

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／海外／株式／インデックス型 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 無期限（2018年7月3日設定） | |
| 運用方針 | <p>S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として S & P 5 0 0 指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている米国の株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。</p> <p>実質組入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> | |
| 主要運用対象 | ベビーフンド | S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、米国の株式に直接投資することがあります。 |
| | マザーファンド | 米国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーフンド | 株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| 分配方針 | <p>経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）</p> </div> | |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 ファンドは「つみたてNISA（非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
 イーマックス

eMAXIS Slim
米国株式（S & P 5 0 0）

第3期（決算日：2021年4月26日）

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、お手持ちの「eMAXIS Slim 米国株式（S & P 5 0 0）」は、去る4月26日に第3期の決算を行いました。ここに謹ん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き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
 フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | S & P 5 0 0 指数 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|----------------|--------|------------|-------|-------------------|-------|--------|--------|------------|---------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中騰落率 | (配当込み、 円換算ベース) | 期中騰落率 | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 2018年7月3日 | 10,000 | — | — | 17,626 | — | — | — | — | 1 |
| 1期(2019年4月25日) | 11,035 | 0 | 10.4 | 19,441 | 10.3 | 92.3 | 5.3 | 2.7 | 17,010 |
| 2期(2020年4月27日) | 10,409 | 0 | △ 5.7 | 18,309 | △ 5.8 | 94.3 | 3.0 | 2.8 | 85,180 |
| 3期(2021年4月26日) | 15,592 | 0 | 49.8 | 27,370 | 49.5 | 95.5 | 2.5 | 2.4 | 385,902 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) S & P 5 0 0[®]指数とは、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックス L L C が公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S & P 5 0 0 指数 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 指数 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。

S & P 5 0 0 指数は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 5 0 0 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|-------------------|-------|-----------|-----------|---------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配当込み、 円換算ベース) | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2020年4月27日 | 10,409 | — | 18,309 | — | 94.3 | 3.0 | 2.8 |
| 4月末 | 10,714 | 2.9 | 18,845 | 2.9 | 92.8 | 4.7 | 2.7 |
| 5月末 | 11,130 | 6.9 | 19,572 | 6.9 | 93.3 | 3.9 | 2.7 |
| 6月末 | 11,252 | 8.1 | 19,784 | 8.1 | 93.3 | 4.0 | 2.7 |
| 7月末 | 11,626 | 11.7 | 20,438 | 11.6 | 93.9 | 3.9 | 2.7 |
| 8月末 | 12,669 | 21.7 | 22,273 | 21.6 | 92.7 | 4.7 | 2.4 |
| 9月末 | 12,113 | 16.4 | 21,287 | 16.3 | 92.6 | 5.0 | 2.5 |
| 10月末 | 11,892 | 14.2 | 20,900 | 14.2 | 93.8 | 4.2 | 2.4 |
| 11月末 | 13,000 | 24.9 | 22,844 | 24.8 | 93.6 | 4.3 | 2.4 |
| 12月末 | 13,288 | 27.7 | 23,333 | 27.4 | 94.0 | 3.8 | 2.3 |
| 2021年1月末 | 13,641 | 31.1 | 23,954 | 30.8 | 94.2 | 4.2 | 2.3 |
| 2月末 | 14,043 | 34.9 | 24,655 | 34.7 | 94.0 | 4.2 | 2.3 |
| 3月末 | 15,142 | 45.5 | 26,581 | 45.2 | 93.2 | 4.6 | 2.3 |
| (期 末) | | | | | | | |
| 2021年4月26日 | 15,592 | 49.8 | 27,370 | 49.5 | 95.5 | 2.5 | 2.4 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第3期：2020年4月28日～2021年4月26日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|---------|
| 第3期首 | 10,409円 |
| 第3期末 | 15,592円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | 49.8% |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※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、受益者のみな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。従って、各個人の受益者のみな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。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ49.8%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（49.5%）を0.3%上回りました。

> 基準価額の主な変動要因**上昇要因**

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

第3期：2020年4月28日～2021年4月26日

投資環境について

▶ 米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、主要国の経済対策への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは円に対して上昇しました。

為替市況は、期首に比べて0.3%の円安・米ドル高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

S & P 5 0 0 指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

株式の業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

ベンチマークとの乖離は0.3%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.1%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.4%程度でした。

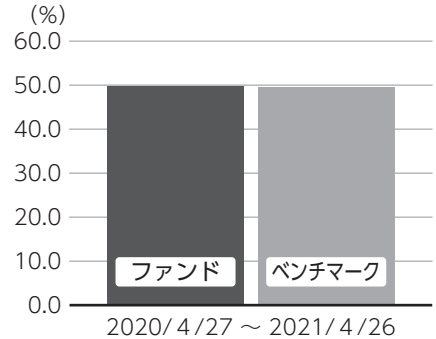
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

基準価額 (ベビーファンド) と ベンチマークの対比 (騰落率)



▶ 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目 | 第3期 2020年4月28日～2021年4月26日 |
|-----------------|------------------------------|
| 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 | 5,591 |

(注) 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) に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶ eMAXIS Slim 米国株式 (S&P500)

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ S&P500 インデックス マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2020年4月28日～2021年4月26日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 13 | 0.098 | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数) |
| (投 信 会 社) | (5) | (0.037) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| (販 売 会 社) | (5) | (0.038) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受 託 会 社) | (3) | (0.022) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.007 | (b) 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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株 式) | (1) | (0.005) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.002) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.000 | (c) 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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.019 | (d) 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) | (2) | (0.013) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.002) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 16 | 0.124 | |

期中の平均基準価額は、12,840円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

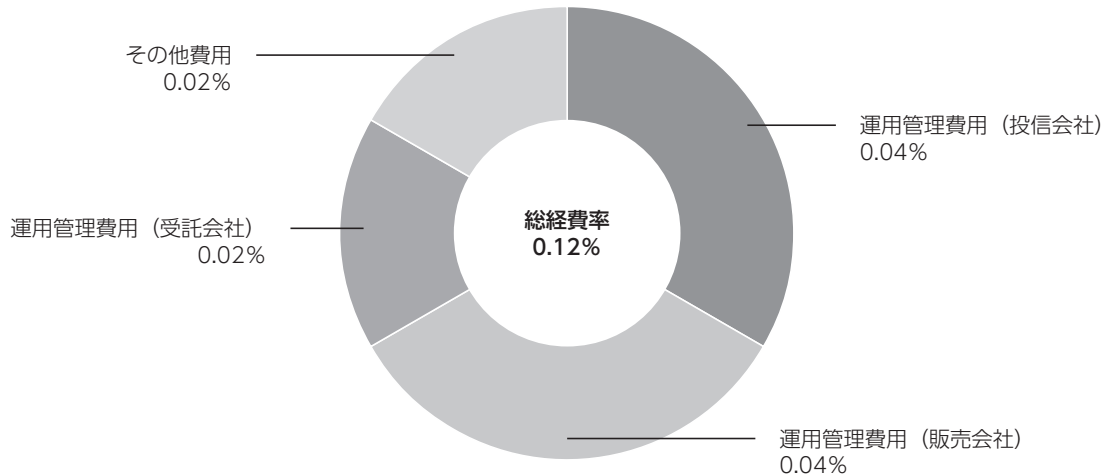
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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0.12%**です。



(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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

(2020年4月28日～2021年4月26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 |
| S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | 千口 92,955,165 | 千円 219,475,545 | 千口 353,356 | 千円 782,231 |

○株式売買比率

(2020年4月28日～2021年4月26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 | |
|---------------------|---------------------------|--|
| | S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 222,490,082千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 198,258,162千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.12 | |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月28日～2021年4月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS Slim 米国株式 (S & P 5 0 0) >

該当事項はございません。

< S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド >

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
|--------|----------------|--------------------|-----------|---------------|--------------------|------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 百万円 237,212 | 百万円 236,228 | % 99.6 | 百万円 13,827 | 百万円 13,827 | % 100.0 |

平均保有割合 87.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021年4月26日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | 千口 45,812,703 | 千口 138,414,512 | 千円 385,858,136 |

○投資信託財産の構成

(2021年4月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | 比 率 |
|---------------------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | |
| S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | 千円 385,858,136 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 1,017,586 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 386,875,722 | 100.0 |

(注) S & P 5 0 0 インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (421,282,253千円) の投資信託財産総額 (423,424,359千円) に対する比率は99.5%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | | |
|-----------------|--|--|--|
| 1アメリカドル=107.89円 | | | |
|-----------------|--|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年4月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 386,875,722,504 |
| コール・ローン等 | 1,017,585,958 |
| S&P500インデックスマザーファンド(評価額) | 385,858,136,546 |
| (B) 負債 | 973,029,119 |
| 未払解約金 | 842,812,828 |
| 未払信託報酬 | 125,816,140 |
| 未払利息 | 151 |
| その他未払費用 | 4,400,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 385,902,693,385 |
| 元本 | 247,502,553,530 |
| 次期繰越損益金 | 138,400,139,855 |
| (D) 受益権総口数 | 247,502,553,530口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,592円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 81,836,195,311円
 期中追加設定元本額 223,129,104,183円
 期中一部解約元本額 57,462,745,964円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5592円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2020年4月28日～ 2021年4月26日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 2,763,804,091円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 67,376,917,845円 |
| 収益調整金額 | 67,392,553,047円 |
| 分配準備積立金額 | 866,864,872円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 138,400,139,855円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 5,591円 |
| 1万口当たり分配金額 | —円 |
| 収益分配金金額 | —円 |

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

○損益の状況 (2020年4月28日～2021年4月26日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 116,377 |
| 受取利息 | 2,485 |
| 支払利息 | △ 118,862 |
| (B) 有価証券売買損益 | 72,620,284,787 |
| 売買益 | 82,017,579,447 |
| 売買損 | △ 9,397,294,660 |
| (C) 信託報酬等 | △ 195,201,976 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 72,424,966,434 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 1,417,379,626 |
| (F) 追加信託差損益金 | 67,392,553,047 |
| (配当等相当額) | (20,833,669,236) |
| (売買損益相当額) | (46,558,883,811) |
| (G) 計(D+E+F) | 138,400,139,855 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 138,400,139,855 |
| 追加信託差損益金 | 67,392,553,047 |
| (配当等相当額) | (21,110,402,038) |
| (売買損益相当額) | (46,282,151,009) |
| 分配準備積立金 | 71,007,586,808 |

- (注) (B)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) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

《第15期》決算日2021年2月25日

[計算期間：2020年8月26日～2021年2月25日]

「S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド」は、2月25日に第15期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主として対象インデックスに採用されている米国の株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入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。 |
| 主要運用対象 | 米国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 5 0 0 指数 | | 株式組入比率 | 株先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|----------------|-------|--------|-------|------------|---------|
| | 円 | % | (配当込み、円換算ベース) | % | | | | |
| 11期(2019年2月25日) | 18,478 | △ 2.4 | 18,260 | △ 2.5 | 94.4 | 3.0 | 2.8 | 36,436 |
| 12期(2019年8月26日) | 18,029 | △ 2.4 | 17,783 | △ 2.6 | 93.7 | 3.3 | 3.0 | 40,945 |
| 13期(2020年2月25日) | 21,735 | 20.6 | 21,412 | 20.4 | 93.5 | 3.5 | 3.0 | 77,181 |
| 14期(2020年8月25日) | 22,276 | 2.5 | 21,918 | 2.4 | 94.1 | 3.9 | 2.5 | 168,252 |
| 15期(2021年2月25日) | 25,684 | 15.3 | 25,226 | 15.1 | 94.5 | 3.7 | 2.3 | 324,911 |

(注) S & P 5 0 0[®]指数とは、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックス L L C が公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S & P 5 0 0 指数 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 指数 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。

S & P 5 0 0 指数は、S & P Globalの一部門であるS & P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJII」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、S & P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC (「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJII、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 5 0 0 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|---------------------------|-------|-----------|-----------|-----------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配 当 込 み、 円 換 算 ベ ー ス) | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2020年8月25日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| 8 月 末 | 22,276 | — | 21,918 | — | 94.1 | 3.9 | 2.5 |
| 9 月 末 | 22,637 | 1.6 | 22,273 | 1.6 | 92.8 | 4.7 | 2.4 |
| 10 月 末 | 21,644 | △ 2.8 | 21,287 | △ 2.9 | 92.6 | 5.0 | 2.5 |
| 11 月 末 | 21,252 | △ 4.6 | 20,900 | △ 4.6 | 93.8 | 4.2 | 2.4 |
| 12 月 末 | 23,233 | 4.3 | 22,844 | 4.2 | 93.6 | 4.3 | 2.4 |
| 2021年1月末 | 23,750 | 6.6 | 23,333 | 6.5 | 94.0 | 3.8 | 2.3 |
| (期 末) 2021年2月25日 | 24,384 | 9.5 | 23,954 | 9.3 | 94.2 | 4.2 | 2.3 |
| | 25,684 | 15.3 | 25,226 | 15.1 | 94.5 | 3.7 | 2.3 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ15.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(15.1%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

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

● 投資環境について

◎ 米国株式市況

- ・米国株式市況は上昇しました。
- ・主要国の経済対策への期待や新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道等が支援材料となり上昇しました。

◎ 為替市況

- ・米ドルは円に対してほぼ横ばいに推移しました。
- ・為替市況は、期首に比べて米ドルは対円でほぼ横ばいに推移しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・S & P 5 0 0 指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・株式の業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークとのカイ離は0.2%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。

※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・組入要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年8月26日～2021年2月25日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|-----------------------------|---|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 円 1 (1) (0) (0) | % 0.004 (0.003) (0.000) (0.001) | (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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) (0) | 0.000 (0.000) (0.000) | (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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 2 (1) (0) | 0.007 (0.006) (0.002) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 3 | 0.011 | |
| 期中の平均基準価額は、23,210円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年8月26日～2021年2月25日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|------|----------|-----------|-------|----------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 | 千アメリカドル | 百株 | 千アメリカドル |
| | | 104,782 | 1,099,069 | 2,035 | 12,374 |
| | | (8,080) | (△ 84) | (82) | (1,045) |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および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。

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 | 株式先物取引 | 百万円 94,977 | 百万円 91,042 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2020年8月26日～2021年2月25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 | 116,492,351千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 206,573,019千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.56 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年8月26日～2021年2月25日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|----------------|----------------|------------|----------------|---------------|------------|
| | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 124,530 | 百万円 124,530 | % 100.0 | 百万円 5,863 | 百万円 5,863 | % 100.0 |

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年2月25日現在)

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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 360 | 584 | 8,178 | 867,370 | 各種金融 |
| ABBOTT LABORATORIES | 956 | 1,588 | 19,442 | 2,062,020 | ヘルスケア機器・サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 165 | 278 | 3,482 | 369,306 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 234 | 385 | 6,801 | 721,344 | ソフトウェア・サービス |
| AES CORP | 352 | 585 | 1,638 | 173,812 | 公益事業 |
| AFLAC INC | 396 | 580 | 2,892 | 306,788 | 保険 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 475 | 762 | 3,462 | 367,207 | 保険 |
| APACHE CORP | 219 | 348 | 724 | 76,864 | エネルギー |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 634 | 1,078 | 9,372 | 994,054 | 半導体・半導体製造装置 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 344 | 567 | 14,723 | 1,561,621 | ソフトウェア・サービス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 120 | 198 | 5,215 | 553,177 | 素材 |
| ALASKA AIR GROUP INC | 62 | 110 | 746 | 79,206 | 運輸 |
| ANTHEM INC | 137 | 223 | 6,823 | 723,689 | ヘルスケア機器・サービス |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 781 | 1,286 | 5,086 | 539,459 | ヘルスケア機器・サービス |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 271 | 464 | 3,646 | 386,728 | ヘルスケア機器・サービス |
| BOEING CO/THE | 290 | 475 | 10,908 | 1,156,985 | 資本財 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 160 | 259 | 6,413 | 680,239 | ヘルスケア機器・サービス |
| BEST BUY CO INC | 124 | 201 | 2,280 | 241,886 | 小売 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,223 | 2,025 | 12,677 | 1,344,606 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC | 83 | 127 | 9,052 | 960,153 | 各種金融 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 2,237 | 3,709 | 21,186 | 2,247,081 | 電気通信サービス |
| BALL CORP | 174 | 285 | 2,461 | 261,022 | 素材 |
| ALLSTATE CORP | 168 | 268 | 2,914 | 309,095 | 保険 |
| EVERETT DENNISON CORP | 47 | 72 | 1,313 | 139,305 | 素材 |
| CHUBB LTD | 241 | 404 | 6,904 | 732,315 | 保険 |
| ANALOG DEVICES INC | 196 | 331 | 5,357 | 568,198 | 半導体・半導体製造装置 |
| AUTOZONE INC | 12 | 20 | 2,464 | 261,353 | 小売 |
| CVS HEALTH CORP | 709 | 1,173 | 8,259 | 876,021 | ヘルスケア機器・サービス |
| CORNING INC | 405 | 666 | 2,574 | 273,018 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,647 | 2,732 | 41,874 | 4,441,221 | 銀行 |
| CATERPILLAR INC | 294 | 486 | 10,833 | 1,148,966 | 資本財 |
| COCA-COLA CO/THE | 2,089 | 3,466 | 17,580 | 1,864,555 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 248 | 411 | 5,127 | 543,870 | 各種金融 |
| CAMPBELL SOUP CO | 93 | 178 | 827 | 87,751 | 食品・飲料・タバコ |
| CSX CORP | 409 | 685 | 6,400 | 678,848 | 運輸 |
| CHEVRON CORP | 1,009 | 1,725 | 17,826 | 1,890,673 | エネルギー |
| TAPESTRY INC | 150 | 241 | 1,008 | 106,981 | 耐久消費財・アパレル |
| CONOCOPHILLIPS | 573 | 1,214 | 6,637 | 704,012 | エネルギー |
| CME GROUP INC | 195 | 321 | 6,458 | 684,948 | 各種金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 154 | 261 | 1,372 | 145,595 | ヘルスケア機器・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 466 | 768 | 5,888 | 624,532 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| DOMINION ENERGY INC | 456 | 731 | 5,204 | 551,976 | 公益事業 |
| DEVON ENERGY CORP | 222 | 516 | 1,149 | 121,879 | エネルギー |
| DEERE & CO | 170 | 280 | 9,709 | 1,029,762 | 資本財 |
| DANAHER CORP | 340 | 566 | 12,637 | 1,340,347 | ヘルスケア機器・サービス |
| WALT DISNEY CO/THE | 976 | 1,622 | 32,052 | 3,399,489 | メディア・娯楽 |

| 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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 72 | 115 | 1,597 | 169,474 | 消費者サービス |
| DUKE ENERGY CORP | 400 | 659 | 5,761 | 611,080 | 公益事業 |
| DR HORTON INC | 178 | 289 | 2,315 | 245,550 | 耐久消費財・アパレル |
| TARGET CORP | 271 | 448 | 8,397 | 890,634 | 小売 |
| DAVITA INC | 49 | 64 | 668 | 70,865 | ヘルスケア機器・サービス |
| DOVER CORP | 78 | 126 | 1,587 | 168,378 | 資本財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 103 | 168 | 2,091 | 221,843 | 公益事業 |
| EXXON MOBIL CORP | 2,285 | 3,789 | 21,489 | 2,279,149 | エネルギー |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 330 | 560 | 4,730 | 501,731 | ヘルスケア機器・サービス |
| EOG RESOURCES INC | 306 | 517 | 3,743 | 397,041 | エネルギー |
| EMERSON ELECTRIC CO | 319 | 539 | 4,796 | 508,665 | 資本財 |
| EXELON CORP | 519 | 886 | 3,561 | 377,734 | 公益事業 |
| ECOLAB INC | 131 | 223 | 4,824 | 511,663 | 素材 |
| EQUIFAX INC | 65 | 106 | 1,811 | 192,088 | 商業・専門サービス |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 119 | 203 | 5,976 | 633,906 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| EATON CORP PLC | 213 | 359 | 4,772 | 506,129 | 資本財 |
| EDISON INTERNATIONAL | 204 | 330 | 1,864 | 197,727 | 公益事業 |
| ENTERGY CORP | 109 | 174 | 1,571 | 166,645 | 公益事業 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 20 | 35 | 857 | 90,998 | 保険 |
| NEXTERA ENERGY INC | 264 | 1,756 | 12,952 | 1,373,731 | 公益事業 |
| FEDEX CORP | 128 | 216 | 5,631 | 597,259 | 運輸 |
| FORD MOTOR CO | 2,083 | 3,538 | 4,341 | 460,448 | 自動車・自動車部品 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 160 | 244 | 681 | 72,314 | 各種金融 |
| FIRSTENERGY CORP | 283 | 480 | 1,645 | 174,562 | 公益事業 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 797 | 1,314 | 4,982 | 528,395 | 素材 |
| GENERAL MILLS INC | 322 | 559 | 3,142 | 333,339 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 125 | 211 | 3,559 | 377,468 | 資本財 |
| WW GRAINGER INC | 22 | 39 | 1,523 | 161,529 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 4,786 | 7,851 | 10,301 | 1,092,601 | 資本財 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 159 | 268 | 5,480 | 581,290 | ソフトウェア・サービス |
| GENUINE PARTS CO | 80 | 122 | 1,300 | 137,952 | 小売 |
| GAP INC/THE | 128 | 160 | 417 | 44,256 | 小売 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 168 | 308 | 10,197 | 1,081,522 | 各種金融 |
| HALLIBURTON CO | 485 | 778 | 1,733 | 183,892 | エネルギー |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 379 | 628 | 13,272 | 1,407,728 | 資本財 |
| HP INC | 775 | 1,213 | 3,394 | 359,996 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 202 | 320 | 1,701 | 180,482 | 保険 |
| HERSFORD CO/THE | 80 | 128 | 1,898 | 201,400 | 食品・飲料・タバコ |
| HOME DEPOT INC | 581 | 965 | 25,087 | 2,660,765 | 小売 |
| HASBRO INC | 72 | 110 | 1,001 | 106,215 | 耐久消費財・アパレル |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 127 | 219 | 3,406 | 361,344 | 資本財 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 480 | 798 | 9,840 | 1,043,713 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 206 | 342 | 1,741 | 184,727 | 素材 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 157 | 258 | 5,252 | 557,098 | 資本財 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 197 | 340 | 918 | 97,417 | メディア・娯楽 |
| IDEX CORP | 42 | 67 | 1,327 | 140,754 | 資本財 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 55 | 228 | 3,149 | 334,069 | 素材 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,424 | 2,359 | 38,366 | 4,069,119 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 49 | 81 | 1,792 | 190,158 | 運輸 |
| KELLOGG CO | 135 | 221 | 1,300 | 137,899 | 食品・飲料・タバコ |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 186 | 307 | 4,028 | 427,226 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 774 | 1,281 | 6,964 | 738,678 | 食品・飲料・タバコ |

| 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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| KROGER CO | 418 | 675 | 2,211 | 234,583 | 食品・生活必需品小売り |
| KOHL'S CORP | 103 | — | — | — | 小売 |
| ELI LILLY & CO | 455 | 711 | 14,555 | 1,543,711 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 54 | 84 | 2,077 | 220,289 | ヘルスケア機器・サービス |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 285 | 514 | 3,052 | 323,740 | 運輸 |
| LENNAR CORP-A | 146 | 239 | 2,069 | 219,507 | 耐久消費財・アパレル |
| LOWE'S COS INC | 408 | 656 | 10,660 | 1,130,620 | 小売 |
| LEGGETT & PLATT INC | 73 | 115 | 513 | 54,508 | 耐久消費財・アパレル |
| L BRANDS INC | 133 | 203 | 1,052 | 111,619 | 小売 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 187 | 290 | 1,884 | 199,819 | 消費者サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 133 | 220 | 7,647 | 811,101 | 資本財 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 100 | 161 | 956 | 101,454 | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 144 | 235 | 3,710 | 393,523 | 消費者サービス |
| MCDONALD'S CORP | 402 | 667 | 14,243 | 1,510,705 | 消費者サービス |
| S&P GLOBAL INC | 130 | 215 | 7,155 | 758,899 | 各種金融 |
| MEDTRONIC PLC | 725 | 1,206 | 14,326 | 1,519,426 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCK & CO. INC. | 1,364 | 2,267 | 16,910 | 1,793,579 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 593 | 997 | 9,232 | 979,147 | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CO | 311 | 517 | 9,184 | 974,074 | 資本財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 90 | 147 | 2,677 | 283,970 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 276 | 357 | 1,381 | 146,499 | 消費者サービス |
| MASCO CORP | 140 | 223 | 1,202 | 127,496 | 資本財 |
| M & T BANK CORP | 69 | 112 | 1,816 | 192,658 | 銀行 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 278 | 454 | 5,410 | 573,878 | 保険 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 32 | 52 | 954 | 101,226 | 耐久消費財・アパレル |
| MORGAN STANLEY | 653 | 1,281 | 10,233 | 1,085,382 | 各種金融 |
| MCKESSON CORP | 86 | 140 | 2,538 | 269,263 | ヘルスケア機器・サービス |
| METLIFE INC | 421 | 693 | 4,133 | 438,357 | 保険 |
| MOODY'S CORP | 85 | 146 | 4,072 | 431,948 | 各種金融 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 137 | 227 | 5,959 | 632,084 | 運輸 |
| BANK OF AMERICA CORP | 4,221 | 6,823 | 24,824 | 2,632,883 | 銀行 |
| NISOURCE INC | 199 | 334 | 741 | 78,626 | 公益事業 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 82 | 140 | 4,231 | 448,788 | 資本財 |
| NEWMONT CORP | 433 | 725 | 4,143 | 439,483 | 素材 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 68 | 216 | 1,839 | 195,086 | 食品・飲料・タバコ |
| NUCOR CORP | 166 | 257 | 1,623 | 172,164 | 素材 |
| NEWELL BRANDS INC | 210 | 329 | 803 | 85,201 | 耐久消費財・アパレル |
| NOBLE ENERGY INC | 278 | — | — | — | エネルギー |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 464 | 730 | 2,058 | 218,318 | エネルギー |
| OMNICOM GROUP | 121 | 187 | 1,329 | 140,953 | メディア・娯楽 |
| PEPSICO INC | 750 | 1,238 | 16,362 | 1,735,380 | 食品・飲料・タバコ |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 49 | 82 | 1,103 | 117,047 | 素材 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,008 | 1,665 | 7,496 | 795,036 | 食品・飲料・タバコ |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 65 | 98 | 717 | 76,100 | 公益事業 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1,338 | 2,222 | 28,373 | 3,009,315 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 227 | 379 | 6,778 | 718,926 | 銀行 |
| PFIZER INC | 3,003 | 4,982 | 16,815 | 1,783,419 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 211 | 350 | 3,153 | 334,470 | 保険 |
| PULTEGROUP INC | 134 | 233 | 1,097 | 116,361 | 耐久消費財・アパレル |
| PARKER HANNIFIN CORP | 70 | 117 | 3,497 | 370,934 | 資本財 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 92 | 181 | 2,721 | 288,593 | エネルギー |
| CITIGROUP INC | 1,127 | 1,866 | 12,801 | 1,357,772 | 銀行 |

| 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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 145 | 220 | 1,333 | 141,465 | 保険 |
| PPG INDUSTRIES INC | 129 | 216 | 2,967 | 314,718 | 素材 |
| PENTAIR PLC | 86 | 146 | 837 | 88,798 | 資本財 |
| PPL CORP | 409 | 670 | 1,843 | 195,510 | 公益事業 |
| PROGRESSIVE CORP | 312 | 527 | 4,629 | 491,024 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 271 | 441 | 2,472 | 262,278 | 公益事業 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 93 | 159 | 1,544 | 163,771 | 消費者サービス |
| REPUBLIC SERVICES INC | 109 | 183 | 1,643 | 174,331 | 商業・専門サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 497 | 895 | 1,989 | 211,044 | 銀行 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 55 | 95 | 3,607 | 382,611 | 資本財 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 306 | 475 | 988 | 104,879 | 公益事業 |
| ROBERT HALF INTL INC | 58 | 103 | 847 | 89,907 | 商業・専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 62 | 101 | 2,503 | 265,495 | 資本財 |
| SCHLUMBERGER LTD | 758 | 1,234 | 3,629 | 384,915 | エネルギー |
| STRYKER CORP | 176 | 293 | 7,291 | 773,354 | ヘルスケア機器・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 611 | 1,337 | 8,616 | 913,828 | 各種金融 |
| SEMPRA ENERGY | 157 | 263 | 3,230 | 342,622 | 公益事業 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 44 | 73 | 4,997 | 530,006 | 素材 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 82 | 139 | 2,445 | 259,353 | 資本財 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 137 | 231 | 3,489 | 370,074 | 保険 |
| SOUTHERN CO/THE | 576 | 946 | 5,527 | 586,219 | 公益事業 |
| AT&T INC | 3,852 | 6,387 | 18,766 | 1,990,344 | 電気通信サービス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 155 | 283 | 1,996 | 211,800 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| STATE STREET CORP | 192 | 307 | 2,363 | 250,707 | 各種金融 |
| SYSCO CORP | 274 | 463 | 3,755 | 398,337 | 食品・生活必需品小売り |
| SEALED AIR CORP | 82 | 138 | 597 | 63,390 | 素材 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 496 | 822 | 14,760 | 1,565,467 | 半導体・半導体製造装置 |
| TIFFANY & CO | 59 | — | — | — | 小売 |
| TERADYNE INC | — | 144 | 1,943 | 206,124 | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBE LIFE INC | 49 | 84 | 833 | 88,354 | 保険 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 396 | 659 | 3,697 | 392,209 | 資本財 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 213 | 355 | 16,223 | 1,720,643 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC | 127 | 194 | 1,041 | 110,435 | 資本財 |
| UNION PACIFIC CORP | 366 | 604 | 12,753 | 1,352,676 | 運輸 |
| UNUM GROUP | 122 | 180 | 500 | 53,093 | 保険 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 798 | 1,361 | 10,573 | 1,121,395 | 資本財 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 512 | 828 | 28,253 | 2,996,597 | ヘルスケア機器・サービス |
| US BANCORP | 733 | 1,228 | 6,489 | 688,237 | 銀行 |
| MARATHON OIL CORP | 362 | 703 | 833 | 88,370 | エネルギー |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 380 | 641 | 10,261 | 1,088,380 | 運輸 |
| VALERO ENERGY CORP | 216 | 355 | 2,779 | 294,837 | エネルギー |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 51 | 85 | 1,508 | 159,977 | ヘルスケア機器・サービス |
| VIACOMCBS INC - CLASS B | 302 | 518 | 3,400 | 360,616 | メディア・娯楽 |
| VF CORP | 173 | 278 | 2,286 | 242,464 | 耐久消費財・アパレル |
| VULCAN MATERIALS CO | 71 | 115 | 2,012 | 213,480 | 素材 |
| WILLIAMS COS INC | 644 | 1,058 | 2,530 | 268,421 | エネルギー |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 401 | 633 | 3,114 | 330,337 | 食品・生活必需品小売り |
| WEC ENERGY GROUP INC | 167 | 275 | 2,254 | 239,065 | 公益事業 |
| WALMART INC | 765 | 1,242 | 16,553 | 1,755,661 | 食品・生活必需品小売り |
| WELLS FARGO & CO | 2,025 | 3,705 | 14,190 | 1,505,004 | 銀行 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 207 | 352 | 3,940 | 417,954 | 商業・専門サービス |
| WATERS CORP | 32 | 55 | 1,553 | 164,728 | 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 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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| WHIRLPOOL CORP | 32 | 53 | 1,034 | 109,684 | 耐久消費財・アパレル |
| XCEL ENERGY INC | 279 | 482 | 2,905 | 308,118 | 公益事業 |
| KEYCORP | 500 | 858 | 1,849 | 196,108 | 銀行 |
| CARMAX INC | 87 | 143 | 1,743 | 184,944 | 小売 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 110 | 183 | 3,003 | 318,573 | ヘルスケア機器・サービス |
| YUM! BRANDS INC | 162 | 267 | 2,801 | 297,143 | 消費者サービス |
| TJX COMPANIES INC | 652 | 1,076 | 7,518 | 797,387 | 小売 |
| CLOROX COMPANY | 67 | 109 | 2,015 | 213,720 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CELANESE CORP | 62 | 103 | 1,467 | 155,668 | 素材 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 151 | 253 | 3,534 | 374,847 | ソフトウェア・サービス |
| CARNIVAL CORP | 252 | 701 | 1,895 | 201,008 | 消費者サービス |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 334 | 556 | 7,755 | 822,549 | ソフトウェア・サービス |
| CONAGRA BRANDS INC | 255 | 429 | 1,514 | 160,628 | 食品・飲料・タバコ |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 181 | 298 | 1,988 | 210,928 | 公益事業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 381 | 621 | 2,252 | 238,896 | 銀行 |
| INTEL CORP | 2,289 | 3,673 | 23,211 | 2,461,786 | 半導体・半導体製造装置 |
| CISCO SYSTEMS INC | 2,292 | 3,787 | 17,324 | 1,837,410 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINTAS CORP | 45 | 76 | 2,593 | 275,029 | 商業・専門サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 238 | 395 | 13,474 | 1,429,125 | 食品・生活必需品小売り |
| APPLIED MATERIALS INC | 499 | 818 | 10,053 | 1,066,271 | 半導体・半導体製造装置 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 154 | 263 | 3,622 | 384,158 | メディア・娯楽 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 162 | 257 | 1,770 | 187,816 | 食品・飲料・タバコ |
| NORTONLIFELOCK INC | 303 | 516 | 1,060 | 112,514 | ソフトウェア・サービス |
| ROSS STORES INC | 192 | 323 | 3,992 | 423,468 | 小売 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 131 | 236 | 3,717 | 394,316 | 半導体・半導体製造装置 |
| NIKE INC -CL B | 670 | 1,124 | 15,257 | 1,618,182 | 耐久消費財・アパレル |
| AMGEN INC | 318 | 521 | 12,001 | 1,272,886 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COMERICA INC | 72 | 121 | 874 | 92,726 | 銀行 |
| NORTHERN TRUST CORP | 108 | 181 | 1,820 | 193,039 | 各種金融 |
| MICROSOFT CORP | 4,099 | 6,761 | 158,602 | 16,821,328 | ソフトウェア・サービス |
| ANSYS INC | 47 | 78 | 3,029 | 321,256 | ソフトウェア・サービス |
| CENTENE CORP | 311 | 530 | 3,150 | 334,152 | ヘルスケア機器・サービス |
| STARBUCKS CORP | 633 | 1,052 | 10,981 | 1,164,676 | 消費者サービス |
| ORACLE CORP | 1,125 | 1,700 | 11,000 | 1,166,725 | ソフトウェア・サービス |
| NETFLIX INC | 237 | 396 | 21,915 | 2,324,308 | メディア・娯楽 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 39 | 66 | 3,037 | 322,153 | 小売 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 420 | 692 | 6,628 | 703,063 | メディア・娯楽 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 91 | 152 | 2,907 | 308,335 | 半導体・半導体製造装置 |
| HENRY SCHEIN INC | 71 | 124 | 809 | 85,862 | ヘルスケア機器・サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 63 | 101 | 1,642 | 174,172 | 小売 |
| POOL CORP | — | 34 | 1,131 | 119,986 | 小売 |
| LAM RESEARCH CORP | 79 | 129 | 7,704 | 817,169 | 半導体・半導体製造装置 |
| COPART INC | 110 | 181 | 2,003 | 212,521 | 商業・専門サービス |
| WYNN RESORTS LTD | 52 | 91 | 1,233 | 130,799 | 消費者サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A | 2,462 | 4,092 | 21,854 | 2,317,909 | メディア・娯楽 |
| XILINX INC | 131 | 224 | 2,997 | 317,912 | 半導体・半導体製造装置 |
| PACCAR INC | 185 | 306 | 2,892 | 306,729 | 資本財 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 119 | 188 | 1,015 | 107,700 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALIGEN TECHNOLOGY INC | 38 | 65 | 3,727 | 395,321 | ヘルスケア機器・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 680 | 1,123 | 7,158 | 759,225 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CITRIX SYSTEMS INC | 64 | 115 | 1,583 | 167,911 | ソフトウェア・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 63 | 105 | 7,994 | 847,899 | ヘルスケア機器・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 評 価 額 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|-------|-----------|------------|-------------|-----|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 外 貨 建 金 額 | | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| | | | 千 円 | 千 円 | 千 円 | 千 円 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | | | |
| INTUIT INC | 141 | 235 | 9,730 | 1,032,048 | | | ソフトウェア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP | 29 | 45 | 2,440 | 258,818 | | | 銀行 |
| PAYCHEX INC | 170 | 279 | 2,605 | 276,318 | | | ソフトウェア・サービス |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 52 | 83 | 1,823 | 193,417 | | | 運輸 |
| AUTODESK INC | 117 | 197 | 5,891 | 624,854 | | | ソフトウェア・サービス |
| SALESFORCE.COM INC | 487 | 820 | 19,722 | 2,091,756 | | | ソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC-CL A | 162 | 269 | 56,154 | 5,955,747 | | | メディア・娯楽 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 28 | 46 | 2,384 | 252,847 | | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 20 | 33 | 1,806 | 191,546 | | | 各種金融 |
| GARMIN LTD | 78 | 133 | 1,715 | 181,926 | | | 耐久消費財・アパレル |
| TRIMBLE INC | — | 218 | 1,659 | 175,997 | | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| QUALCOMM INC | 608 | 1,013 | 14,304 | 1,517,113 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| HOLOGIC INC | 140 | 225 | 1,691 | 179,405 | | | ヘルスケア機器・サービス |
| SYNOPSIS INC | 80 | 138 | 3,602 | 382,119 | | | ソフトウェア・サービス |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 143 | 233 | 2,255 | 239,232 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| AMAZON.COM INC | 226 | 381 | 120,485 | 12,778,693 | | | 小売 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 123 | 206 | 3,434 | 364,260 | | | 各種金融 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 70 | 120 | 1,397 | 148,249 | | | ヘルスケア機器・サービス |
| KLA CORP | 84 | 139 | 4,572 | 484,914 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 53 | — | — | — | | | 各種金融 |
| CERNER CORP | 167 | 267 | 1,879 | 199,353 | | | ヘルスケア機器・サービス |
| VERISIGN INC | 55 | 87 | 1,712 | 181,604 | | | ソフトウェア・サービス |
| EBAY INC | 357 | 594 | 3,531 | 374,601 | | | 小売 |
| NVIDIA CORP | 332 | 554 | 32,178 | 3,412,851 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| DOLLAR TREE INC | 128 | 205 | 2,074 | 220,019 | | | 小売 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 22 | 36 | 8,970 | 951,367 | | | 小売 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 1,051 | 1,744 | 43,339 | 4,596,626 | | | 各種金融 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 721 | 1,208 | 7,270 | 771,149 | | | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 429 | 746 | 3,304 | 350,451 | | | 各種金融 |
| BORGWARNER INC | 103 | 213 | 980 | 103,941 | | | 自動車・自動車部品 |
| H&R BLOCK INC | 91 | — | — | — | | | 消費者サービス |
| JM SMUCKER CO/THE | 59 | 99 | 1,126 | 119,492 | | | 食品・飲料・タバコ |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 79 | 128 | 1,349 | 143,117 | | | ヘルスケア機器・サービス |
| ASSURANT INC | 34 | 52 | 672 | 71,303 | | | 保険 |
| AMEREN CORPORATION | 135 | 215 | 1,539 | 163,274 | | | 公益事業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 263 | 451 | 3,484 | 369,520 | | | 公益事業 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 297 | 512 | 2,994 | 317,562 | | | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORP | 141 | 238 | 1,639 | 173,936 | | | エネルギー |
| JUNIPER NETWORKS INC | 184 | 289 | 687 | 72,922 | | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| F5 NETWORKS INC | 33 | 53 | 1,018 | 107,988 | | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISH NETWORK CORP-A | 150 | 215 | 677 | 71,824 | | | メディア・娯楽 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 90 | 142 | 1,390 | 147,448 | | | ソフトウェア・サービス |
| NETAPP INC | 120 | 191 | 1,371 | 145,460 | | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| INCYTE CORP | 98 | 165 | 1,334 | 141,536 | | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC | 87 | 139 | 3,946 | 418,564 | | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC | 78 | 130 | 6,033 | 639,940 | | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE INC | 260 | 430 | 20,494 | 2,173,663 | | | ソフトウェア・サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 140 | 233 | 5,058 | 536,555 | | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 292 | 485 | 3,639 | 385,957 | | | ソフトウェア・サービス |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 92 | 145 | 1,338 | 141,947 | | | 運輸 |
| FASTENAL CO | 305 | 500 | 2,348 | 249,073 | | | 資本財 |
| FISERV INC | 307 | 515 | 6,136 | 650,888 | | | ソフトウェア・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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| APPLE INC | 2,202 | 14,294 | 179,187 | 19,004,594 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 84 | 127 | 1,285 | 136,312 | 保険 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 539 | 963 | 1,562 | 165,679 | 銀行 |
| ZIONS BANCORP NA | 95 | 143 | 815 | 86,471 | 銀行 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 117 | 193 | 2,986 | 316,726 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 70 | 118 | 1,067 | 113,217 | 運輸 |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 556 | 861 | 1,072 | 113,735 | 電気通信サービス |
| FLIR SYSTEMS INC | 74 | 118 | 646 | 68,551 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MYLAN NV | 263 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC | 233 | 394 | 1,842 | 195,467 | エネルギー |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 117 | 194 | 1,449 | 153,716 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 36 | 59 | 983 | 104,286 | 小売 |
| NOV INC | 183 | 359 | 570 | 60,498 | エネルギー |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 91 | 149 | 3,344 | 354,682 | 食品・飲料・タバコ |
| NVR INC | 1 | 3 | 1,433 | 152,036 | 耐久消費財・アパレル |
| COOPER COS INC/THE | 26 | 42 | 1,687 | 178,951 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A | 157 | 271 | 3,522 | 373,565 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WR BERKLEY CORP | 79 | 124 | 889 | 94,367 | 保険 |
| DISCOVERY INC - A | 78 | 145 | 756 | 80,199 | メディア・娯楽 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 204 | 338 | 2,987 | 316,830 | 食品・飲料・タバコ |
| EXPEDIA GROUP INC | 70 | 118 | 1,929 | 204,687 | 小売 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 118 | 186 | 906 | 96,192 | 素材 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 66 | 102 | 2,388 | 253,304 | 各種金融 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 299 | 503 | 5,607 | 594,748 | 各種金融 |
| NASDAQ INC | 63 | 101 | 1,444 | 153,169 | 各種金融 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 90 | 173 | 380 | 40,348 | 耐久消費財・アパレル |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 78 | 124 | 1,127 | 119,573 | メディア・娯楽 |
| CBRE GROUP INC - A | 184 | 292 | 2,258 | 239,497 | 不動産 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 13 | 25 | 3,676 | 389,904 | 消費者サービス |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 102 | 162 | 1,222 | 129,671 | 食品・飲料・タバコ |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | — | 38 | 1,485 | 157,593 | 半導体・半導体製造装置 |
| CUMMINS INC | 78 | 135 | 3,503 | 371,532 | 資本財 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 72 | 110 | 1,319 | 139,974 | 資本財 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 35 | 54 | 1,891 | 200,646 | 素材 |
| RALPH LAUREN CORP | 21 | 39 | 471 | 50,044 | 耐久消費財・アパレル |
| ALLIANT ENERGY CORP | 135 | 215 | 1,022 | 108,422 | 公益事業 |
| HANESBRANDS INC | 198 | 306 | 559 | 59,362 | 耐久消費財・アパレル |
| MASTERCARD INC - A | 477 | 788 | 28,965 | 3,072,068 | ソフトウェア・サービス |
| WESTERN UNION CO | 209 | 358 | 853 | 90,475 | ソフトウェア・サービス |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 72 | 116 | 1,054 | 111,845 | ソフトウェア・サービス |
| IPG PHOTONICS CORP | 20 | 32 | 742 | 78,720 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MOSAIC CO/THE | 196 | 303 | 974 | 103,395 | 素材 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 26 | 48 | 2,944 | 312,307 | 資本財 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 64 | 102 | 1,484 | 157,487 | ソフトウェア・サービス |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 65 | 115 | 2,610 | 276,862 | 保険 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 223 | 382 | 731 | 77,628 | 銀行 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 180 | 299 | 3,920 | 415,841 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 164 | 267 | 2,618 | 277,746 | 各種金融 |
| LOEWS CORP | 138 | 203 | 1,026 | 108,885 | 保険 |
| ULTA BEAUTY INC | 28 | 49 | 1,653 | 175,355 | 小売 |
| LKQ CORP | 163 | 244 | 976 | 103,551 | 小売 |
| HORMEL FOODS CORP | 152 | 240 | 1,125 | 119,360 | 食品・飲料・タバコ |

| 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 | 千アメリカドル | 千円 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 71 | 116 | 1,324 | 140,452 | 素材 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 115 | 191 | 3,660 | 388,235 | 資本財 |
| HUMANA INC | 70 | 119 | 4,548 | 482,462 | ヘルスケア機器・サービス |
| NRG ENERGY INC | 125 | 212 | 815 | 86,471 | 公益事業 |
| INVESCO LTD | 202 | 328 | 764 | 81,044 | 各種金融 |
| CONCHO RESOURCES INC | 102 | — | — | — | エネルギー |
| MSCI INC | 45 | 73 | 3,061 | 324,672 | 各種金融 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 107 | 166 | 781 | 82,910 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 841 | 1,395 | 12,222 | 1,296,318 | 食品・飲料・タバコ |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 912 | 1,519 | 33,351 | 3,537,271 | ソフトウェア・サービス |
| CABOT OIL & GAS CORP | 200 | 347 | 667 | 70,791 | エネルギー |
| FLOWSERVE CORP | 78 | 116 | 450 | 47,731 | 資本財 |
| T-MOBILE US INC | 316 | 523 | 6,246 | 662,497 | 電気通信サービス |
| DISCOVERY INC-C | 178 | 257 | 1,120 | 118,790 | メディア・娯楽 |
| RESMED INC | 77 | 126 | 2,540 | 269,398 | ヘルスケア機器・サービス |
| GARTNER INC | 46 | 80 | 1,472 | 156,126 | ソフトウェア・サービス |
| AMETEK INC | 122 | 200 | 2,468 | 261,789 | 資本財 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 133 | 218 | 1,736 | 184,155 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 47 | 71 | 1,054 | 111,885 | 運輸 |
| PERRIGO CO PLC | 78 | 119 | 495 | 52,601 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| QUANTA SERVICES INC | 76 | 118 | 964 | 102,326 | 資本財 |
| FMC CORP | 70 | 114 | 1,205 | 127,863 | 素材 |
| WABTEC CORP | 92 | 160 | 1,203 | 127,591 | 資本財 |
| EVERSOURCE ENERGY | 182 | 299 | 2,395 | 254,052 | 公益事業 |
| DELTA AIR LINES INC | 319 | 556 | 2,758 | 292,609 | 運輸 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 99 | 158 | 2,370 | 251,420 | 公益事業 |
| VERISK ANALYTICS INC | 88 | 144 | 2,418 | 256,537 | 商業・専門サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 137 | 221 | 4,264 | 452,280 | 小売 |
| FORTINET INC | 72 | 117 | 1,999 | 212,118 | ソフトウェア・サービス |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 147 | 250 | 1,377 | 146,105 | 運輸 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 13 | 20 | 2,339 | 248,156 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO | 677 | 1,129 | 5,972 | 633,433 | 自動車・自動車部品 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 142 | 224 | 2,406 | 255,284 | 素材 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 23 | 35 | 670 | 71,101 | 資本財 |
| HCA HEALTHCARE INC | 140 | 238 | 4,188 | 444,276 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP | 77 | 124 | 478 | 50,746 | エネルギー |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 354 | 597 | 3,382 | 358,701 | エネルギー |
| ATMOS ENERGY CORP | 63 | 108 | 966 | 102,497 | 公益事業 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 72 | 120 | 1,049 | 111,266 | 資本財 |
| DEXCOM INC | 49 | 87 | 3,544 | 375,884 | ヘルスケア機器・サービス |
| XYLEM INC | 98 | 158 | 1,599 | 169,690 | 資本財 |
| ABIOMED INC | 24 | 39 | 1,276 | 135,334 | ヘルスケア機器・サービス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 95 | 151 | 2,703 | 286,778 | 銀行 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 55 | 94 | 4,329 | 459,153 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66 | 241 | 387 | 3,379 | 358,471 | エネルギー |
| FACEBOOK INC-CLASS A | 1,300 | 2,154 | 56,953 | 6,040,490 | メディア・娯楽 |
| CMS ENERGY CORP | 157 | 255 | 1,396 | 148,072 | 公益事業 |
| ALBEMARLE CORP | 59 | 101 | 1,631 | 173,073 | 素材 |
| PVH CORP | 33 | 65 | 667 | 70,799 | 耐久消費財・アパレル |
| KINDER MORGAN INC | 1,028 | 1,698 | 2,669 | 283,109 | エネルギー |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 216 | 322 | 785 | 83,264 | 商業・専門サービス |
| APTIV PLC | 145 | 245 | 3,803 | 403,416 | 自動車・自動車部品 |

| 銘柄 | 株数 | 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 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| ABBVIE INC | 952 | 1,582 | 17,200 | 1,824,240 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 18 | 32 | 1,257 | 133,345 | 資本財 |
| TESLA INC | — | 679 | 50,436 | 5,349,304 | 自動車・自動車部品 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 66 | 105 | 1,292 | 137,120 | 各種金融 |
| ZOETIS INC | 258 | 426 | 6,775 | 718,629 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 41 | 64 | 1,798 | 190,746 | ヘルスケア機器・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A | 214 | 350 | 834 | 88,549 | メディア・娯楽 |
| NEWS CORP - CLASS B | 63 | 101 | 235 | 24,961 | メディア・娯楽 |
| SNAP-ON INC | 27 | 47 | 978 | 103,732 | 資本財 |
| PERKINELMER INC | 59 | 100 | 1,289 | 136,802 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TWITTER INC | 421 | 714 | 5,138 | 544,940 | メディア・娯楽 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 40 | 64 | 976 | 103,574 | ソフトウェア・サービス |
| SERVICENOW INC | 103 | 174 | 9,650 | 1,023,521 | ソフトウェア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 43 | 67 | 935 | 99,176 | ヘルスケア機器・サービス |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 44 | 72 | 2,110 | 223,875 | ソフトウェア・サービス |
| ALLEGION PLC | 48 | 80 | 877 | 93,088 | 資本財 |
| ALPHABET INC-CL C | 158 | 260 | 54,516 | 5,782,001 | メディア・娯楽 |
| UNITED RENTALS INC | 38 | 64 | 2,004 | 212,630 | 資本財 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 296 | 532 | 1,162 | 123,283 | 運輸 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 94 | 174 | 3,404 | 361,065 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 149 | 255 | 3,248 | 344,542 | 消費者サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 92 | 137 | 1,016 | 107,843 | エネルギー |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 101 | 161 | 2,321 | 246,219 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 61 | 100 | 1,875 | 198,956 | メディア・娯楽 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 130 | 275 | 860 | 91,303 | 消費者サービス |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 279 | 476 | 1,914 | 203,104 | 各種金融 |
| QORVO INC | 64 | 99 | 1,789 | 189,778 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 102 | 167 | 2,076 | 220,228 | 保険 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 230 | 379 | 1,758 | 186,486 | 銀行 |
| WESTROCK CO | 152 | 229 | 1,027 | 109,021 | 素材 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 332 | 565 | 2,125 | 225,385 | 食品・飲料・タバコ |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 634 | 1,050 | 27,944 | 2,963,740 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 26 | 42 | 1,653 | 175,372 | ソフトウェア・サービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 688 | 1,139 | 1,690 | 179,270 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CDW CORP/DE | 74 | 125 | 2,028 | 215,110 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARISTA NETWORKS INC | 29 | 48 | 1,393 | 147,786 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 134 | 183 | 335 | 35,578 | 耐久消費財・アパレル |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 11 | 18 | 1,116 | 118,397 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOMINO'S PIZZA INC | 21 | 34 | 1,269 | 134,604 | 消費者サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 81 | 130 | 7,958 | 844,099 | メディア・娯楽 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 46 | 77 | 4,110 | 435,974 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 71 | 118 | 724 | 76,795 | 資本財 |
| FORTIVE CORP | 160 | 294 | 1,989 | 210,984 | 資本財 |
| IHS MARKIT LTD | 213 | 329 | 3,007 | 318,932 | 商業・専門サービス |
| COTY INC-CL A | 92 | — | — | — | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 187 | 331 | 998 | 105,866 | 資本財 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 76 | 127 | 1,066 | 113,159 | 食品・飲料・タバコ |
| TELEFLEX INC | 24 | 40 | 1,626 | 172,494 | ヘルスケア機器・サービス |
| TECHNIPPMC PLC | 260 | — | — | — | エネルギー |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 61 | 92 | 929 | 98,563 | 各種金融 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 141 | 222 | 579 | 61,441 | ソフトウェア・サービス |
| ROLLINS INC | 74 | 197 | 700 | 74,292 | 商業・専門サービス |

| 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 | 千アメリカドル | 千円 | | |
| BAKER HUGHES CO | 365 | 582 | 1,464 | 155,373 | エネルギー | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 393 | 489 | 3,509 | 372,265 | 素材 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 191 | 325 | 1,567 | 166,231 | 資本財 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 20 | 35 | 1,698 | 180,169 | ソフトウェア・サービス | |
| BROADCOM INC | 216 | 362 | 17,435 | 1,849,235 | 半導体・半導体製造装置 | |
| EVERGY INC | 119 | 196 | 1,073 | 113,848 | 公益事業 | |
| LINDE PLC | 283 | 470 | 11,978 | 1,270,427 | 素材 | |
| CIGNA CORP | 201 | 323 | 6,960 | 738,197 | ヘルスケア機器・サービス | |
| FOX CORP - CLASS A | 183 | 291 | 991 | 105,160 | メディア・娯楽 | |
| FOX CORP - CLASS B | 72 | 125 | 411 | 43,682 | メディア・娯楽 | |
| DOW INC | 394 | 672 | 4,283 | 454,311 | 素材 | |
| STERIS PLC | 44 | 76 | 1,321 | 140,105 | ヘルスケア機器・サービス | |
| CORTEVA INC | 412 | 683 | 3,171 | 336,366 | 素材 | |
| AMCOR PLC | 870 | 1,373 | 1,566 | 166,164 | 素材 | |
| XEROX HOLDINGS CORP | 88 | 154 | 392 | 41,586 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ETSY INC | — | 109 | 2,299 | 243,904 | 小売 | |
| AON PLC-CLASS A | 123 | 204 | 4,788 | 507,919 | 保険 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 216 | 355 | 2,285 | 242,395 | 資本財 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 433 | 722 | 2,706 | 287,012 | 資本財 | |
| CATALENT INC | — | 144 | 1,661 | 176,243 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VONTIER CORP | — | 145 | 470 | 49,868 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| VIATRIS INC | — | 1,052 | 1,609 | 170,750 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ENPHASE ENERGY INC | — | 110 | 1,993 | 211,378 | 半導体・半導体製造装置 | |
| 合 計 | 株 数 | 金 額 | 148,250 | 258,994 | 2,893,708 | 306,906,727 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | 475 | 476 | — | < 94.5% > |

(注) 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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|------------------------------|---------|-----|---------|-----------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 30 | 45 | 1,437 | 152,472 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 6 | 10 | 1,770 | 187,750 | 0.1 |
| PROLOGIS INC | 40 | 66 | 6,840 | 725,522 | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 14 | 25 | 3,446 | 365,502 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3 | 5 | 1,536 | 162,932 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 6 | 11 | 1,400 | 148,498 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 3 | 6 | 676 | 71,784 | 0.0 |
| WELLTOWER INC | 22 | 36 | 2,678 | 284,115 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 7 | 12 | 1,279 | 135,661 | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 6 | 10 | 1,425 | 151,215 | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | 19 | 30 | 1,909 | 202,503 | 0.1 |
| REGENCY CENTERS CORP | 8 | 14 | 792 | 84,026 | 0.0 |
| SL GREEN REALTY CORP | 4 | 6 | 455 | 48,309 | 0.0 |
| UDR INC | 14 | 25 | 1,115 | 118,309 | 0.0 |
| VENTAS INC | 20 | 32 | 1,826 | 193,761 | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO | 41 | 65 | 2,337 | 247,883 | 0.1 |
| AMERICAN TOWER CORP | 23 | 39 | 8,950 | 949,243 | 0.3 |
| DUKE REALTY CORP | 19 | 33 | 1,347 | 142,927 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | 15 | 25 | 870 | 92,366 | 0.0 |
| EQUINIX INC | 4 | 7 | 5,103 | 541,297 | 0.2 |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 22 | 38 | 6,231 | 660,965 | 0.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 18 | 29 | 2,071 | 219,701 | 0.1 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 6 | 9 | 2,427 | 257,481 | 0.1 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 35 | 61 | 1,053 | 111,702 | 0.0 |
| PUBLIC STORAGE | 8 | 13 | 3,374 | 357,869 | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 15 | 29 | 3,456 | 366,631 | 0.1 |
| VORNADO REALTY TRUST | 7 | 12 | 563 | 59,738 | 0.0 |
| KIMCO REALTY CORP | 20 | 39 | 759 | 80,508 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 7 | 12 | 2,252 | 238,926 | 0.1 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 7 | — | — | — | — |
| 合 計 | 口 数 | 口 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 465 | 758 | 69,391 | 7,359,613 | <2.3%> |

(注) 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) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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 株式先物取引 SP EMINI | 百万円 11,919 | 百万円 — |

(注) 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。

○投資信託財産の構成

(2021年2月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 306,906,727 | % 94.4 |
| 投資証券 | 7,359,613 | 2.3 |
| コール・ローン等、その他 | 10,693,912 | 3.3 |
| 投資信託財産総額 | 324,960,252 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (322,640,627千円) の投資信託財産総額 (324,960,252千円) に対する比率は99.3%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|------------------|--|--|
| 1 アメリカドル=106.06円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年2月25日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 328,603,241,031 |
| コール・ローン等 | 7,433,705,537 |
| 株式(評価額) | 306,906,727,503 |
| 投資証券(評価額) | 7,359,613,213 |
| 未収入金 | 3,696,073,488 |
| 未収配当金 | 315,300,603 |
| 差入委託証拠金 | 2,891,820,687 |
| (B) 負債 | 3,691,894,783 |
| 未払金 | 3,679,014,501 |
| 未払解約金 | 12,879,784 |
| 未払利息 | 498 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 324,911,346,248 |
| 元本 | 126,503,624,145 |
| 次期繰越損益金 | 198,407,722,103 |
| (D) 受益権総口数 | 126,503,624,145口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,684円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 75,531,964,555円
 期中追加設定元本額 57,857,383,589円
 期中一部解約元本額 6,885,723,999円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,5684円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

| | |
|--|------------------|
| eMAXIS Slim 米国株式(S & P 5 0 0) | 112,476,623,109円 |
| MUAM S & P 5 0 0 インデックスファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) | 9,547,099,086円 |
| MAXIS 米国株式(S & P 5 0 0) 上場投信 | 2,865,643,825円 |
| MUKAM S & P 5 0 0 インデックスファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定) | 993,735,992円 |
| MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定) | 117,144,883円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定) | 110,429,143円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定) | 108,819,051円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 106,015,502円 |
| MAXIS 米国株式(S & P 5 0 0) 上場投信(為替ヘッジあり) | 79,230,983円 |
| つみたて米国株式(S & P 5 0 0) | 72,437,416円 |
| eMAXIS S & P 5 0 0 インデックス | 26,445,155円 |
| 合計 | 126,503,624,145円 |

○損益の状況 (2020年8月26日～2021年2月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,673,646,427 |
| 受取配当金 | 1,672,946,550 |
| 受取利息 | 1,089 |
| その他収益金 | 820,098 |
| 支払利息 | △ 121,310 |
| (B) 有価証券売買損益 | 35,319,704,301 |
| 売買益 | 39,057,072,249 |
| 売買損 | △ 3,737,367,948 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 1,343,210,798 |
| 取引益 | 1,829,796,090 |
| 取引損 | △ 486,585,292 |
| (D) 保管費用等 | △ 17,474,236 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 38,319,087,290 |
| (F) 前期繰越損益金 | 92,720,642,808 |
| (G) 追加信託差損益金 | 76,472,507,713 |
| (H) 解約差損益金 | △ 9,104,515,708 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 198,407,722,103 |
| 次期繰越損益金(I) | 198,407,722,103 |

(注) (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) (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し引いた差額分をいいます。

(注) (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し引いた差額分をいいます。