

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（2020年12月14日設定）	
運用方針	S & P 500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 500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。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。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。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。	
主要運用対象	ベビーフンド	S & P 500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	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。	
	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。）	

※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。  
 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 S&P500 インデックス

第1期（決算日：2021年1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 S&P500インデックス」は、去る1月26日に第1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 総額
	(分配落)	税金 分配	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
2020年12月14日	10,000	—	—	23,068	—	—	—	—	1
1期(2021年1月26日)	10,503	0	5.0	24,216	5.0	94.7	3.6	2.2	38

(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 (「SPDJ」) 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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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) 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		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	(配当込み、 円換算ベース)	騰落率	(配当込み、 円換算ベース)			
(設定日)	円	%		%	%	%	%
2020年12月14日	10,000	—	23,068	—	—	—	—
12月末	10,121	1.2	23,333	1.1	94.0	3.8	2.3
(期末)							
2021年1月26日	10,503	5.0	24,216	5.0	94.7	3.6	2.2

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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。

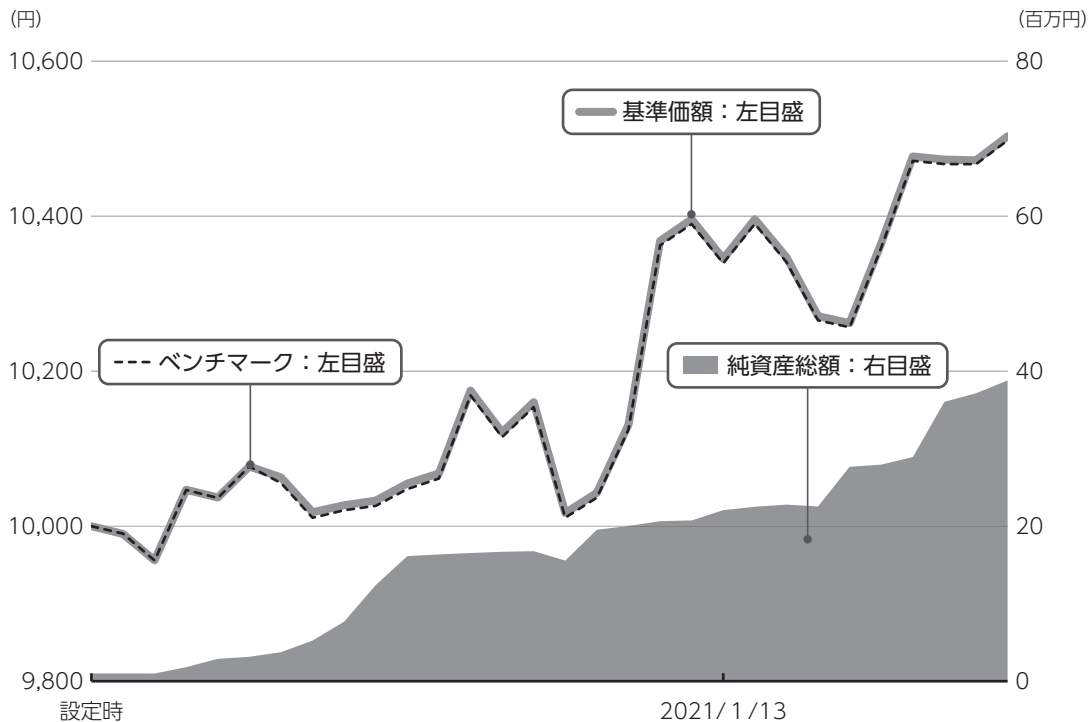
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第1期：2020年12月14日～2021年1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1期首	10,000円
第1期末	10,503円
既払分配金	0円
騰落率	5.0%

※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**

基準価額は設定時に比べ5.0%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（5.0%）と同程度となりました。

**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1期：2020年12月14日～2021年1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下落しました。**

為替市況は、設定時に比べて0.2%の円高・米ドル安となりました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ eMAXIS S&P500インデックス

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 S&P500インデックス**  
ベンチマークとの乖離は0.0%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 $\Delta 0.1\%$ 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 $0.1\%$ 程度でした。

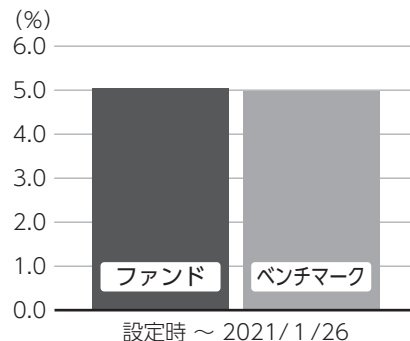
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**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1期 2020年12月14日～2021年1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	503

(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 S&P500インデックス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12月14日～2021年1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	4	0.039	(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 )	(2)	(0.018)	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 )	(2)	(0.018)	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 )	(0)	(0.003)	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	0	0.002	(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 )	(0)	(0.002)	
( 投 資 信 託 証 券 )	(0)	(0.000)	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	(0)	(0.000)	
(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)	
( 投 資 信 託 証 券 )	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	0	0.004	(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 )	(0)	(0.002)	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)	(0.000)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	4	0.045	

期中の平均基準価額は、10,196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。

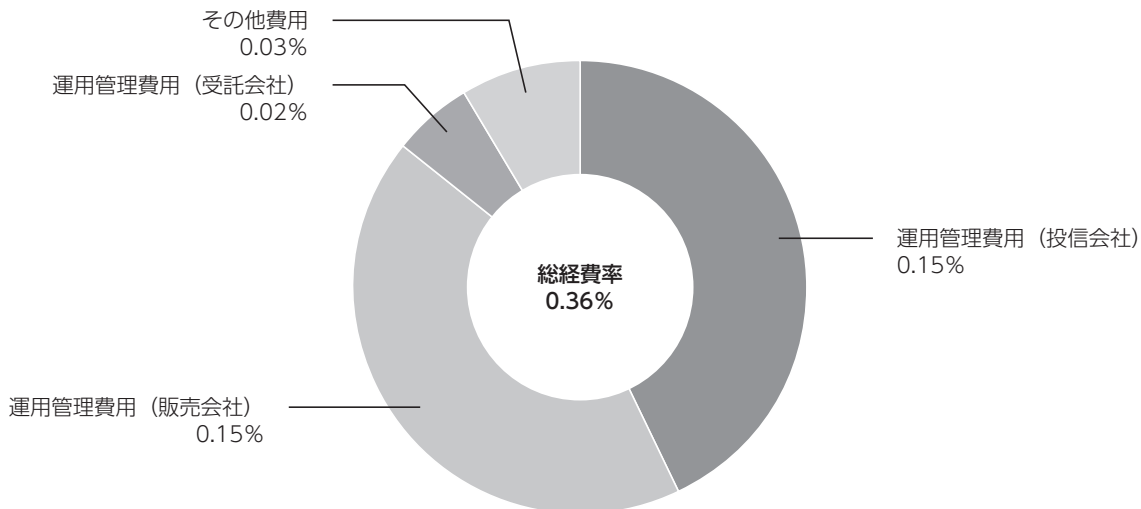
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## (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0.36%**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12月14日～2021年1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 16,183	千円 38,723	千口 446	千円 1,065

## ○株式売買比率

(2020年12月14日～2021年1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	29,890,461千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	241,940,151千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.12	

(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12月14日～2021年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;eMAXIS S&amp;P500インデックス&gt;

該当事項はございません。

## &lt;S &amp; P 5 0 0 インデックスマザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等		
				C	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 28,874	百万円 28,874	% 100.0	百万円 523	百万円 523	% 100.0

平均保有割合 0.0%

※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信託銀行です。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年12月14日～2021年1月26日)

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2021年1月26日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		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 15,736	千円 38,794

## ○投資信託財産の構成

(2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド	千円 38,794	% 99.8
コール・ローン等、その他	63	0.2
投資信託財産総額	38,857	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 (284,300,091千円) の投資信託財産総額 (285,050,657千円) に対する比率は99.7%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=103.77円			
------------------	--	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	38,857,158
コール・ローン等	63,043
S&P500インデックスマザーファンド(評価額)	38,794,115
(B) 負債	57,264
未払解約金	50,426
未払信託報酬	6,781
その他未払費用	57
(C) 純資産総額(A-B)	38,799,894
元本	36,941,293
次期繰越損益金	1,858,601
(D) 受益権総口数	36,941,293口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,503円

## &lt;注記事項&gt;

- ①設定元本額 1,000,000円  
 期中追加設定元本額 37,135,804円  
 期中一部解約元本額 1,194,511円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0503円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2020年12月14日～ 2021年1月26日
費用控除後の配当等収益額	37,364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	1,075,029円
収益調整金額	746,208円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	1,858,601円
1万口当たり収益分配対象額	503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に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12月14日～2021年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,119,231
売買益	1,137,819
売買損	△ 18,588
(B) 信託報酬等	△ 6,838
(C) 当期損益金(A+B)	1,112,393
(D) 追加信託差損益金	746,208
(売買損益相当額)	( 746,208)
(E) 計(C+D)	1,858,601
(F) 収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	1,858,601
追加信託差損益金	746,208
(配当等相当額)	( 23,662)
(売買損益相当額)	( 722,546)
分配準備積立金	1,112,393

- (注) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
 (注) (D)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14期》決算日2020年8月25日

〔計算期間：2020年2月26日～2020年8月25日〕

「S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド」は、8月25日に第14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14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	騰落率	(配当込み、円換算ベース)	騰落率				
10期(2018年8月27日)	18,934	9.7%	18,734	9.6%	77.0%	2.1%	2.1%	28,510 百万円
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

(注) S & P 5 0 0<sup>®</sup>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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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) 「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 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(配当込み、円換算ベース)	騰 落 率			
(期 首) 2020年2月25日	21,735	—	21,412	—	93.5	3.5	3.0
2月末	19,804	△ 8.9	19,511	△ 8.9	94.0	3.6	3.0
3月末	17,392	△20.0	17,133	△20.0	93.1	4.2	2.9
4月末	19,137	△12.0	18,845	△12.0	92.8	4.7	2.7
5月末	19,881	△ 8.5	19,572	△ 8.6	93.3	3.9	2.7
6月末	20,101	△ 7.5	19,784	△ 7.6	93.3	4.0	2.7
7月末	20,770	△ 4.4	20,438	△ 4.5	93.9	3.9	2.7
(期 末) 2020年8月25日	22,276	2.5	21,918	2.4	94.1	3.9	2.5

(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

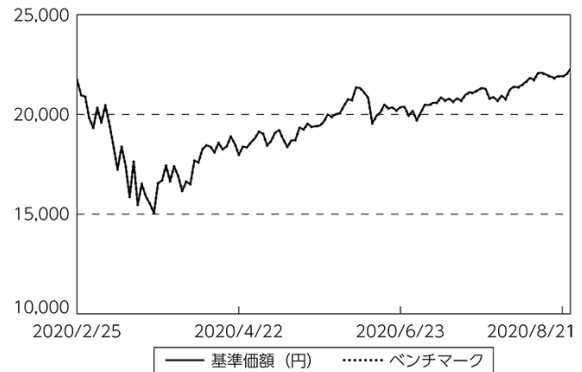
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.5%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(2.4%)を0.1%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。

- ・ 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念などを受けて米国株式市況は下落する局面もありましたが、感染拡大後の潤沢な政府支援などが好感され米国株式市況は上昇しました。

## ◎ 為替市況

米ドルは円に対して下落しました。

- ・ 為替市況は、期首に比べて4.4%の円高・米ドル安となりました。

## ● 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0.1%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2月26日～2020年8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) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)	円 1 (1) (0) (0) (0)	% 0.004 (0.003) (0.000) (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) (新株予約権証券) (投資信託証券)	0 (0) (0) (0)	0.000 (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 (2) (0)	0.012 (0.012) (0.000)	(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	0.016	
期中の平均基準価額は、19,565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2月26日～2020年8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
		79,929 ( 1,243)	685,598 ( 2,737)	1,616 ( 222)	7,891 (4,540)

(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。

## 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	証券	千アメリカドル	証券	千アメリカドル
		— (5,806)	— (69)	5,806	25

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株主割当および権利行使等による増減分です。



## ○株式売買比率

(2020年2月26日～2020年8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	74,473,870千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	106,814,852千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69

(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2月26日～2020年8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 84,635	百万円 83,709	% 98.9	百万円 7,358	百万円 7,358	% 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

(2020年8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	168	360	3,582	379,731	各種金融
ABBOTT LABORATORIES	443	956	9,696	1,027,886	ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	77	165	1,615	171,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	108	234	3,303	350,208	ソフトウェア・サービス
AES CORP	169	352	637	67,574	公益事業
AFLAC INC	186	396	1,482	157,154	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	219	475	1,404	148,854	保険
APACHE CORP	100	219	317	33,647	エネルギー
ADVANCED MICRO DEVICES	293	634	5,270	558,744	半導体・半導体製造装置
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	159	344	8,188	868,021	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	55	120	3,461	366,962	素材
ALASKA AIR GROUP INC	30	62	233	24,747	運輸
ANTHEM INC	63	137	3,833	406,381	ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	349	781	3,044	322,791	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	128	271	2,276	241,379	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	134	290	5,183	549,508	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	67	160	4,085	433,111	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	57	124	1,459	154,733	小売
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	588	1,223	7,634	809,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	29	83	4,945	524,231	各種金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,037	2,237	13,326	1,412,782	電気通信サービス
BALL CORP	81	174	1,345	142,632	素材
ALLSTATE CORP	82	168	1,603	169,947	保険
AVERY DENNISON CORP	21	47	543	57,585	素材
CHUBB LTD	113	241	3,004	318,466	保険
ANALOG DEVICES INC	93	196	2,298	243,691	半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	5	12	1,506	159,689	小売
CVS HEALTH CORP	326	709	4,533	480,575	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	194	405	1,352	143,377	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	787	1,647	16,483	1,747,403	銀行
CATERPILLAR INC	138	294	4,170	442,083	資本財
COCA-COLA CO/THE	967	2,089	10,024	1,062,731	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116	248	1,673	177,406	各種金融
CAMPBELL SOUP CO	42	93	490	52,047	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	195	409	3,078	326,323	運輸
CHEVRON CORP	474	1,009	8,801	933,068	エネルギー
TAPESTRY INC	71	150	231	24,489	耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	275	573	2,227	236,139	エネルギー
CME GROUP INC	89	195	3,427	363,400	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	72	154	770	81,681	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	215	466	3,691	391,343	家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	206	456	3,614	383,136	公益事業
DEVON ENERGY CORP	99	222	239	25,438	エネルギー
DEERE & CO	79	170	3,507	371,842	資本財
DANAHER CORP	160	340	6,993	741,343	ヘルスケア機器・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	
WALT DISNEY CO/THE	452	976	12,762	1,352,956	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	30	72	599	63,602	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	182	400	3,266	346,251	公益事業
DR HORTON INC	84	178	1,362	144,449	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	127	271	4,165	441,538	小売
DAVITA INC	24	49	429	45,553	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	37	78	872	92,467	資本財
DTE ENERGY COMPANY	48	103	1,223	129,687	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,061	2,285	9,651	1,023,136	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	52	330	2,602	275,929	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	147	306	1,359	144,089	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	153	319	2,223	235,706	資本財
EXELON CORP	243	519	1,958	207,575	公益事業
ECOLAB INC	62	131	2,605	276,249	素材
EQUIFAX INC	29	65	1,050	111,326	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	55	119	2,547	270,076	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	104	213	2,198	233,067	資本財
EDISON INTERNATIONAL	89	204	1,070	113,434	公益事業
ENTERGY CORP	50	109	1,075	114,052	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	10	20	441	46,840	保険
NEXTERA ENERGY INC	122	264	7,478	792,844	公益事業
MACY'S INC	80	—	—	—	小売
FEDEX CORP	61	128	2,791	295,964	運輸
FORD MOTOR CO	961	2,083	1,454	154,187	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	71	160	345	36,622	各種金融
FIRSTENERGY CORP	135	283	803	85,196	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	352	797	1,161	123,111	素材
GENERAL MILLS INC	148	322	2,070	219,521	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	59	125	1,916	203,141	資本財
WW GRAINGER INC	10	22	795	84,281	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,191	4,786	3,173	336,451	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	75	159	2,751	291,642	ソフトウェア・サービス
GENUINE PARTS CO	36	80	764	81,032	小売
GAP INC/THE	56	128	199	21,160	小売
GOLDMAN SACHS GROUP INC	79	168	3,503	371,354	各種金融
HALLIBURTON CO	223	485	791	83,920	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	179	379	6,049	641,259	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	43	—	—	—	自動車・自動車部品
HP INC	366	775	1,447	153,417	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	202	836	88,704	保険
HERSHEY CO/THE	36	80	1,195	126,780	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	273	581	16,673	1,767,573	小売
HASBRO INC	32	72	577	61,202	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	61	127	1,517	160,861	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	222	480	6,036	639,959	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	95	206	770	81,667	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	73	157	3,101	328,808	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	96	197	361	38,361	メディア・娯楽
IDEX CORP	18	42	772	81,899	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	26	55	687	72,876	素材
JOHNSON & JOHNSON	660	1,424	21,671	2,297,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KANSAS CITY SOUTHERN	25	49	910	96,533	運輸

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	
KELLOGG CO	62	135	945	100,234	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	86	186	2,933	311,016	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	361	774	4,491	476,135	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	201	418	1,508	159,889	食品・生活必需品小売り
KOHL'S CORP	36	103	211	22,445	小売
ELI LILLY & CO	212	455	6,808	721,726	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	25	54	973	103,249	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	118	285	1,052	111,531	運輸
LENNAR CORP-A	68	146	1,154	122,410	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	192	408	6,760	716,717	小売
LEGGETT & PLATT INC	34	73	297	31,571	耐久消費財・アパレル
L BRANDS INC	58	133	394	41,867	小売
LAS VEGAS SANDS CORP	82	187	934	99,033	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	62	133	5,286	560,455	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	52	100	367	38,963	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	68	144	1,414	149,921	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	189	402	8,547	906,101	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	61	130	4,703	498,569	各種金融
MEDTRONIC PLC	336	725	7,259	769,614	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	638	1,364	11,656	1,235,732	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	277	593	2,596	275,231	半導体・半導体製造装置
3M CO	144	311	5,095	540,184	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	42	90	1,392	147,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	133	276	615	65,201	消費者サービス
MASCO CORP	73	140	828	87,818	資本財
M & T BANK CORP	33	69	739	78,432	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	126	278	3,138	332,735	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	15	32	300	31,850	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	308	653	3,424	362,978	各種金融
MCKESSON CORP	45	86	1,294	137,188	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	198	421	1,627	172,533	保険
MOODY'S CORP	40	85	2,440	258,667	各種金融
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	137	2,907	308,259	運輸
BANK OF AMERICA CORP	2,031	4,221	10,844	1,149,646	銀行
NISOURCE INC	88	199	460	48,772	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	39	82	2,854	302,574	資本財
NEWMONT CORP	208	433	2,829	299,912	素材
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	31	68	1,392	147,597	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	79	166	767	81,335	素材
NEWELL BRANDS INC	87	210	346	36,721	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	122	278	289	30,657	エネルギー
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	227	464	632	67,070	エネルギー
OMNICOM GROUP	54	121	661	70,114	メディア・娯楽
PEPSICO INC	349	750	10,324	1,094,545	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	23	49	493	52,275	素材
ALTRIA GROUP INC	468	1,008	4,442	470,995	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	28	65	490	51,990	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	625	1,338	18,538	1,965,291	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	109	227	2,500	265,121	銀行
PFIZER INC	1,388	3,003	11,664	1,236,541	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	102	211	1,463	155,163	保険
PULTEGROUP INC	67	134	638	67,731	耐久消費財・アパレル

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	
PARKER HANNIFIN CORP	32	70	1,470	155,908	資本財
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	42	92	969	102,772	エネルギー
CITIGROUP INC	547	1,127	5,755	610,138	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	145	649	68,890	保険
PPG INDUSTRIES INC	59	129	1,568	166,312	素材
PENTAIR PLC	38	86	399	42,392	資本財
PPL CORP	182	409	1,161	123,094	公益事業
PROGRESSIVE CORP	146	312	2,878	305,149	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	125	271	1,464	155,293	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43	93	602	63,828	消費者サービス
RAYTHEON COMPANY	69	—	—	—	資本財
REPUBLIC SERVICES INC	53	109	996	105,591	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	238	497	574	60,861	銀行
ROPER TECHNOLOGIES INC	26	55	2,405	255,002	資本財
CENTERPOINT ENERGY INC	125	306	618	65,593	公益事業
ROBERT HALF INTL INC	27	58	328	34,846	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	62	1,453	154,111	資本財
SCHLUMBERGER LTD	347	758	1,481	157,101	エネルギー
STRYKER CORP	80	176	3,323	352,371	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	286	611	2,148	227,777	各種金融
SEMPRA ENERGY	70	157	2,009	213,055	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20	44	2,965	314,385	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	38	82	1,321	140,086	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	63	137	1,577	167,238	保険
SOUTHERN CO/THE	263	576	3,048	323,170	公益事業
AT&T INC	1,833	3,852	11,567	1,226,305	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	75	155	537	57,007	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	90	192	1,329	140,919	各種金融
SYSCO CORP	129	274	1,630	172,863	食品・生活必需品小売り
SEALED AIR CORP	38	82	341	36,229	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	234	496	6,997	741,780	半導体・半導体製造装置
TIFFANY & CO	27	59	757	80,300	小売
GLOBE LIFE INC	23	49	419	44,461	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	190	396	1,625	172,371	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	100	213	8,963	950,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	55	127	500	53,097	資本財
UNION PACIFIC CORP	174	366	7,064	748,881	運輸
UNUM GROUP	55	122	229	24,352	保険
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	203	798	4,938	523,558	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	237	512	15,835	1,678,717	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	356	733	2,694	285,625	銀行
MARATHON OIL CORP	211	362	197	20,942	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	175	380	6,107	647,429	運輸
VALERO ENERGY CORP	100	216	1,192	126,365	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	23	51	885	93,886	ヘルスケア機器・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	138	302	836	88,665	メディア・娯楽
VF CORP	81	173	1,147	121,656	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	34	71	894	94,773	素材
WILLIAMS COS INC	304	644	1,398	148,228	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	189	401	1,595	169,128	食品・生活必需品小売り
WEC ENERGY GROUP INC	77	167	1,547	164,061	公益事業
WALMART INC	356	765	10,053	1,065,807	食品・生活必需品小売り

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	千アメリカドル	千円	
WELLS FARGO & CO	965	2,025	4,961	525,950	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	97	207	2,335	247,572	商業・専門サービス
WATERS CORP	15	32	693	73,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	16	32	580	61,568	耐久消費財・アパレル
XCEL ENERGY INC	133	279	1,967	208,608	公益事業
KEYCORP	242	500	619	65,683	銀行
CARMAX INC	41	87	955	101,279	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	50	110	1,517	160,826	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	74	162	1,573	166,770	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	304	652	3,487	369,722	小売
CLOROX COMPANY	31	67	1,500	159,096	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	29	62	646	68,524	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	71	151	1,686	178,827	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	104	252	407	43,202	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	154	334	4,744	502,922	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	118	255	975	103,458	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	82	181	1,350	143,210	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	180	381	783	83,014	銀行
INTEL CORP	1,091	2,289	11,248	1,192,462	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	1,064	2,292	9,671	1,025,230	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	20	45	1,465	155,383	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	110	238	8,214	870,843	食品・生活必需品小売り
APPLIED MATERIALS INC	231	499	3,184	337,630	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	72	154	2,193	232,527	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	74	162	1,033	109,515	食品・飲料・タバコ
NORTONLIFELOCK INC	149	303	712	75,559	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	91	192	1,718	182,178	小売
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	60	131	1,409	149,462	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	312	670	7,497	794,777	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	149	318	7,491	794,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	35	72	291	30,897	銀行
NORTHERN TRUST CORP	53	108	915	97,068	各種金融
MICROSOFT CORP	1,914	4,099	87,611	9,287,707	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	21	47	1,537	163,020	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	149	311	1,874	198,756	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	296	633	4,986	528,660	消費者サービス
ORACLE CORP	543	1,125	6,302	668,148	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	109	237	11,622	1,232,146	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18	39	1,835	194,552	小売
ACTIVISION BLIZZARD INC	192	420	3,494	370,410	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	43	91	1,301	138,011	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	34	71	470	49,879	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	63	972	103,067	小売
LAM RESEARCH CORP	36	79	2,784	295,237	半導体・半導体製造装置
COPART INC	51	110	1,114	118,124	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	25	52	456	48,413	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,139	2,462	10,785	1,143,388	メディア・娯楽
XILINX INC	64	131	1,345	142,585	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	86	185	1,615	171,311	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	57	119	517	54,813	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	18	38	1,131	119,995	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	317	680	4,498	476,895	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	
CITRIX SYSTEMS INC	29	64	927	98,353	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	29	63	4,405	467,019	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	65	141	4,722	500,611	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	12	29	732	77,638	銀行
PAYCHEX INC	79	170	1,287	136,444	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15	52	1,043	110,659	運輸
AUTODESK INC	55	117	2,947	312,471	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	222	487	10,154	1,076,478	ソフトウェア・サービス
NORDSTROM INC	30	—	—	—	小売
ALPHABET INC-CL A	75	162	25,714	2,725,973	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	13	28	786	83,349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	9	20	1,016	107,775	各種金融
GARMIN LTD	35	78	815	86,499	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	286	608	7,049	747,320	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	70	140	919	97,492	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSIS INC	36	80	1,719	182,313	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	67	143	990	105,022	半導体・半導体製造装置
AMAZON.COM INC	104	226	74,917	7,941,980	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	57	123	1,679	178,034	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS INC	35	70	824	87,417	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	39	84	1,756	186,248	半導体・半導体製造装置
E*TRADE FINANCIAL CORP	53	53	288	30,635	各種金融
CERNER CORP	81	167	1,211	128,418	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	26	55	1,142	121,152	ソフトウェア・サービス
EBAY INC	191	357	2,099	222,593	小売
NVIDIA CORP	153	332	16,921	1,793,847	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	59	128	1,316	139,526	小売
BOOKING HOLDINGS INC	10	22	4,088	433,471	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	490	1,051	22,345	2,368,894	各種金融
TRUIST FINANCIAL CORP	336	721	2,789	295,705	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	213	429	1,563	165,726	各種金融
BORGWARNER INC	55	103	427	45,345	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	44	91	135	14,346	消費者サービス
JM SMUCKER CO/THE	27	59	672	71,341	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	37	79	772	81,909	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	16	34	431	45,719	保険
AMEREN CORPORATION	62	135	1,100	116,684	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	123	263	2,131	225,973	公益事業
AON PLC	58	—	—	—	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	141	297	1,322	140,200	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	63	141	678	71,944	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	88	184	439	46,640	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 NETWORKS INC	15	33	455	48,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISH NETWORK CORP-A	66	150	518	55,002	メディア・娯楽
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	40	90	1,003	106,402	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	57	120	509	54,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	47	98	927	98,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	45	87	2,411	255,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	37	78	2,737	290,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	121	260	12,406	1,315,230	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	64	140	3,767	399,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	139	292	1,976	209,503	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	
EXPEDITORS INTL WASH INC	41	92	810	85,873	運輸
FASTENAL CO	144	305	1,462	155,049	資本財
FISERV INC	143	307	2,960	313,862	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	1,048	2,202	110,892	11,755,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	37	84	673	71,443	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	257	539	515	54,628	銀行
ZIONS BANCORP NA	39	95	315	33,425	銀行
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	57	117	1,206	127,925	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	31	70	679	72,037	運輸
CENTURYLINK INC	258	556	635	67,376	電気通信サービス
FLIR SYSTEMS INC	35	74	266	28,239	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MYLAN NV	135	263	430	45,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	103	233	636	67,520	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	58	117	536	56,875	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	36	569	60,420	小売
NATIONAL OILWELL VARCO INC	99	183	222	23,573	エネルギー
CONSTELLATION BRANDS INC-A	41	91	1,668	176,851	食品・飲料・タバコ
NVR INC	0.86	1	775	82,244	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	12	26	801	85,006	ヘルスケア機器・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	74	157	1,713	181,679	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	36	79	487	51,695	保険
DISCOVERY INC - A	39	78	180	19,085	メディア・娯楽
MONSTER BEVERAGE CORP	96	204	1,710	181,369	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	34	70	677	71,809	小売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	57	118	396	42,036	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32	66	1,045	110,886	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	139	299	3,164	335,498	各種金融
NASDAQ INC	29	63	834	88,421	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	51	90	92	9,838	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	33	78	425	45,092	メディア・娯楽
CBRE GROUP INC - A	84	184	868	92,110	不動産
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	13	1,699	180,212	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	44	102	745	79,036	食品・飲料・タバコ
CUMMINS INC	38	78	1,654	175,443	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	33	72	643	68,260	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	15	35	743	78,831	素材
CIMAREX ENERGY CO	25	—	—	—	エネルギー
RALPH LAUREN CORP	11	21	150	15,974	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	62	135	738	78,321	公益事業
HANESBRANDS INC	94	198	318	33,797	耐久消費財・アパレル
MASTERCARD INC - A	222	477	16,419	1,740,663	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	110	209	500	53,068	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	34	72	656	69,620	ソフトウェア・サービス
IPG PHOTONICS CORP	9	20	310	32,960	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOSAIC CO/THE	85	196	364	38,627	素材
TRANSDIGM GROUP INC	12	26	1,310	138,889	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	28	64	892	94,656	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	32	65	1,281	135,824	保険
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	103	223	240	25,538	銀行
TE CONNECTIVITY LTD	82	180	1,707	181,017	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	80	164	862	91,455	各種金融
LOEWS CORP	64	138	506	53,721	保険

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	
ULTA BEAUTY INC	14	28	639	67,766	小売
LKQ CORP	74	163	517	54,864	小売
HORMEL FOODS CORP	70	152	802	85,050	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	31	71	521	55,239	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	55	115	2,110	223,782	資本財
HUMANA INC	33	70	2,866	303,879	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	67	125	436	46,265	公益事業
INVESCO LTD	98	202	214	22,757	各種金融
CONCHO RESOURCES INC	49	102	513	54,460	エネルギー
MSCI INC	21	45	1,646	174,527	各種金融
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	44	107	409	43,392	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	390	841	6,703	710,654	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	429	912	18,827	1,995,879	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	113	200	390	41,402	エネルギー
FLOWSERVE CORP	30	78	235	24,988	資本財
HELMERICH & PAYNE	26	—	—	—	エネルギー
T-MOBILE US INC	79	316	3,652	387,211	電気通信サービス
DISCOVERY INC-C	84	178	369	39,121	メディア・娯楽
RESMED INC	36	77	1,369	145,204	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	22	46	608	64,547	ソフトウェア・サービス
AMETEK INC	57	122	1,232	130,634	資本財
CHURCH & DWIGHT CO INC	59	133	1,286	136,426	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	20	47	667	70,716	運輸
PERRIGO CO PLC	34	78	410	43,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QUANTA SERVICES INC	34	76	391	41,483	資本財
FMC CORP	33	70	765	81,203	素材
WABTEC CORP	45	92	608	64,463	資本財
EVERSOURCE ENERGY	80	182	1,567	166,159	公益事業
ALLERGAN PLC	82	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DELTA AIR LINES INC	141	319	952	101,005	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	45	99	1,432	151,856	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	41	88	1,628	172,686	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	64	137	2,736	290,066	小売
FORTINET INC	36	72	966	102,463	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	54	147	536	56,903	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	13	1,251	132,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	317	677	2,054	217,849	自動車・自動車部品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	63	142	988	104,801	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10	23	384	40,729	資本財
HCA HEALTHCARE INC	67	140	1,888	200,193	ヘルスケア機器・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	35	77	202	21,489	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	165	354	1,304	138,333	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	31	63	647	68,656	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	33	72	618	65,551	資本財
DEXCOM INC	—	49	2,082	220,738	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC	43	98	803	85,144	資本財
ABIOMED INC	12	24	758	80,366	ヘルスケア機器・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	43	95	1,104	117,114	銀行
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	55	3,271	346,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	112	241	1,535	162,824	エネルギー
FACEBOOK INC-CLASS A	603	1,300	35,280	3,740,135	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	72	157	958	101,646	公益事業

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	
ALBEMARLE CORP	27	59	550	58,378	素材
PVH CORP	19	33	177	18,811	耐久消費財・アパレル
KINDER MORGAN INC	491	1,028	1,465	155,322	エネルギー
NIELSEN HOLDINGS PLC	91	216	336	35,701	商業・専門サービス
APTIV PLC	64	145	1,243	131,851	自動車・自動車部品
ABBVIE INC	371	952	9,004	954,610	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	18	598	63,411	資本財
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	31	66	511	54,175	各種金融
ZOETIS INC	119	258	4,048	429,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	41	1,106	117,295	ヘルスケア機器・サービス
NEWS CORP - CLASS A	86	214	318	33,759	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	29	63	94	9,968	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	13	27	409	43,434	資本財
PERKINELMER INC	28	59	680	72,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAPRI HOLDINGS LTD	32	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TWITTER INC	195	421	1,705	180,819	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	20	40	658	69,852	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	47	103	4,640	491,941	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	18	43	482	51,141	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	44	1,074	113,922	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	23	48	497	52,774	資本財
ALPHABET INC-CL C	75	158	25,112	2,662,188	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	18	38	689	73,128	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	93	296	398	42,257	運輸
IQVIA HOLDINGS INC	44	94	1,478	156,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	69	149	1,318	139,800	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	39	92	372	39,459	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	46	101	978	103,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	29	61	1,069	113,355	メディア・娯楽
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	56	130	218	23,192	消費者サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	150	279	705	74,772	各種金融
QORVO INC	30	64	849	90,034	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	47	102	1,067	113,171	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP	107	230	580	61,548	銀行
WESTROCK CO	68	152	476	50,529	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	161	332	1,165	123,567	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	294	634	12,624	1,338,365	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	12	26	752	79,723	ソフトウェア・サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	334	688	662	70,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CDW CORP/DE	35	74	837	88,790	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARISTA NETWORKS INC	14	29	643	68,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	46	134	123	13,097	耐久消費財・アパレル
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	11	580	61,504	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	915	97,007	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	39	81	5,004	530,513	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	22	46	1,753	185,849	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	32	71	354	37,604	資本財
FORTIVE CORP	72	160	1,155	122,543	資本財
IHS MARKIT LTD	99	213	1,750	185,570	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	59	92	37	3,924	家庭用品・パーソナル用品
HOWMET AEROSPACE INC	101	187	326	34,639	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	35	76	489	51,896	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	
TELEFLEX INC	11	24	898	95,296	ヘルスケア機器・サービス
TECHNIPFMC PLC	106	260	205	21,832	エネルギー
CBOE GLOBAL MARKETS INC	28	61	569	60,332	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	63	141	267	28,314	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	31	74	414	43,912	商業・専門サービス
BAKER HUGHES CO	157	365	581	61,615	エネルギー
DUPONT DE NEMOURS INC	187	393	2,241	237,593	素材
INGERSOLL-RAND INC	—	191	677	71,833	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	20	696	73,857	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	99	216	7,219	765,294	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	55	119	607	64,380	公益事業
LINDE PLC	134	283	7,067	749,231	素材
CIGNA CORP	93	201	3,575	379,015	ヘルスケア機器・サービス
FOX CORP - CLASS A	91	183	495	52,540	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	37	72	196	20,844	メディア・娯楽
DOW INC	189	394	1,817	192,648	素材
STERIS PLC	21	44	687	72,915	ヘルスケア機器・サービス
CORTEVA INC	188	412	1,176	124,769	素材
AMCOR PLC	395	870	946	100,307	素材
XEROX HOLDINGS CORP	49	88	170	18,055	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AON PLC-CLASS A	—	123	2,346	248,753	保険
OTIS WORLDWIDE CORP	—	216	1,383	146,685	資本財
CARRIER GLOBAL CORP	—	433	1,318	139,737	資本財
合 計	株 数	金 額			
	銘柄 数 < 比 率 >	475	475	1,494,208	158,401,074
		475	475	—	< 94.1% >

(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	11	30	843	89,372	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	6	1,156	122,584	0.1
PROLOGIS INC	18	40	4,102	434,888	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	14	2,190	232,214	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	3	790	83,815	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	6	724	76,855	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	3	292	30,980	0.0
WELLTOWER INC	10	22	1,281	135,863	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	3	7	689	73,071	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	6	710	75,364	0.0
REALTY INCOME CORP	8	19	1,197	126,950	0.1
REGENCY CENTERS CORP	3	8	346	36,741	0.0
SL GREEN REALTY CORP	1	4	245	26,063	0.0
UDR INC	7	14	516	54,790	0.0
VENTAS INC	9	20	861	91,335	0.1
WEYERHAEUSER CO	18	41	1,213	128,640	0.1
AMERICAN TOWER CORP	11	23	5,886	624,067	0.4
DUKE REALTY CORP	8	19	736	78,040	0.0
IRON MOUNTAIN INC	6	15	456	48,377	0.0
EQUINIX INC	2	4	3,724	394,871	0.2
CROWN CASTLE INTL CORP	10	22	3,657	387,766	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	8	18	1,055	111,884	0.1
SBA COMMUNICATIONS CORP	2	6	1,813	192,264	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	18	35	390	41,397	0.0
PUBLIC STORAGE	3	8	1,697	179,953	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	7	15	1,094	116,048	0.1
VORNADO REALTY TRUST	3	7	284	30,118	0.0
KIMCO REALTY CORP	10	20	242	25,698	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	7	1,181	125,260	0.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4	7	285	30,225	0.0
合 計	口 数	465	39,670	4,205,508	
銘 柄	数 < 比 率 >	30	30	—	< 2.5% >

(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) 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	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 株式先物取引 SP EMINI	百万円 6,594	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

(2020年8月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 158,401,074	% 93.0
投資証券	4,205,508	2.5
コール・ローン等、その他	7,649,776	4.5
投資信託財産総額	170,256,358	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (167,490,844千円) の投資信託財産総額 (170,256,358千円) に対する比率は98.4%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=106.01円		
------------------	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年8月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	172,069,895,561	
コール・ローン等	5,871,921,985	
株式(評価額)	158,401,074,816	
投資証券(評価額)	4,205,508,706	
未収入金	1,956,641,869	
未収配当金	196,772,636	
差入委託証拠金	1,437,975,549	
(B) 負債	3,817,288,198	
未払金	3,802,722,705	
未払解約金	14,564,362	
未払利息	1,131	
(C) 純資産総額(A-B)	168,252,607,363	
元本	75,531,964,555	
次期繰越損益金	92,720,642,808	
(D) 受益権総口数	75,531,964,555口	
1万口当たり基準価額(C/D)	22,276円	

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 35,510,521,752円  
 期中追加設定元本額 48,852,377,512円  
 期中一部解約元本額 8,830,934,709円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2.2276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)	65,206,127,790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)	6,685,396,198円
MAXIS 米国株式(S & P 5 0 0) 上場投信	1,983,623,817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)	1,264,345,460円
MUKAM バランスファンド2020-04(適格機関投資家限定)	130,447,891円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	122,703,625円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	122,415,962円
つみたて米国株式(S & P 5 0 0)	16,903,812円
合計	75,531,964,555円

## ○損益の状況 (2020年2月26日～2020年8月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	993,992,950	
受取配当金	992,996,254	
受取利息	1,080,233	
その他収益金	127,218	
支払利息	△ 210,755	
(B) 有価証券売買損益	13,165,155,803	
売買益	22,628,946,076	
売買損	△ 9,463,790,273	
(C) 先物取引等取引損益	617,670,030	
取引益	1,748,271,575	
取引損	△ 1,130,601,545	
(D) 保管費用等	△ 14,621,596	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	14,762,197,187	
(F) 前期繰越損益金	41,671,295,946	
(G) 追加信託差損益金	45,006,288,994	
(H) 解約差損益金	△ 8,719,139,319	
(I) 計(E+F+G+H)	92,720,642,808	
次期繰越損益金(I)	92,720,642,808	

(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。