヘルスケア機器・サービス
IRIDIUM COMMUNICATIONS INC	14	35	100	14,320	電気通信サービス
IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	304	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
ITEOS THERAPEUTICS INC	111	112	126	18,095	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ITRON INC	55	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JANUS INTERNATIONAL GROUP IN	293	-	-	-	資本財	
JELD-WEN HOLDING INC	271	-	-	-	資本財	
JETBLUE AIRWAYS CORP	689	-	-	-	運輸	
JOINT CORP/THE	13	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
KBR INC	47	-	-	-	商業・専門サービス	
KVH INDUSTRIES INC	-	7	3	470	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KAISER ALUMINUM CORP	9	32	231	33,112	素材	
KARYOPHARM THERAPEUTICS INC	233	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KB HOME	29	1	12	1,791	耐久消費財・アパレル	
KEARNY FINANCIAL CORP/MD	-	152	110	15,783	銀行	
KENNAMETAL INC	88	18	48	6,949	資本財	
KEROS THERAPEUTICS INC	-	7	40	5,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KIMBALL ELECTRONICS INC	118	48	90	12,901	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KINSALE CAPITAL GROUP INC	15	-	-	-	保険	
KODIAK GAS SERVICES INC	194	-	-	-	エネルギー	
KODIAK SCIENCES INC	194	68	17	2,534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KOPPERS HOLDINGS INC	-	21	81	11,688	素材	
KORN FERRY	14	2	16	2,374	商業・専門サービス	
KRONOS BIO INC	123	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KRYSTAL BIOTECH INC	1	4	91	13,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KULICKE & SOFFA INDUSTRIES	18	-	-	-	半導体・半導体製造装置	
KURA ONCOLOGY INC	157	77	163	23,358	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KYNDRYL HOLDINGS INC	-	79	188	26,876	ソフトウェア・サービス	
KYMERA THERAPEUTICS INC	26	41	202	28,852	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LGI HOMES INC	1	3	37	5,377	耐久消費財・アパレル	
LI-CYCLE HOLDINGS CORP	7	-	-	-	商業・専門サービス	
LAKELAND BANCORP INC	136	-	-	-	銀行	
LANDS' END INC	34	37	62	8,934	一般消費財・サービス流通・小売り	
LANTHEUS HOLDINGS INC	11	9	100	14,351	ヘルスケア機器・サービス	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	47	-	-	-	半導体・半導体製造装置	
LAUREATE EDUCATION INC-A	674	89	150	21,510	消費者サービス	
LEAR CORP	-	11	130	18,580	自動車・自動車部品	
LEMAITRE VASCULAR INC	1	42	386	55,191	ヘルスケア機器・サービス	
LENDINGTREE INC	65	4	28	4,074	金融サービス	
LIBERTY ENERGY INC	-	213	449	64,190	エネルギー	
LIFE TIME GROUP HOLDINGS INC	-	80	202	28,870	消費者サービス	
LIGAND PHARMACEUTICALS	11	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIFESTANCE HEALTH GROUP INC	-	34	23	3,363	ヘルスケア機器・サービス	
LIONS GATE ENTERTAINMENT-A	54	-	-	-	メディア・娯楽	
LIONS GATE ENTERTAINMENT-B	91	-	-	-	メディア・娯楽	
LIVEPERSON INC	180	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
LIVERAMP HOLDINGS INC	35	89	232	33,166	ソフトウェア・サービス	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
LONGBOARD PHARMACEUTICALS IN	-	9	32	4,610		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOUISIANA-PACIFIC CORP	-	38	397	56,717		素材
LUMEN TECHNOLOGIES INC	-	201	134	19,242		電気通信サービス
MDC HOLDINGS INC	43	-	-	-		耐久消費財・アパレル
MGP INGREDIENTS INC	9	-	-	-		食品・飲料・タバコ
M/I HOMES INC	-	32	553	79,039		耐久消費財・アパレル
MRC GLOBAL INC	-	26	34	4,913		資本財
MVB FINANCIAL CORP	1	-	-	-		銀行
MYR GROUP INC/DELAWARE	44	-	-	-		資本財
MACROGENICS INC	54	-	-	-		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MACY'S INC	17	45	69	9,948		一般消費財・サービス流通・小売り
STEVEN MADDEN LTD	-	48	233	33,322		耐久消費財・アパレル
MADRIGAL PHARMACEUTICALS INC	0.7	2	62	8,853		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAGNITE INC	-	14	18	2,697		メディア・娯楽
MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	250	128	334	47,704		エネルギー
MANITOWOC COMPANY INC	182	-	-	-		資本財
MANNKIND CORP	-	137	91	13,117		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANPOWERGROUP INC	-	30	229	32,820		商業・専門サービス
MARAVAI LIFESCIENCES HLDGS-A	-	58	51	7,377		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARQETA INC-A	169	-	-	-		金融サービス
MARRIOTT VACATIONS WORLD	-	1	9	1,330		消費者サービス
MASIMO CORP	-	4	53	7,656		ヘルスケア機器・サービス
MASTERCRAFT BOAT HOLDINGS IN	1	-	-	-		耐久消費財・アパレル
MATADOR RESOURCES CO	69	-	-	-		エネルギー
MATERION CORP	8	14	165	23,610		素材
MATSON INC	54	7	96	13,767		運輸
MAXLINEAR INC-CLASS A	142	-	-	-		半導体・半導体製造装置
MAXIMUS INC	-	71	647	92,417		商業・専門サービス
MCGRATH RENTCORP	34	9	97	13,906		資本財
MEDIAALPHA INC-CLASS A	-	110	195	27,972		メディア・娯楽
MEDPACE HOLDINGS INC	4	1	38	5,533		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MERCANTILE BANK CORP	11	6	30	4,418		銀行
MERCURY GENERAL CORP	155	-	-	-		保険
MERIT MEDICAL SYSTEMS INC	125	1	14	2,060		ヘルスケア機器・サービス
METROPOLITAN BANK HOLDING CO	-	9	52	7,460		銀行
MICROSTRATEGY INC-CL A	2	-	-	-		ソフトウェア・サービス
MIDLAND STATES BANCORP INC	173	195	450	64,332		銀行
MIDWESTONE FINANCIAL GROUP I	23	28	84	11,995		銀行
MILLER INDUSTRIES INC/TENN	-	7	48	6,883		資本財
MIMEDX GROUP INC	84	76	47	6,771		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MINERALS TECHNOLOGIES INC	-	48	358	51,225		素材
MISTRAS GROUP INC	8	-	-	-		商業・専門サービス
MODEL N INC	74	-	-	-		ソフトウェア・サービス
MODINE MANUFACTURING CO	53	44	572	81,726		自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期			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	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
MONARCH CASINO & RESORT INC	42	—	—	—	消費者サービス
MOOG INC-CLASS A	—	30	629	89,849	資本財
MOTORCAR PARTS OF AMERICA IN	25	21	13	1,953	自動車・自動車部品
MUELLER INDUSTRIES INC	38	39	294	41,978	資本財
MUELLER WATER PRODUCTS INC-A	—	19	42	6,002	資本財
MR COOPER GROUP INC	—	9	90	12,920	金融サービス
MURPHY OIL CORP	321	129	465	66,473	エネルギー
MURPHY USA INC	15	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MYRIAD GENETICS INC	5	70	200	28,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NMI HOLDINGS INC	51	55	230	32,835	金融サービス
NOV INC	—	108	182	26,109	エネルギー
NANOSTRING TECHNOLOGIES INC	49	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NAPCO SECURITY TECHNOLOGIES	—	7	28	4,136	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NATERA INC	4	4	55	7,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NATIONAL BANK HOLD-CL A	18	—	—	—	銀行
NATIONAL BEVERAGE CORP	13	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NATIONAL VISION HOLDINGS INC	—	111	121	17,403	一般消費財・サービス流通・小売り
NEKTAR THERAPEUTICS	213	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEOGEN CORP	40	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NEOGENOMICS INC	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NETGEAR INC	46	72	150	21,483	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEW JERSEY RESOURCES CORP	160	—	—	—	公益事業
NEW YORK TIMES CO-A	—	16	90	12,921	メディア・娯楽
NEWELL RUBBERMAID INC	—	37	28	4,011	耐久消費財・アパレル
NEXTRACKER INC-CL A	—	19	69	9,967	資本財
NI HOLDINGS INC	16	15	23	3,368	保険
NEXTGEN HEALTHCARE INC	25	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NEXTCURE INC	73	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEXTDOOR HOLDINGS INC	—	107	26	3,734	メディア・娯楽
NIOCORP DEVELOPMENTS LTD	5	5	0	142	素材
NKARTA INC	102	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHEAST BANK	—	0.37	2	377	銀行
NORTHFIELD BANCORP INC	—	96	118	16,900	銀行
NORTHRIM BANCORP INC	24	—	—	—	銀行
NORTHWESTERN ENERGY GROUP IN	—	56	318	45,473	公益事業
NOVAGOLD RESOURCES INC	353	—	—	—	素材
DNOW INC	5	77	101	14,450	資本財
NUTANIX INC - A	—	14	87	12,522	ソフトウェア・サービス
NUVALENT INC-A	—	3	35	5,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NURIX THERAPEUTICS INC	55	24	60	8,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NUVATION BIO INC	440	258	76	10,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OSI SYSTEMS INC	15	11	174	24,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHORD ENERGY CORP	7	—	—	—	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	—	64	165	23,671	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
OCEANFIRST FINANCIAL CORP	433	391	741	105,818	銀行	
OIL-DRI CORP OF AMERICA	5	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品	
OIL STATES INTERNATIONAL INC	218	251	124	17,728	エネルギー	
OLEMA PHARMACEUTICALS INC	18	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OLO INC - CLASS A	-	353	182	26,108	ソフトウェア・サービス	
OLYMPIC STEEL INC	26	36	144	20,620	素材	
OMNICELL INC	34	75	328	46,911	ヘルスケア機器・サービス	
ONE GAS INC	13	-	-	-	公益事業	
1-800-FLOWERS.COM INC-CL A	232	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り	
ONEMAIN HOLDINGS INC	-	26	133	19,094	金融サービス	
ONESPAN INC	-	28	46	6,632	ソフトウェア・サービス	
ONTO INNOVATION INC	-	31	639	91,265	半導体・半導体製造装置	
OOMA INC	266	398	447	63,949	ソフトウェア・サービス	
OPENDOOR TECHNOLOGIES INC	143	-	-	-	不動産管理・開発	
OPORTUN FINANCIAL CORP	77	-	-	-	金融サービス	
OPTION CARE HEALTH INC	67	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
ORASURE TECHNOLOGIES INC	-	162	70	10,089	ヘルスケア機器・サービス	
ORGANOGENESIS HOLDINGS INC	-	38	11	1,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORIGIN BANCORP INC	-	40	136	19,509	銀行	
ORIC PHARMACEUTICALS INC	-	17	19	2,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OSCAR HEALTH INC - CLASS A	192	71	165	23,602	保険	
OSHKOSH CORP	-	71	731	104,405	資本財	
OUTBRAIN INC	-	243	116	16,668	メディア・娯楽	
OVINTIV INC	52	110	446	63,733	エネルギー	
PBF ENERGY INC-CLASS A	51	95	324	46,316	エネルギー	
PC CONNECTION INC	71	78	597	85,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PJT PARTNERS INC - A	-	25	348	49,712	金融サービス	
TXNM ENERGY INC	-	156	672	95,977	公益事業	
PMV PHARMACEUTICALS INC	168	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PTC THERAPEUTICS INC	66	61	220	31,525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PACS GROUP INC	-	0.93	3	552	ヘルスケア機器・サービス	
PACIFIC BIOSCIENCES OF CALIF	196	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PACIRA BIOSCIENCES INC	58	50	73	10,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PALOMAR HOLDINGS INC	8	15	147	21,102	保険	
PAPA JOHN'S INTL INC	11	-	-	-	消費者サービス	
PAR PACIFIC HOLDINGS INC	34	96	190	27,249	エネルギー	
PARSONS CORP	-	22	226	32,337	商業・専門サービス	
PATRICK INDUSTRIES INC	-	26	384	54,849	自動車・自動車部品	
PATTERSON COS INC	40	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	357	307	261	37,281	エネルギー	
PEAPACK GLADSTONE FINL CORP	-	50	148	21,255	銀行	
PEGASYSTEMS INC	-	24	167	23,904	ソフトウェア・サービス	
PENNANT GROUP INC/THE	-	3	14	2,018	ヘルスケア機器・サービス	
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC	-	3	54	7,743	一般消費財・サービス流通・小売り	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
PERFORMANCE FOOD GROUP CO	-	30	231	33,030	生活必需品流通・小売り	
PERPETUA RESOURCES CORP	6	6	5	834	素材	
PERSONALIS INC	510	132	78	11,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PETIQ INC	108	10	33	4,777	ヘルスケア機器・サービス	
PHIBRO ANIMAL HEALTH CORP-A	-	51	115	16,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHOTRONICS INC	100	38	90	12,976	半導体・半導体製造装置	
PHREESIA INC	-	64	153	21,874	ヘルスケア機器・サービス	
PIEDMONT LITHIUM INC	-	22	17	2,522	素材	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	-	144	274	39,130	エネルギー	
PLAYAGS INC	29	26	29	4,212	消費者サービス	
PLAYSTUDIOS INC	-	749	112	16,039	メディア・娯楽	
PLEXUS CORP	0.94	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PLIANT THERAPEUTICS INC	-	9	12	1,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POINT BIOPHARMA GLOBAL INC	4	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POLYMET MINING CORP	115	-	-	-	素材	
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	60	-	-	-	公益事業	
POSEIDA THERAPEUTICS INC	68	68	24	3,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POWELL INDUSTRIES INC	-	1	37	5,421	資本財	
POWER INTEGRATIONS INC	5	22	140	20,074	半導体・半導体製造装置	
PREMIER FINANCIAL CORP	59	-	-	-	銀行	
PRELUDE THERAPEUTICS INC	42	42	10	1,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PRESTIGE CONSUMER HEALTHCARE	131	9	66	9,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PRICESMART INC	0.77	10	95	13,629	生活必需品流通・小売り	
PRIMORIS SERVICES CORP	46	128	761	108,648	資本財	
PRIMIS FINANCIAL CORP	-	47	60	8,601	銀行	
PRIMO WATER CORP	565	-	-	-	食品・飲料・タバコ	
PRIVIA HEALTH GROUP INC	64	225	438	62,581	ヘルスケア機器・サービス	
PROG HOLDINGS INC	67	72	355	50,689	金融サービス	
PROGYNY INC	175	109	179	25,624	ヘルスケア機器・サービス	
PROS HOLDINGS INC	17	6	11	1,659	ソフトウェア・サービス	
PROPETRO HOLDING CORP	227	218	180	25,711	エネルギー	
PROTAGONIST THERAPEUTICS INC	3	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PROVIDENT FINANCIAL SERVICES	-	155	301	43,099	銀行	
PUBMATIC INC-CLASS A	-	26	38	5,541	メディア・娯楽	
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	94	81	20	2,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
QUAKER HOUGHTON	28	2	44	6,324	素材	
Q2 HOLDINGS INC	286	24	195	27,909	ソフトウェア・サービス	
QUALYS INC	14	16	206	29,488	ソフトウェア・サービス	
QUINSTREET INC	40	23	47	6,818	メディア・娯楽	
RPC INC	52	210	137	19,651	エネルギー	
RMR GROUP INC/THE - A	2	-	-	-	不動産管理・開発	
RADIAN GROUP INC	25	-	-	-	金融サービス	
RADNET INC	74	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
RAMBUS INC	-	17	68	9,775	半導体・半導体製造装置	

銘柄	期首(前期末)	当期				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
RALPH LAUREN CORP	-	18	341	48,796	耐久消費財・アパレル	
RAPID7 INC	91	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
RAYONIER ADVANCED MATERIALS	57	-	-	-	素材	
ANYWHERE REAL ESTATE INC	252	80	46	6,638	不動産管理・開発	
RECURSION PHARMACEUTICALS-A	52	108	75	10,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RED VIOLET INC	-	59	179	25,563	ソフトウェア・サービス	
REGENXBIO INC	127	28	35	5,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGIONAL MANAGEMENT CORP	99	131	437	62,420	金融サービス	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	-	33	731	104,486	保険	
RELAY THERAPEUTICS INC	91	249	196	28,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REMITLY GLOBAL INC	15	-	-	-	金融サービス	
UPBOUND GROUP INC	36	89	277	39,648	一般消費財・サービス流通・小売り	
REPLIMUNE GROUP INC	60	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVANCE THERAPEUTICS INC	9	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVOLUTION MEDICINES INC	13	36	169	24,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVOLVE GROUP INC	191	25	66	9,513	一般消費財・サービス流通・小売り	
REX AMERICAN RESOURCES CORP	11	42	195	27,961	エネルギー	
RHYTHM PHARMACEUTICALS INC	-	6	33	4,765	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RIGEL PHARMACEUTICALS INC	626	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RIGEL PHARMACEUTICALS INC	-	61	84	12,113	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5	68	206	29,481	ソフトウェア・サービス	
RIVERVIEW BANCORP INC	582	395	184	26,268	銀行	
ROBERT HALF INC	-	23	155	22,245	商業・専門サービス	
ROKU INC	-	21	166	23,816	メディア・娯楽	
ROVER GROUP INC	53	-	-	-	消費者サービス	
RUSH ENTERPRISES INC-CL A	125	-	-	-	資本財	
RUSH STREET INTERACTIVE INC	-	46	48	6,931	消費者サービス	
RXSIGHT INC	-	10	57	8,228	ヘルスケア機器・サービス	
RYERSON HOLDING CORP	45	11	22	3,215	素材	
SJW GROUP	-	22	133	19,108	公益事業	
SM ENERGY CO	201	-	-	-	エネルギー	
SPX TECHNOLOGIES INC	8	-	-	-	資本財	
ST JOE CO/THE	-	88	541	77,241	不動産管理・開発	
SANA BIOTECHNOLOGY INC	8	53	24	3,514	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SANDY SPRING BANCORP INC	67	-	-	-	銀行	
JOHN B. SANFILIPPO & SON INC	-	3	31	4,546	食品・飲料・タバコ	
SANGAMO BIOSCIENCES INC	640	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SANMINA CORP	176	63	442	63,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	-	2	27	3,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RADIUS RECYCLING INC	93	-	-	-	素材	
SCHOLAR ROCK HOLDING CORP	-	43	37	5,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CONTRA SCILEX HOLDING CO	110	110	11	1,630	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCIPLAY CORP-CLASS A	0.42	-	-	-	メディア・娯楽	
EW SCRIPPS CO/THE-A	124	55	11	1,584	メディア・娯楽	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
SEACOAST BANKING CORP/FL	29	—	—	—	—	銀行
SEER INC	320	314	55	7,904	7,904	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SELECT MEDICAL HOLDINGS CORP	—	142	505	72,125	72,125	ヘルスケア機器・サービス
SELECTIVE INSURANCE GROUP	34	—	—	—	—	保険
SELECTQUOTE INC	47	—	—	—	—	保険
SEMTECH CORP	—	17	82	11,804	11,804	半導体・半導体製造装置
SEMRUSH HOLDINGS INC-A	183	24	37	5,373	5,373	ソフトウェア・サービス
SERVISFIRST BANCSHARES INC	—	20	175	25,093	25,093	銀行
SHATTUCK LABS INC	6	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHORE BANCSHARES INC	64	36	53	7,702	7,702	銀行
SOUNDTHINKING INC	—	70	93	13,354	13,354	ソフトウェア・サービス
SHUTTERSTOCK INC	52	—	—	—	—	メディア・娯楽
SHYFT GROUP INC/THE	—	22	29	4,156	4,156	資本財
SI-BONE INC	46	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SIGA TECHNOLOGIES INC	—	51	44	6,306	6,306	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SILICON LABORATORIES INC	15	16	190	27,136	27,136	半導体・半導体製造装置
SILVERCREST ASSET MANAGEME-A	—	141	242	34,662	34,662	金融サービス
SINGULAR GENOMICS SYSTEMS IN	11	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SITIME CORP	—	4	67	9,636	9,636	半導体・半導体製造装置
SKECHERS USA INC-CL A	—	17	109	15,669	15,669	耐久消費財・アパレル
SKYWEST INC	11	47	387	55,356	55,356	運輸
SMARTSHEET INC-CLASS A	—	17	89	12,773	12,773	ソフトウェア・サービス
SOMALOGIC INC	92	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTH PLAINS FINANCIAL INC	21	2	9	1,316	1,316	銀行
SOUTHERN FIRST BANCSHARES	43	43	149	21,406	21,406	銀行
SOUTHSIDE BANCSHARES INC	—	11	40	5,711	5,711	銀行
SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC	—	30	225	32,177	32,177	公益事業
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28	—	—	—	—	エネルギー
SOVOS BRANDS INC	18	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SPARTANNASH CO	40	—	—	—	—	生活必需品流通・小売り
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	3	28	4,126	4,126	家庭用品・パーソナル用品
SPIRIT AIRLINES INC	50	—	—	—	—	運輸
SPRINGWORKS THERAPEUTICS INC	—	5	20	2,967	2,967	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPROUTS FARMERS MARKET INC	—	54	575	82,127	82,127	生活必需品流通・小売り
SPRINKLR INC-A	54	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SPROUT SOCIAL INC - CLASS A	27	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SQUARESPACE INC - CLASS A	63	24	113	16,182	16,182	ソフトウェア・サービス
STAAR SURGICAL CO	53	17	56	8,102	8,102	ヘルスケア機器・サービス
STANDARD MOTOR PRODS	2	—	—	—	—	自動車・自動車部品
STAR HOLDINGS	14	—	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
STEELCASE INC-CL A	131	—	—	—	—	商業・専門サービス
STERLING INFRASTRUCTURE INC	15	26	397	56,773	56,773	資本財
STITCH FIX INC-CLASS A	191	216	90	12,924	12,924	一般消費財・サービス流通・小売り
STRATEGIC EDUCATION INC	—	5	51	7,308	7,308	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期			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	千米・ドル	千円	
(アメリカ)					
STRIDE INC	11	-	-	-	消費者サービス
SUMMIT FINANCIAL GROUP INC	3	-	-	-	銀行
SUMMIT MATERIALS INC -CL A	99	-	-	-	素材
SUN COUNTRY AIRLINES HOLDING	-	15	18	2,659	運輸
SUNOPTA INC	222	-	-	-	食品・飲料・タバコ
SUNRUN INC	-	20	39	5,628	資本財
SUPER MICRO COMPUTER INC	24	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC	176	111	358	51,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SURGERY PARTNERS INC	-	110	366	52,376	ヘルスケア機器・サービス
SURMODICS INC	-	5	21	3,121	ヘルスケア機器・サービス
SUTRO BIOPHARMA INC	191	191	75	10,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNAPTICS INC	20	94	726	103,774	半導体・半導体製造装置
SYNDAX PHARMACEUTICALS INC	100	113	211	30,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRI POINTE HOMES INC	165	87	403	57,657	耐久消費財・アパレル
TTM TECHNOLOGIES	-	161	292	41,766	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TACTILE SYSTEMS TECHNOLOGY I	49	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
TANDEM DIABETES CARE INC	-	33	149	21,327	ヘルスケア機器・サービス
TARSUS PHARMACEUTICALS INC	-	35	124	17,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TAYLOR MORRISON HOME CORP-A	175	13	95	13,592	耐久消費財・アパレル
TEGNA INC	93	74	112	16,103	メディア・娯楽
TELADOC HEALTH INC	-	198	181	25,981	ヘルスケア機器・サービス
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	47	29	68	9,752	電気通信サービス
TENABLE HOLDINGS INC	67	-	-	-	ソフトウェア・サービス
10X GENOMICS INC-CLASS A	-	43	101	14,510	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENNANT CO	28	-	-	-	資本財
TEREX CORP	103	-	-	-	資本財
TERNS PHARMACEUTICALS INC	-	13	13	1,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS ROADHOUSE INC	47	15	274	39,128	消費者サービス
TG THERAPEUTICS INC	25	129	327	46,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ODP CORP/THE	43	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
THERMON GROUP HOLDINGS INC	69	-	-	-	資本財
THIRD COAST BANCSHARES INC	-	31	86	12,391	銀行
THRYV HOLDINGS INC	146	153	289	41,314	メディア・娯楽
TIDEWATER INC	-	30	227	32,486	エネルギー
TIMBERLAND BANCORP INC	-	0.26	0	116	銀行
TIPTREE INC	57	77	156	22,272	保険
TOLL BROTHERS INC	-	68	1,050	150,021	耐久消費財・アパレル
TONIX PHARMACEUTICALS HOLDIN	-	0.01	0	0	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONIX PHARMACEUTICALS HOLDIN	0.01	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOWNE BANK	7	-	-	-	銀行
TRANSMEDICS GROUP INC	-	10	177	25,401	ヘルスケア機器・サービス
TRAVEL + LEISURE CO	-	26	118	16,963	消費者サービス
TRAVERE THERAPEUTICS INC	179	58	87	12,512	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TREDEGAR CORP	-	144	102	14,583	素材

銘柄	期首(前期末)	当期				業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
TRINET GROUP INC	5	21	212	30,289	商業・専門サービス	
TRINITY INDUSTRIES INC	19	13	45	6,431	資本財	
TRUECAR INC	240	240	79	11,365	メディア・娯楽	
TTEC HOLDINGS INC	10	—	—	—	商業・専門サービス	
TUTOR PERINI CORP	—	23	61	8,721	資本財	
2SEVENTY BIO INC	42	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TWIST BIOSCIENCE CORP	108	28	134	19,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
2U INC	86	—	—	—	消費者サービス	
UGI CORP	—	11	28	4,052	公益事業	
UMB FINANCIAL CORP	13	—	—	—	銀行	
UFP INDUSTRIES INC	58	39	523	74,719	資本財	
US SILICA HOLDINGS INC	212	—	—	—	エネルギー	
USCB FINANCIAL HOLDINGS INC	—	14	22	3,180	銀行	
ULTRA CLEAN HOLDINGS INC	—	22	79	11,404	半導体・半導体製造装置	
ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL IN	18	24	144	20,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNIFI INC	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
UNISYS CORP	71	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
UNITED BANKSHARES INC	47	—	—	—	銀行	
UNITED FIRE GROUP INC	—	2	5	811	保険	
US CELLULAR CORP	24	—	—	—	電気通信サービス	
UNIVERSAL INSURANCE HOLDINGS	—	11	25	3,620	保険	
UNIVEST FINANCIAL CORP	97	17	49	7,092	銀行	
UPLAND SOFTWARE INC	89	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
URBAN OUTFITTERS INC	121	62	234	33,461	一般消費財・サービス流通・小売り	
VALLEY NATIONAL BANCORP	—	431	402	57,528	銀行	
VANDA PHARMACEUTICALS INC	117	334	155	22,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VAREX IMAGING CORP	125	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
VARONIS SYSTEMS INC	135	95	525	75,005	ソフトウェア・サービス	
VECTOR GROUP LTD	—	56	84	12,024	食品・飲料・タバコ	
V2X INC	—	11	61	8,800	資本財	
VAXCYTE INC	21	38	454	64,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VELOCITY FINANCIAL INC	—	72	146	20,887	金融サービス	
VERACYTE INC	115	87	306	43,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERINT SYSTEMS INC	62	73	192	27,464	ソフトウェア・サービス	
VERITEX HOLDINGS INC	9	9	25	3,595	銀行	
VERICEL CORP	42	57	275	39,385	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERTEX INC - CLASS A	38	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
VERVE THERAPEUTICS INC	—	113	60	8,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIASAT INC	—	39	51	7,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VICOR CORP	3	—	—	—	資本財	
VICTORIA'S SECRET & CO	—	16	43	6,251	一般消費財・サービス流通・小売り	
VICTORY CAPITAL HOLDING - A	49	—	—	—	金融サービス	
VIEMED HEALTHCARE INC	—	86	64	9,189	ヘルスケア機器・サービス	
VIKING THERAPEUTICS INC	—	12	83	11,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額 千米・ドル	邦貨換算金額 千円		
(アメリカ)	百株	百株				
VIMEO INC	519	—	—	—	—	メディア・娯楽
VIR BIOTECHNOLOGY INC	48	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIRTU FINANCIAL INC-CLASS A	—	16	51	7,281	—	金融サービス
VISTEON CORP	59	26	248	35,534	—	自動車・自動車部品
VITAL FARMS INC	116	48	156	22,400	—	食品・飲料・タバコ
VIZIO HOLDING CORP-A	169	30	34	4,898	—	耐久消費財・アパレル
VOYAGER THERAPEUTICS INC	11	108	68	9,833	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WABASH NATIONAL CORP	67	5	11	1,596	—	資本財
WARBY PARKER INC-CLASS A	194	90	133	19,001	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WARRIOR MET COAL INC	—	6	37	5,284	—	素材
WASHINGTON TRUST BANCORP	46	—	—	—	—	銀行
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	54	29	612	87,416	—	資本財
WAYFAIR INC- CLASS A	—	36	199	28,457	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WEAVE COMMUNICATIONS INC	—	51	61	8,845	—	ソフトウェア・サービス
WESBANCO INC	7	—	—	—	—	銀行
WESCO INTERNATIONAL INC	23	23	62	8,863	—	資本財
WESTERN NEW ENGLAND BANCORP	4	—	—	—	—	銀行
WEWORK INC-CL A	38	—	—	—	—	不動産管理・開発
WINGSTOP INC	17	14	621	88,761	—	消費者サービス
WINMARK CORP	1	5	226	32,298	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WINNEBAGO INDUSTRIES	0.91	—	—	—	—	自動車・自動車部品
WORKIVA INC	6	60	475	67,882	—	ソフトウェア・サービス
WORLD KINECT CORP	227	57	176	25,213	—	エネルギー
XENCOR INC	96	57	122	17,484	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XYLEM INC	24	—	—	—	—	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	67	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XERIS BIOPHARMA HOLDINGS INC	13	13	4	587	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YELP INC	172	100	344	49,217	—	メディア・娯楽
YEXT INC	3	36	23	3,388	—	ソフトウェア・サービス
YETI HOLDINGS INC	—	107	429	61,296	—	耐久消費財・アパレル
ZETA GLOBAL HOLDINGS CORP-A	183	124	352	50,327	—	ソフトウェア・サービス
ZIPRECROUTER INC-A	165	229	224	32,050	—	メディア・娯楽
ZUMIEZ INC	111	115	272	38,961	—	一般消費財・サービス流通・小売り
ZURN ELKAY WATER SOLUTIONS C	—	103	363	51,929	—	資本財
ZUORA INC - CLASS A	292	159	140	20,095	—	ソフトウェア・サービス
ADIANT PLC	100	120	271	38,825	—	自動車・自動車部品
ALKERMES PLC	141	31	88	12,700	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMBARELLA INC	41	39	217	31,082	—	半導体・半導体製造装置
ARGO GROUP INTERNATIONAL	14	—	—	—	—	保険
BIOHAVEN LTD	—	1	6	934	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIT DIGITAL INC	160	123	37	5,383	—	ソフトウェア・サービス
BORR DRILLING LTD	358	—	—	—	—	エネルギー
CIMPRESS PLC	5	8	73	10,437	—	商業・専門サービス
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	—	68	198	28,335	—	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円		
ESSENT GROUP LTD	12	108	698	99,674	金融サービス	
FABRINET	26	25	598	85,487	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FRESH DEL MONTE PRODUCE INC	37	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
FTAI AVIATION LTD	—	16	208	29,762	資本財	
GAMBLING.COM GROUP LTD	30	—	—	—	メディア・娯楽	
HELEN OF TROY LTD	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
INVESCO LTD	—	126	218	31,238	金融サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	—	6	74	10,644	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KINKSA PHARMACEUTICALS INTE	—	88	231	33,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KINKSA PHARMACEUTICALS-A	12	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIVANOVA PLC	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LUXFER HOLDINGS PLC	—	33	42	6,091	資本財	
MEIRAGTX HOLDINGS PLC	—	2	0	131	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALPHA & OMEGA SEMICONDUCTOR	—	1	4	623	半導体・半導体製造装置	
NOBLE CORP PLC	—	134	487	69,559	エネルギー	
NORDIC AMERICAN TANKERS LTD	120	—	—	—	エネルギー	
NOVOCURE LTD	—	133	238	34,086	ヘルスケア機器・サービス	
PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A	251	85	82	11,722	金融サービス	
PATRIA INVESTMENTS LTD-A	116	—	—	—	金融サービス	
PROTHENA CORP PLC	3	1	2	408	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SFL CORP LTD	53	—	—	—	エネルギー	
SAPIENS INTERNATIONAL CORP	31	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
STONECO LTD-A	367	136	168	24,085	金融サービス	
SUPER GROUP SGHC LTD	71	77	28	4,103	消費者サービス	
LIBERTY LATIN AMERIC-CL A	41	27	26	3,745	電気通信サービス	
TRONOX HOLDINGS PLC	—	8	10	1,528	素材	
TRANSOCEAN LTD	—	116	52	7,540	エネルギー	
CAESARSTONE LTD	65	57	27	3,987	資本財	
BANCO LATINOAMERICANO COME-E	—	65	215	30,698	金融サービス	
ONESPAWORLD HOLDINGS LTD	33	—	—	—	消費者サービス	
ARDMORE SHIPPING CORP	159	0.01	0	2	エネルギー	
DHT HOLDINGS INC	308	—	—	—	エネルギー	
FLEX LTD	—	144	468	66,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GENCO SHIPPING & TRADING LTD	—	91	166	23,838	運輸	
INTERNATIONAL SEAWAYS INC	—	34	178	25,438	エネルギー	
NAVIGATOR HOLDINGS LTD	33	—	—	—	エネルギー	
SCORPIO TANKERS INC	32	16	113	16,207	エネルギー	
TEEKAY TANKERS LTD-CLASS A	6	—	—	—	エネルギー	
通貨小計	株数、金額 銘柄数(比率)	48,518 575銘柄	36,889 608銘柄	102,555 (91.8%)	14,640,882 (91.8%)	
合計	株数、金額 銘柄数(比率)	48,518 575銘柄	36,889 608銘柄	— (0.0%)	14,640,882 (91.8%)	

(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) 〈 〉内は、期末の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(2) 外国投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	口数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨	邦貨		
(アメリカ)	千口	千口	千米・ドル		千円	
ACADIA REALTY TRUST	18	-	-		-	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	26	10	284		40,573	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	13	-	-		-	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	0.527	-	-		-	
BRANDYWINE REALTY TRUST	8	27	147		21,047	
CARETRUST REIT INC	-	0.218	6		950	
CHATHAM LODGING TRUST	21	11	107		15,308	
CHIMERA INVESTMENT CORP	-	0.524	8		1,224	
COPT DEFENSE PROPERTIES	28	29	906		129,480	
CTO REALTY GROWTH INC	-	25	503		71,926	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	11	-	-		-	
EQUITY COMMONWEALTH	-	4	96		13,790	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	-	1	72		10,363	
GREAT AJAX CORP	9	-	-		-	
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	4	-	-		-	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1	-	-		-	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	20	-	-		-	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28	-	-		-	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	19	-	-		-	
KILROY REALTY CORP	-	14	610		87,184	
KITE REALTY GROUP TRUST	22	20	555		79,255	
LADDER CAPITAL CORP-REIT	7	-	-		-	
LAMAR ADVERTISING CO-A	-	4	535		76,482	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4	4	208		29,762	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	2	-	-		-	
OUTFRONT MEDIA INC	32	-	-		-	
PARAMOUNT GROUP INC	53	66	345		49,253	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	-	11	186		26,562	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	-	13	197		28,152	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23	-	-		-	
RLJ LODGING TRUST	95	45	451		64,446	
RPT REALTY	7	-	-		-	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	-	0.059	6		917	
SAUL CENTERS INC	-	0.974	39		5,653	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	-	20	140		20,121	

銘 柄	期 首(前期末)		当 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	千米・ドル	千円	
TPG RE FINANCE TRUST INC	-	4	41	5,912	
TANGER INC	-	8	268	38,282	
WASHINGTON REIT	4	-	-	-	
通貨小計	口 数 ・ 金 額	468	328	5,720	816,653
	銘 柄 数・〈比 率〉	24銘柄	22銘柄	-	〈5.1%〉
合 計	口 数 ・ 金 額	468	328	-	816,653
	銘 柄 数・〈比 率〉	24銘柄	22銘柄	-	〈5.1%〉

(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) 〈 〉は純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 単位未満切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(3) 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 RUSSELL 2000 MINI	百万円 357	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、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) 評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	14,640,882	91.2
投 資 証 券	816,653	5.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	597,282	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	16,054,818	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(15,943,727千円)の投資信託財産総額(16,054,818千円)に対する比率は、99.3%です。

(注2) 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。換算レートは、1米・ドル=142.76円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,192,475,494円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	471,706,674
株 式(評価額)	14,640,882,230
投 資 証 券(評価額)	816,653,412
未 収 入 金	241,064,620
未 収 配 当 金	10,478,298
差 入 委 託 証 拠 金	11,690,260
(B) 負 債	243,673,532
未 払 金	212,316,765
未 払 解 約 金	31,356,767
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,948,801,962
元 本	6,324,451,678
次 期 繰 越 損 益 金	9,624,350,284
(D) 受 益 権 総 口 数	6,324,451,678口
1万口当り基準価額(C/D)	25,218円

<注記事項>

期首元本額	7,993,167,314円
期中追加設定元本額	377,025,824円
期中一部解約元本額	2,045,741,460円

期末における元本の内訳

ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジなし)	4,348,380,370円
ブラックロック・米国小型株式 ビッグデータ戦略ファンド(為替ヘッジあり)	1,976,071,308円
合計	6,324,451,678円

■損益の状況

自2023年9月21日 至2024年9月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	210,643,670円
受 取 配 当 金	202,801,840
受 取 利 息	4,201,487
そ の 他 収 益 金	3,640,343
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,174,395,966
売 買 益	5,218,713,727
売 買 損	△2,044,317,761
(C) 先 物 取 引 等 損 益	43,361,494
取 引 益	100,442,845
取 引 損	△ 57,081,351
(D) そ の 他 費 用	△ 11,058,691
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,417,342,439
(F) 前期繰越損益金	8,304,076,186
(G) 解約差損益金	△2,588,442,721
(H) 追加信託差損益金	491,374,380
(I) 合計(E+F+G+H)	9,624,350,284
次 期 繰 越 損 益 金(I)	9,624,350,284

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益及び先物取引等損益は、期末の評価換えによるものを含まず。

(注2) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。