

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3月6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> <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>	

運用報告書（全体版）

つみたて米国株式
(S & P 5 0 0)

第5期（決算日：2024年6月25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「つみたて米国株式（S & P 5 0 0）」は、去る6月25日に第5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。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9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。

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 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	み 騰 落 率	(配当込み、 円換算ベース)	期 騰 落 率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2020年3月6日	10,000	—	—	20,149.90	—	—	—	—	1
1期(2020年6月25日)	9,750	0	△ 2.5	19,637.87	△ 2.5	94.7	3.4	2.7	7
2期(2021年6月25日)	14,304	0	46.7	28,790.83	46.6	93.6	4.3	2.4	478
3期(2022年6月27日)	16,075	0	12.4	32,340.85	12.3	95.3	2.1	2.8	3,281
4期(2023年6月26日)	19,292	0	20.0	38,786.82	19.9	95.4	2.4	2.2	12,710
5期(2024年6月25日)	27,178	0	40.9	54,610.28	40.8	96.4	1.7	2.0	65,129

(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 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 U F J アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®] および S&P[®] は、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 SPDJ に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱 U F J アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、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 式 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) 2023年 6 月 26 日	円	%		%	%	%	%
	19,292	—	38,786.82	—	95.4	2.4	2.2
6 月 末	19,711	2.2	39,629.75	2.2	95.2	2.5	2.3
7 月 末	19,987	3.6	40,186.32	3.6	93.9	4.0	2.2
8 月 末	20,450	6.0	41,111.23	6.0	95.3	2.4	2.2
9 月 末	19,944	3.4	40,093.38	3.4	94.8	3.1	2.1
10 月 末	19,332	0.2	38,861.65	0.2	95.8	2.1	2.1
11 月 末	20,797	7.8	41,798.93	7.8	96.0	1.8	2.2
12 月 末	21,103	9.4	42,413.14	9.3	93.4	4.2	2.3
2024年 1 月 末	22,617	17.2	45,459.05	17.2	95.1	2.9	2.2
2 月 末	23,801	23.4	47,832.12	23.3	95.4	2.5	2.1
3 月 末	24,813	28.6	49,863.76	28.6	95.8	2.2	2.1
4 月 末	25,047	29.8	50,339.90	29.8	96.4	1.6	2.0
5 月 末	25,634	32.9	51,513.03	32.8	96.6	1.5	2.0
(期 末) 2024年 6 月 25 日	27,178	40.9	54,610.28	40.8	96.4	1.7	2.0

(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。

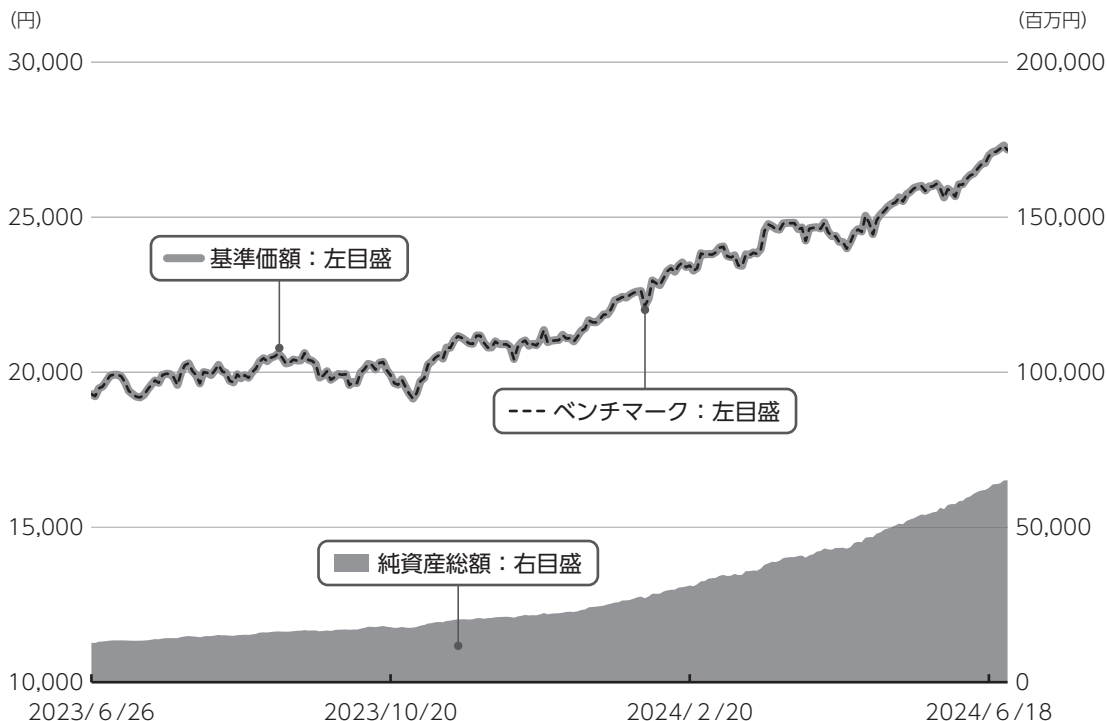
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第5期：2023年6月27日～2024年6月25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5期首	19,292円
第5期末	27,178円
既払分配金	0円
騰落率	40.9%

※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

基準価額は期間の初めに比べ40.9%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（40.8%）を0.1%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5期：2023年6月27日～2024年6月25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。

世界的なインフレや金融引き締めへの警戒等を受けて米国株式市況は下落する局面もありましたが、その後は主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて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上昇しました。

為替市況は、期間の初めに比べて円安・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

▶ つみたて米国株式（S & P 5 0 0）

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（R E I T）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

▶ つみたて米国株式（S&P500）

ベンチマークとの乖離は0.1%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 $\Delta 0.3\%$ 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。

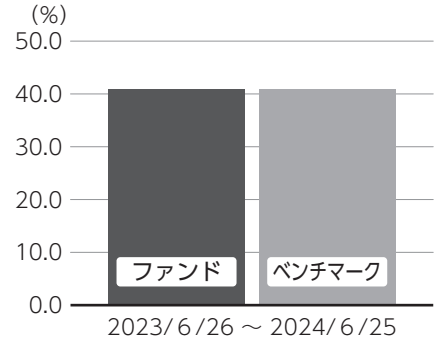
主なプラス要因：その他の要因^{*}によるものです。

^{*}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5期 2023年6月27日～2024年6月25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	17,177

(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。)

▶ **つみたて米国株式（S & P 500）**
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 & P 500 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。

2023年6月27日～2024年6月25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	49	0.219	(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)	(22)	(0.098)	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)	(22)	(0.099)	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)	(5)	(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	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)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(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	3	0.013	(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)	(0.010)	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)	(1)	(0.004)	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)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	52	0.234	

期中の平均基準価額は、22,170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。

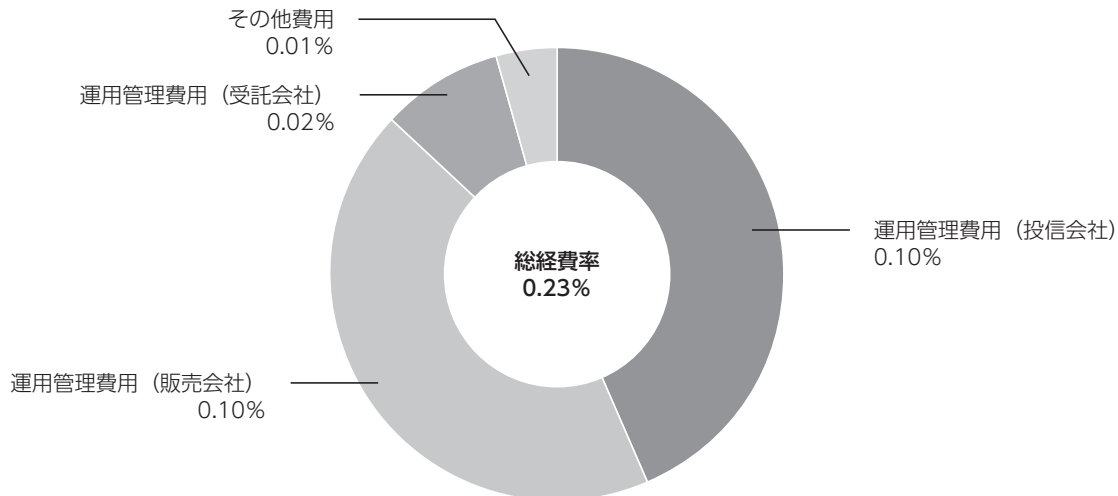
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.23%**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

(2023年6月27日～2024年6月25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 8,412,379	千円 40,824,350	千口 4,966	千円 21,754

○株式売買比率

(2023年6月27日～2024年6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
	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	1,706,467,868千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,264,542,862千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52

(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

(2023年6月27日～2024年6月25日)

利害関係人との取引状況

<つみたて米国株式（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	$\frac{B}{A}$	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 1,546,960	百万円 1,306,732	% 84.5	百万円 11,518	百万円 10,397	% 90.3

平均保有割合 0.8%

※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。

○組入資産の明細

(2024年6月25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 3,197,736	千口 11,605,149	千円 65,122,297

○投資信託財産の構成

(2024年6月25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 65,122,297	% 99.9
コール・ローン等、その他	89,558	0.1
投資信託財産総額	65,211,855	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（5,293,623,114千円）の投資信託財産総額（5,300,275,974千円）に対する比率は99.9%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=159.56円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	65,211,855,601
コール・ローン等	89,557,664
S&P500インデックスマザーファンド(評価額)	65,122,297,782
未収利息	155
(B) 負債	81,857,803
未払解約金	37,689,819
未払信託報酬	43,493,887
その他未払費用	674,097
(C) 純資産総額(A-B)	65,129,997,798
元本	23,964,583,377
次期繰越損益金	41,165,414,421
(D) 受益権総口数	23,964,583,377口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,178円

<注記事項>

- ①期首元本額 6,588,657,840円
 期中追加設定元本額 18,991,860,666円
 期中一部解約元本額 1,615,935,129円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.7178円です。

○損益の状況 (2023年6月27日～2024年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,422
受取利息	12,905
支払利息	△ 5,483
(B) 有価証券売買損益	11,230,113,065
売買益	11,614,240,684
売買損	△ 384,127,619
(C) 信託報酬等	△ 63,241,299
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,166,879,188
(E) 前期繰越損益金	1,594,350,137
(F) 追加信託差損益金	28,404,185,096
(配当等相当額)	(9,955,380,642)
(売買損益相当額)	(18,448,804,454)
(G) 計(D+E+F)	41,165,414,421
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	41,165,414,421
追加信託差損益金	28,404,185,096
(配当等相当額)	(9,978,318,202)
(売買損益相当額)	(18,425,866,894)
分配準備積立金	12,761,229,325

- (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。

②分配金の計算過程

項 目	2023年6月27日～ 2024年6月25日
費用控除後の配当等収益額	414,899,887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	10,751,979,301円
収益調整金額	28,404,185,096円
分配準備積立金額	1,594,350,137円
当ファンドの分配対象収益額	41,165,414,421円
1万口当たり収益分配対象額	17,177円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*三菱UFJアセットマネジメント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。

【お 知 ら せ】

- ①有価証券の貸付(マザーファンドで貸付を行った場合を含む)の品貸料の一部を信託報酬として收受可能とするための記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2023年9月26日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)

S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2024年2月26日

[計算期間：2023年8月26日～2024年2月26日]

「S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド」は、2月26日に第21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21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				
17期(2022年2月25日)	30,954	1.2	30,329	1.1	93.7	3.9	2.5	1,050,354
18期(2022年8月25日)	35,674	15.2	34,902	15.1	94.0	3.5	2.6	1,560,101
19期(2023年2月27日)	34,288	△ 3.9	33,496	△ 4.0	95.6	2.0	2.6	1,941,316
20期(2023年8月25日)	40,847	19.1	39,846	19.0	95.7	2.1	2.3	2,658,858
21期(2024年2月26日)	49,183	20.4	47,908	20.2	96.0	2.0	2.1	3,994,723

(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LLC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 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アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]は、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アセットマネジメント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 証 券 組 入 比 率	信 託 債 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み、 円 換 算 ベ ー ス)	騰 落 率				
(期 首) 2023年 8 月 25 日	円	%		%	%	%	%	%
8 月 末	40,847	—	39,846	—	95.7	2.1	2.3	2.2
9 月 末	42,146	3.2	41,111	3.2	95.4	2.4	2.1	2.1
10 月 末	41,112	0.6	40,093	0.6	94.8	3.1	2.2	2.1
11 月 末	39,857	△ 2.4	38,862	△ 2.5	95.8	2.1	2.2	2.2
12 月 末	42,885	5.0	41,799	4.9	96.0	1.8	2.3	2.2
2024年 1 月 末	43,525	6.6	42,413	6.4	93.4	4.2	2.2	2.2
(期 末) 2024年 2 月 26 日	46,657	14.2	45,459	14.1	95.1	2.9	2.1	2.1
	49,183	20.4	47,908	20.2	96.0	2.0		

(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

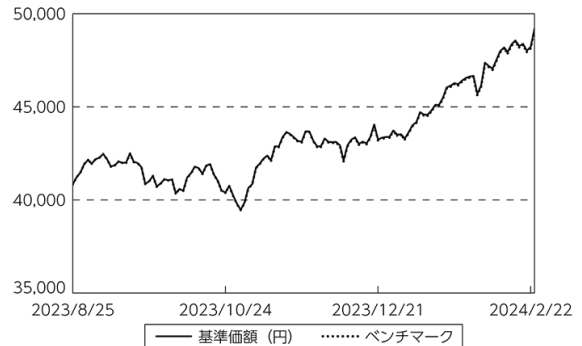
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ20.4%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(20.2%)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。
- ・ 世界的なインフレや金融引き締めへの警戒等を受けて米国株式市況は下落する局面もありましたが、その後は主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて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上昇しました。
- ・ 為替市況は、期間の初めに比べて円安・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

- ・ 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

(2023年8月26日～2024年2月26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 0 (0) (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.000) (0.000)	(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)	2 (2)	0.005 (0.005)	(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
合 計	2	0.006	
期中の平均基準価額は、43,360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

(2023年8月26日～2024年2月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 413,688 (2,322)	千アメリカドル 5,062,639 (△ 803)	百株 29,505 (3,652)	千アメリカドル 246,591 (33,422)

(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。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	84	1,690	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21	2,616	—	—
	PROLOGIS INC	108	13,154	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	28	2,683	10	1,063
	DIGITAL REALTY TRUST INC	49	6,595	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	1,079	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	16	2,333	—	—
	WELLTOWER INC	103	9,137	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	26	1,687	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	18	2,470	—	—
	REALTY INCOME CORP	207	11,168	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	14	936	—	—
	UDR INC	27	1,017	—	—
	VENTAS INC	59	2,798	—	—
	WEYERHAEUSER CO	89	2,837	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	52	9,891	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	44	2,790	—	—
	EQUINIX INC	10	8,474	—	—
	CROWN CASTLE INC	55	5,850	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	53	3,240	—	—
	INVITATION HOMES INC	98	3,212	—	—
	VICI PROPERTIES INC	145	4,276	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	11	2,641	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	62	1,012	—	—
	PUBLIC STORAGE	21	5,843	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	40	5,423	—	—
	KIMCO REALTY CORP	161	3,173	49	1,096
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13	2,413	—	—
	小 計	1,632	120,451	59	2,160

(注) 金額は受渡代金。

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 788,436	百万円 780,254	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

(2023年8月26日～2024年2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
(a) 期中の株式売買金額	788,454,278千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,876,852,585千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.27

(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

(2023年8月26日～2024年2月26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 582,769	% 80.8		百万円 9,418	% 89.4	

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

(2024年2月26日現在)

外国株式

銘柄	株数	当 期		末 額		業 種 等
		株数	株数	評 価		
				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	2,902	3,540	75,973	11,423,318		金融サービス
ABBOTT LABORATORIES	8,476	10,624	126,920	19,083,804		ヘルスケア機器・サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,415	1,851	24,441	3,675,047		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,015	2,469	63,179	9,499,657		商業・専門サービス
AES CORP	3,065	3,598	5,758	865,772		公益事業
AFLAC INC	2,645	3,304	26,572	3,995,481		保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,527	4,366	31,140	4,682,299		保険
ADVANCED MICRO DEVICES	7,849	9,882	174,442	26,229,126		半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	3,075	3,841	144,948	21,794,529		ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,095	1,351	31,457	4,729,966		素材
ALASKA AIR GROUP INC	727	—	—	—		運輸
ELEVANCE HEALTH INC	1,154	1,443	74,207	11,157,894		ヘルスケア機器・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	7,071	8,786	58,868	8,851,504		ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	2,503	3,247	13,816	2,077,409		ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	2,752	3,493	70,154	10,548,496		資本財
BECTON DICKINSON AND CO	1,367	1,746	42,999	6,465,452		ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	922	1,338	10,207	1,534,820		一般消費財・サービス流通・小売り
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10,234	12,240	63,236	9,508,176		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	729	862	70,159	10,549,125		金融サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	20,472	25,740	104,660	15,736,778		電気通信サービス
BALL CORP	1,595	1,870	11,765	1,769,092		素材
ALLSTATE CORP	1,270	1,554	24,730	3,718,438		保険
AVERY DENNISON CORP	374	520	11,170	1,679,537		素材
CHUBB LTD	2,028	2,496	63,925	9,611,829		保険
ANALOG DEVICES INC	2,470	2,993	56,902	8,555,815		半導体・半導体製造装置
AUTOZONE INC	88	109	30,264	4,550,587		一般消費財・サービス流通・小売り
CVS HEALTH CORP	6,263	7,708	59,513	8,948,388		ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	3,744	4,555	14,890	2,238,948		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JPMORGAN CHASE & CO	14,233	17,645	324,665	48,816,695		銀行
CHARLES RIVER LABORATORIES	252	344	8,533	1,283,076		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	2,510	3,123	101,166	15,211,444		資本財
COCA-COLA CO/THE	18,957	23,802	145,672	21,903,320		食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,840	2,371	32,138	4,832,334		金融サービス
CAMPBELL SOUP CO	911	1,270	5,393	810,926		食品・飲料・タバコ
CSX CORP	10,023	11,880	45,537	6,847,052		運輸
CHEVRON CORP	8,668	10,741	166,123	24,978,360		エネルギー
TAPESTRY INC	1,036	1,484	7,208	1,083,878		耐久消費財・アパレル
CONOCOPHILLIPS	5,875	7,353	82,003	12,330,055		エネルギー
CME GROUP INC	1,766	2,150	46,868	7,047,194		金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	1,285	1,435	15,521	2,333,748		ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,093	4,926	42,491	6,389,085		家庭用品・パーソナル用品
DOMINION ENERGY INC	4,033	5,286	25,298	3,803,955		公益事業
DEVON ENERGY CORP	3,129	3,758	16,492	2,479,748		エネルギー
DEERE & CO	1,313	1,604	58,511	8,797,792		資本財
DANAHER CORP	3,238	4,038	102,516	15,414,431		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALT DISNEY CO/THE	8,906	11,234	121,044	18,200,184		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	572	743	12,603	1,894,997	消費者サービス
DUKE ENERGY CORP	3,720	4,597	42,629	6,409,752	公益事業
DR HORTON INC	1,501	1,873	27,376	4,116,332	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	2,249	2,783	42,162	6,339,506	生活必需品流通・小売り
DAVITA INC	308	308	3,866	581,370	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	662	857	14,079	2,117,011	資本財
DTE ENERGY COMPANY	965	1,232	13,361	2,008,998	公益事業
EXXON MOBIL CORP	19,695	24,479	254,196	38,220,998	エネルギー
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,902	3,784	33,201	4,992,127	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	2,870	3,526	39,447	5,931,332	エネルギー
EMERSON ELECTRIC CO	2,773	3,465	36,702	5,518,584	資本財
EXELON CORP	4,943	6,301	22,768	3,423,538	公益事業
ECOLAB INC	1,214	1,540	34,257	5,150,887	素材
EQUIFAX INC	604	723	19,254	2,895,035	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,138	1,357	20,355	3,060,644	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	1,951	2,449	69,781	10,492,409	資本財
EDISON INTERNATIONAL	1,902	2,353	16,065	2,415,634	公益事業
ENTERGY CORP	1,030	1,331	13,644	2,051,585	公益事業
EVEREST GROUP LTD	203	270	10,014	1,505,724	保険
NEXTERA ENERGY INC	9,884	12,598	71,536	10,756,296	公益事業
FEDEX CORP	1,113	1,391	33,868	5,092,496	運輸
FORD MOTOR CO	18,944	24,123	29,286	4,403,521	自動車・自動車部品
FRANKLIN RESOURCES INC	1,500	1,500	4,053	609,496	金融サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	188	210	9,745	1,465,385	金融サービス
FIRSTENERGY CORP	2,709	3,086	11,542	1,735,485	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	7,077	8,733	34,027	5,116,364	素材
GENERAL MILLS INC	2,893	3,687	24,085	3,621,556	食品・飲料・タバコ
GENERAL DYNAMICS CORP	1,093	1,355	37,100	5,578,474	資本財
WW GRAINGER INC	218	272	26,135	3,929,754	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	5,297	6,655	102,047	15,343,801	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	1,254	1,507	20,060	3,016,306	金融サービス
GENUINE PARTS CO	663	849	12,562	1,888,927	一般消費財・サービス流通・小売り
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,617	2,007	78,522	11,806,635	金融サービス
HALLIBURTON CO	4,418	5,377	18,933	2,846,874	エネルギー
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,238	4,044	81,151	12,201,928	資本財
HP INC	4,279	5,245	15,352	2,308,436	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,454	1,799	17,253	2,594,165	保険
HERSHEY CO/THE	737	878	17,019	2,559,013	食品・飲料・タバコ
HOME DEPOT INC	4,934	6,126	227,896	34,266,580	一般消費財・サービス流通・小売り
HASBRO INC	627	627	3,110	467,751	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,091	1,383	38,992	5,862,844	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4,419	5,590	103,819	15,610,247	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	1,785	2,262	7,859	1,181,718	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	1,361	1,659	43,180	6,492,586	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,858	2,378	7,684	1,155,372	メディア・娯楽
IDEX CORP	357	501	11,878	1,786,062	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,283	1,634	13,152	1,977,625	素材
JOHNSON & JOHNSON	11,733	14,698	237,884	35,768,275	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JABIL INC	—	818	11,416	1,716,543	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLANOVA	1,256	1,458	8,232	1,237,781	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	1,659	2,152	26,184	3,937,170	家庭用品・パーソナル用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	6,644	8,141	60,228	9,056,005	食品・飲料・タバコ

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	
KROGER CO	3,147	3,918	18,890	2,840,420	生活必需品流通・小売り
ELI LILLY & CO	3,839	4,867	374,611	56,326,555	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	411	542	11,886	1,787,233	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,049	3,292	11,123	1,672,466	運輸
LENNAR CORP-A	1,252	1,504	23,335	3,508,703	耐久消費財・アパレル
LOWE'S COS INC	2,902	3,556	82,714	12,437,004	一般消費財・サービス流通・小売り
BATH & BODY WORKS INC	1,034	1,140	5,389	810,390	一般消費財・サービス流通・小売り
LAS VEGAS SANDS CORP	1,665	2,294	12,563	1,889,086	消費者サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	1,099	1,358	58,552	8,803,963	資本財
LINCOLN NATIONAL CORP	738	-	-	-	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,260	1,545	38,853	5,842,074	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	3,546	4,441	132,235	19,882,890	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	1,598	1,992	87,329	13,130,890	金融サービス
MEDTRONIC PLC	6,484	7,965	68,237	10,260,117	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO. INC.	12,365	15,481	200,413	30,134,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRON TECHNOLOGY INC	5,384	6,572	56,522	8,498,666	半導体・半導体製造装置
3M CO	2,646	3,358	31,094	4,675,434	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	816	1,024	33,831	5,086,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,520	1,858	7,912	1,189,795	消費者サービス
MASCO CORP	1,100	1,276	9,564	1,438,177	資本財
M & T BANK CORP	847	923	12,755	1,917,891	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	2,416	3,032	61,756	9,285,731	保険
MOLINA HEALTHCARE INC	280	355	14,480	2,177,303	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	239	411	4,731	711,480	耐久消費財・アパレル
MORGAN STANLEY	6,340	7,814	67,638	10,170,121	金融サービス
MCKESSON CORP	661	798	41,243	6,201,442	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	3,137	3,878	26,886	4,042,615	保険
MOODY'S CORP	761	948	36,567	5,498,296	金融サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,107	1,401	36,163	5,437,614	運輸
BANK OF AMERICA CORP	33,752	42,226	143,232	21,536,473	銀行
NISOURCE INC	1,982	2,365	6,178	929,046	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	704	848	39,128	5,883,358	資本財
NEWMONT CORP	3,823	7,114	22,253	3,346,106	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,185	1,554	10,583	1,591,326	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	1,205	1,513	28,745	4,322,228	素材
NEWELL BRANDS INC	1,762	-	-	-	耐久消費財・アパレル
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,555	4,119	24,727	3,718,074	エネルギー
OMNICOM GROUP	997	1,192	10,561	1,588,049	メディア・娯楽
PEPSICO INC	6,706	8,424	142,883	21,483,925	食品・飲料・タバコ
PACKAGING CORP OF AMERICA	414	478	8,399	1,262,923	素材
ALTRIA GROUP INC	8,754	10,578	43,509	6,542,025	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	544	830	5,853	880,064	公益事業
PROCTER & GAMBLE CO/THE	11,479	14,407	232,006	34,884,528	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,951	2,417	35,322	5,311,063	銀行
PFIZER INC	27,516	34,709	96,353	14,487,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,795	2,125	22,965	3,453,063	保険
PULTEGROUP INC	1,078	1,299	13,740	2,065,956	耐久消費財・アパレル
PARKER HANNIFIN CORP	627	781	41,486	6,237,853	資本財
PTONEER NATURAL RESOURCES CO	1,158	1,412	32,829	4,936,303	エネルギー
CITIGROUP INC	9,520	11,787	65,928	9,912,983	銀行
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,079	1,340	10,756	1,617,346	保険
PPG INDUSTRIES INC	1,128	1,419	20,486	3,080,333	素材

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	
PENTAIR PLC	799	1,060	8,142	1,224,371	資本財
P G & E CORP	7,803	12,632	21,513	3,234,842	公益事業
PPL CORP	3,686	4,383	11,746	1,766,251	公益事業
PROGRESSIVE CORP	2,876	3,580	68,500	10,299,737	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	2,402	2,999	18,218	2,739,397	公益事業
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,112	1,441	17,578	2,643,131	消費者サービス
REPUBLIC SERVICES INC	990	1,237	22,882	3,440,569	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	4,817	5,663	10,353	1,556,710	銀行
ROPER TECHNOLOGIES INC	515	663	36,942	5,554,712	ソフトウェア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	2,970	3,864	10,784	1,621,554	公益事業
ROBERT HALF INC	575	575	4,606	692,703	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	550	725	20,364	3,062,043	資本財
SCHLUMBERGER LTD	7,019	8,615	42,059	6,323,993	エネルギー
STRYKER CORP	1,649	2,075	73,692	11,080,406	ヘルスケア機器・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	7,256	8,921	57,487	8,643,782	金融サービス
SEMPRA	3,060	3,733	26,870	4,040,281	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,127	1,423	45,833	6,891,583	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	727	843	7,517	1,130,376	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	1,105	1,355	29,961	4,505,079	保険
SOUTHERN CO/THE	5,356	6,502	44,016	6,618,362	公益事業
AT&T INC	34,881	43,932	73,807	11,097,631	電気通信サービス
WESTERN DIGITAL CORP	1,560	2,071	11,613	1,746,197	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STATE STREET CORP	1,676	1,804	13,278	1,996,517	金融サービス
SYSCO CORP	2,527	3,163	25,566	3,844,145	生活必需品流通・小売り
SEALED AIR CORP	803	—	—	—	素材
TEXAS INSTRUMENTS INC	4,424	5,590	91,504	13,758,618	半導体・半導体製造装置
TERADYNE INC	742	844	8,454	1,271,266	半導体・半導体製造装置
GLOBE LIFE INC	408	499	6,334	952,469	保険
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	3,384	4,268	24,946	3,750,887	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,880	2,372	133,972	20,144,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	999	1,205	10,367	1,558,903	資本財
UNION PACIFIC CORP	2,970	3,725	95,701	14,389,606	運輸
RTX CORP	7,105	8,838	79,552	11,961,439	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,534	5,649	297,880	44,789,324	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	6,751	9,417	38,951	5,856,676	銀行
MARATHON OIL CORP	3,155	3,123	7,427	1,116,751	エネルギー
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3,529	4,443	66,046	9,930,739	運輸
VALERO ENERGY CORP	1,731	2,093	29,640	4,456,678	エネルギー
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	2,358	2,358	2,643	397,543	メディア・娯楽
VF CORP	1,781	1,781	2,846	427,966	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	655	787	20,252	3,045,203	素材
WILLIAMS COS INC	6,054	7,554	26,395	3,968,878	エネルギー
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	3,581	4,260	9,257	1,391,964	生活必需品流通・小売り
WEC ENERGY GROUP INC	1,532	1,853	14,616	2,197,767	公益事業
WALMART INC	6,835	8,713	152,981	23,002,283	生活必需品流通・小売り
WELLS FARGO & CO	18,268	22,248	119,828	18,017,483	銀行
WASTE MANAGEMENT INC	1,830	2,203	45,839	6,892,419	商業・専門サービス
WATERS CORP	304	351	11,631	1,748,914	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WHIRLPOOL CORP	281	281	3,113	468,192	耐久消費財・アパレル
XCEL ENERGY INC	2,616	3,347	19,861	2,986,319	公益事業
KEYCORP	4,640	5,712	8,145	1,224,799	銀行
CARMAX INC	756	900	6,603	992,970	一般消費財・サービス流通・小売り

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	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,039	1,320	17,052	2,564,038	ヘルスケア機器・サービス
YUM! BRANDS INC	1,341	1,644	22,742	3,419,511	消費者サービス
TJX COMPANIES INC	5,620	6,878	68,360	10,278,613	一般消費財・サービス流通・小売り
CLOROX COMPANY	590	781	11,950	1,796,863	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	521	623	9,306	1,399,373	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	1,345	1,636	49,660	7,466,959	ソフトウェア・サービス
CARNIVAL CORP	4,877	5,976	9,101	1,368,523	消費者サービス
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2,853	3,723	23,933	3,598,612	金融サービス
CONAGRA BRANDS INC	2,214	3,192	9,034	1,358,456	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	1,696	1,989	17,493	2,630,335	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	3,199	4,058	13,605	2,045,753	銀行
INTEL CORP	20,324	25,791	110,878	16,671,719	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	19,959	24,777	121,062	18,202,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	426	537	34,017	5,114,810	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	2,161	2,706	199,709	30,028,348	生活必需品流通・小売り
APPLIED MATERIALS INC	4,109	5,185	102,246	15,373,796	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	1,239	1,408	20,084	3,019,864	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	1,480	1,787	9,618	1,446,219	食品・飲料・タバコ
GEN DIGITAL INC	2,895	2,895	6,411	964,033	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	1,645	2,070	30,655	4,609,410	一般消費財・サービス流通・小売り
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,701	3,398	28,152	4,233,024	半導体・半導体製造装置
NIKE INC -CL B	6,012	7,363	77,783	11,695,543	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	2,600	3,278	94,820	14,257,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMERICA INC	588	924	4,579	688,570	銀行
NORTHERN TRUST CORP	988	1,341	10,933	1,644,018	金融サービス
MICROSOFT CORP	36,235	45,342	1,860,587	279,757,863	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	424	507	17,299	2,601,099	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	2,637	3,352	26,892	4,043,600	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	5,579	6,850	65,501	9,848,750	消費者サービス
ORACLE CORP	7,491	9,722	108,847	16,366,314	ソフトウェア・サービス
NETFLIX INC	2,166	2,677	156,246	23,493,214	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	301	358	37,889	5,697,112	一般消費財・サービス流通・小売り
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,525	-	-	-	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	739	1,007	10,461	1,573,028	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	632	877	7,010	1,054,028	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	552	639	15,552	2,338,451	一般消費財・サービス流通・小売り
POOL CORP	190	259	10,065	1,513,500	一般消費財・サービス流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	656	792	73,600	11,066,546	半導体・半導体製造装置
COPART INC	4,285	5,467	28,093	4,224,185	商業・専門サービス
WYNN RESORTS LTD	527	478	4,984	749,433	消費者サービス
COMCAST CORP-CLASS A	20,287	24,713	103,547	15,569,435	メディア・娯楽
PACCAR INC	2,583	3,230	35,786	5,380,888	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	964	1,406	4,768	717,015	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	341	400	12,680	1,906,653	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	6,088	7,671	56,422	8,483,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUITIVE SURGICAL INC	1,707	2,161	84,237	12,665,947	ヘルスケア機器・サービス
INTUIT INC	1,366	1,720	113,515	17,068,219	ソフトウェア・サービス
PAYCHEX INC	1,536	2,020	25,185	3,786,930	商業・専門サービス
ON SEMICONDUCTOR	2,067	2,480	18,902	2,842,170	半導体・半導体製造装置
OLD DOMINION FREIGHT LINE	433	553	24,345	3,660,653	運輸
AUTODESK INC	1,060	1,300	33,445	5,028,829	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE INC	4,768	5,954	174,354	26,215,941	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	
AXON ENTERPRISE INC	345	388	10,510	1,580,311	資本財
ALPHABET INC-CL A	28,921	41,411	596,158	89,638,350	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	240	311	8,575	1,289,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	182	221	4,759	715,623	金融サービス
GARMIN LTD	748	989	13,411	2,016,602	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	1,254	1,606	9,872	1,484,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUALCOMM INC	5,429	6,814	105,562	15,872,445	半導体・半導体製造装置
HOLOGIC INC	1,143	1,470	11,199	1,683,961	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC	749	913	52,594	7,908,159	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	43,503	55,490	971,027	146,003,624	一般消費財・サービス流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	1,110	1,382	15,340	2,306,578	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS INC	570	673	8,562	1,287,461	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP	675	821	54,952	8,262,621	半導体・半導体製造装置
STEEL DYNAMICS INC	806	931	11,829	1,778,619	素材
VERISIGN INC	461	562	11,063	1,663,548	ソフトウェア・サービス
EBAY INC	2,707	3,097	13,631	2,049,669	一般消費財・サービス流通・小売り
NVIDIA CORP	12,052	15,070	1,187,789	178,596,033	半導体・半導体製造装置
DOLLAR TREE INC	997	1,273	18,573	2,792,702	生活必需品流通・小売り
BOOKING HOLDINGS INC	179	214	75,066	11,286,940	消費者サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	8,689	11,102	463,203	69,647,338	金融サービス
TRUIST FINANCIAL CORP	6,599	8,150	28,723	4,318,890	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,557	4,811	26,769	4,025,114	金融サービス
BORGWARNER INC	1,165	1,165	3,543	532,836	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	528	649	8,174	1,229,076	食品・飲料・タバコ
CENCORA INC	791	1,010	23,967	3,603,695	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	241	302	5,391	810,625	保険
AMEREN CORPORATION	1,290	1,737	12,442	1,870,844	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,537	3,359	27,699	4,164,882	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	2,695	3,433	18,351	2,759,326	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	1,323	1,770	26,396	3,968,999	エネルギー
JUNIPER NETWORKS INC	1,532	2,085	7,752	1,165,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	288	377	7,019	1,055,402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	758	848	9,176	1,379,745	ソフトウェア・サービス
NETAPP INC	1,071	1,252	10,949	1,646,310	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	941	1,250	7,576	1,139,262	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	717	925	20,657	3,106,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	759	1,018	13,548	2,037,164	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	2,234	2,783	154,069	23,165,874	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,259	1,545	66,472	9,994,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	2,464	2,978	23,770	3,574,140	ソフトウェア・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	763	919	11,043	1,660,459	運輸
FASTENAL CO	2,781	3,402	24,560	3,692,858	資本財
FISERV INC	2,976	3,599	54,261	8,158,719	金融サービス
APPLE INC	72,052	89,187	1,627,851	244,763,728	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	734	986	11,127	1,673,108	保険
HUNTINGTON BANCSHARES INC	6,795	9,396	12,083	1,816,857	銀行
ZIONS BANCORP NA	634	903	3,525	530,117	銀行
COSTAR GROUP INC	1,971	2,411	20,447	3,074,465	不動産管理・開発
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	522	752	5,519	829,881	運輸
ONEOK INC	2,176	3,624	26,446	3,976,542	エネルギー
BUNGE LTD	715	-	-	-	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	773	1,008	24,934	3,749,207	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	
NVR INC	14	19	14,744	2,217,021	耐久消費財・アパレル
COOPER COS INC/THE	232	1,223	11,834	1,779,429	ヘルスケア機器・サービス
EQT CORP	1,769	2,195	8,124	1,221,567	エネルギー
AMPHENOL CORP-CL A	2,890	3,653	39,267	5,904,276	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WR BERKLEY CORP	965	1,106	9,442	1,419,767	保険
HUBBELL INC	—	344	12,589	1,892,886	資本財
MONSTER BEVERAGE CORP	3,729	4,591	25,388	3,817,457	食品・飲料・タバコ
EXPEDIA GROUP INC	702	827	11,282	1,696,498	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	947	1,080	8,690	1,306,638	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	512	611	24,913	3,745,963	金融サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2,760	3,436	47,555	7,150,470	金融サービス
NASDAQ INC	1,589	2,085	11,814	1,776,440	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	679	801	7,635	1,148,133	メディア・娯楽
CBRE GROUP INC - A	1,541	1,777	16,015	2,408,066	不動産管理・開発
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	133	164	43,602	6,556,006	消費者サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	859	1,022	5,876	883,557	食品・飲料・タバコ
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	220	294	21,256	3,196,056	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	1,204	1,423	11,995	1,803,583	保険
CUMMINS INC	677	854	22,548	3,390,444	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	305	374	20,560	3,091,422	素材
RALPH LAUREN CORP	186	291	5,495	826,328	耐久消費財・アパレル
ALLIANT ENERGY CORP	1,176	1,367	6,660	1,001,422	公益事業
MASTERCARD INC - A	4,075	5,054	239,285	35,978,953	金融サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	632	878	11,078	1,665,730	商業・専門サービス
FIRST SOLAR INC	465	622	8,889	1,336,599	半導体・半導体製造装置
MOSAIC CO/THE	1,662	2,179	6,860	1,031,492	素材
TRANSNIGM GROUP INC	255	332	39,896	5,998,814	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	598	737	14,857	2,233,999	商業・専門サービス
INSULET CORP	349	431	7,947	1,194,994	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	504	621	17,245	2,592,980	保険
BLACKSTONE INC	—	4,284	53,606	8,060,330	金融サービス
TE CONNECTIVITY LTD	1,508	1,958	28,033	4,215,100	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,253	1,530	18,625	2,800,533	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	—	711	32,565	4,896,493	耐久消費財・アパレル
LOEWS CORP	939	1,231	9,260	1,392,416	保険
ULTA BEAUTY INC	253	288	15,851	2,383,394	一般消費財・サービス流通・小売り
LKQ CORP	1,227	1,859	9,700	1,458,531	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	1,405	1,998	6,097	916,891	食品・飲料・タバコ
EASTMAN CHEMICAL CO	630	630	5,463	821,509	素材
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	911	1,144	24,553	3,691,857	資本財
HUMANA INC	617	768	27,899	4,194,958	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	1,116	1,450	7,477	1,124,283	公益事業
INVESCO LTD	2,375	2,375	3,643	547,870	金融サービス
MSCI INC	396	492	28,039	4,216,005	金融サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	978	978	6,112	919,041	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	7,555	9,509	87,071	13,092,050	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	7,884	9,727	275,868	41,479,544	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	4,122	5,828	17,597	2,645,938	食品・飲料・タバコ
COTERRA ENERGY INC	3,689	4,780	12,420	1,867,537	エネルギー
T-MOBILE US INC	2,825	3,035	49,880	7,500,102	電気通信サービス
RESMED INC	713	868	15,982	2,403,058	ヘルスケア機器・サービス
GARTNER INC	390	462	21,317	3,205,229	ソフトウェア・サービス

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	
AMETEK INC	1,154	1,447	25,794	3,878,507	資本財
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,807	2,274	19,853	2,985,119	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,202	1,451	14,575	2,191,522	家庭用品・パーソナル用品
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	410	489	10,430	1,568,285	運輸
QUANTA SERVICES INC	692	901	21,131	3,177,321	資本財
FMC CORP	645	645	3,378	508,032	素材
WABTEC CORP	847	1,062	14,697	2,209,889	資本財
EVERSOURCE ENERGY	1,714	2,312	13,614	2,047,033	公益事業
DELTA AIR LINES INC	3,114	3,995	16,669	2,506,453	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	951	1,147	13,645	2,051,690	公益事業
VERISK ANALYTICS INC	704	874	21,411	3,219,412	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	1,061	1,266	17,781	2,673,692	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	3,170	3,760	25,433	3,824,244	ソフトウェア・サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,689	1,864	8,487	1,276,129	運輸
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	107	132	16,087	2,418,959	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GENERAL MOTORS CO	6,769	8,523	33,779	5,079,074	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	1,252	1,604	38,331	5,763,468	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,182	1,578	15,665	2,355,479	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	197	271	7,809	1,174,273	資本財
NORDSON CORP	256	305	8,366	1,257,944	資本財
HCA HEALTHCARE INC	987	1,192	37,601	5,653,686	ヘルスケア機器・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	2,097	2,296	38,940	5,855,112	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	741	904	10,199	1,533,610	公益事業
DEXCOM INC	1,878	2,395	27,845	4,186,839	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC	1,144	1,400	17,595	2,645,676	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	528	640	62,884	9,455,257	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILLIPS 66	2,197	2,650	38,998	5,863,758	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A	10,780	13,545	655,651	98,583,766	メディア・娯楽
CMS ENERGY CORP	1,384	1,892	10,919	1,641,829	公益事業
ALBEMARLE CORP	577	768	9,272	1,394,221	素材
KINDER MORGAN INC	9,493	11,117	19,178	2,883,621	エネルギー
APTIV PLC	1,312	1,714	13,238	1,990,557	自動車・自動車部品
ABBVIE INC	8,595	10,799	192,322	28,917,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	224	282	12,215	1,836,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	13,130	16,894	324,328	48,766,064	自動車・自動車部品
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	922	1,220	14,467	2,175,329	金融サービス
ZOETIS INC	2,263	2,759	54,426	8,183,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	362	430	15,803	2,376,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	1,719	2,184	5,773	868,123	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS B	824	824	2,274	341,964	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	258	297	8,051	1,210,549	資本財
REVVITY INC	606	753	7,864	1,182,496	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	738	876	6,278	943,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	344	401	7,069	1,062,916	金融サービス
SERVICENOW INC	992	1,258	97,048	14,592,161	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	317	317	5,212	783,712	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	343	442	12,432	1,869,337	金融サービス
ALLEGION PLC	390	476	6,147	924,322	資本財
ALPHABET INC-CL C	24,938	25,108	364,799	54,851,253	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	339	422	27,777	4,176,694	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,912	4,434	6,709	1,008,868	運輸
IQVIA HOLDINGS INC	888	1,169	28,925	4,349,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,277	1,631	33,361	5,016,296	消費者サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	852	1,096	19,335	2,907,244	エネルギー
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	870	1,050	15,758	2,369,410	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	745	999	15,098	2,270,245	メディア・娯楽
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	1,931	2,155	3,485	524,149	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	1,490	1,907	53,798	8,089,101	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	2,117	2,535	10,173	1,529,725	金融サービス
QORVO INC	506	506	5,709	858,545	半導体・半導体製造装置
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,044	1,340	32,831	4,936,613	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2,337	3,241	10,096	1,518,094	銀行
TARGA RESOURCES CORP	1,075	1,424	13,818	2,077,768	エネルギー
WESTROCK CO	1,254	1,675	7,355	1,105,992	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	3,870	4,620	16,658	2,504,770	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	5,487	6,512	38,530	5,793,436	金融サービス
EPAM SYSTEMS INC	267	326	9,850	1,481,159	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	225	354	6,548	984,617	商業・専門サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	6,509	7,145	10,796	1,623,405	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CDW CORP/DE	672	834	20,631	3,102,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	265	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ARISTA NETWORKS INC	1,220	1,509	40,393	6,073,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BIO-RAD LABORATORIES-A	106	106	3,600	541,336	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA INC	175	215	9,361	1,407,615	消費者サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	499	584	17,497	2,630,924	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	410	517	29,795	4,480,028	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	653	653	5,316	799,397	資本財
FORTIVE CORP	1,778	2,200	18,945	2,848,618	資本財
HOWMET AEROSPACE INC	1,716	2,444	16,100	2,420,867	資本財
LAMB WESTON HOLDINGS INC	670	937	9,626	1,447,493	食品・飲料・タバコ
TELEFLEX INC	236	304	7,231	1,087,385	ヘルスケア機器・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	492	665	13,125	1,973,484	金融サービス
DXC TECHNOLOGY CO	1,218	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ROLLINS INC	1,171	1,805	7,686	1,155,741	商業・専門サービス
FAIR ISAAC CORP	118	149	19,215	2,889,274	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	4,863	5,870	17,547	2,638,463	エネルギー
DUPONT DE NEMOURS INC	2,212	2,500	17,493	2,630,395	素材
INGERSOLL-RAND INC	2,011	2,479	22,442	3,374,478	資本財
TYLER TECHNOLOGIES INC	208	275	12,057	1,812,948	ソフトウェア・サービス
PTC INC	530	760	13,763	2,069,462	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	2,031	2,679	347,394	52,234,274	半導体・半導体製造装置
EVERGY INC	1,135	1,456	7,367	1,107,776	公益事業
THE CIGNA GROUP	1,448	1,761	60,652	9,119,684	ヘルスケア機器・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	1,034	1,260	5,248	789,124	消費者サービス
FOX CORP - CLASS A	1,367	1,367	4,133	621,576	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS B	590	1,132	3,134	471,250	メディア・娯楽
DOW INC	3,386	4,453	25,110	3,775,635	素材
STERIS PLC	497	630	14,879	2,237,252	ヘルスケア機器・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	—	12,586	98,426	14,799,468	運輸
CORTEVA INC	3,374	4,481	24,604	3,699,554	素材
AMCOR PLC	7,240	9,132	8,465	1,272,891	素材
ETSY INC	622	622	4,603	692,145	一般消費財・サービス流通・小売り
MODERNA INC	1,569	1,910	18,427	2,770,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAYFORCE INC	755	907	6,484	974,978	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		
GENERAC HOLDINGS INC	281	314	3,543	532,838	資本財	
AON PLC-CLASS A	1,006	1,203	37,940	5,704,743	保険	
OTIS WORLDWIDE CORP	1,980	2,572	24,060	3,617,715	資本財	
CARRIER GLOBAL CORP	3,997	5,230	28,350	4,262,846	資本財	
CATALENT INC	980	903	5,311	798,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MATCH GROUP INC	1,307	1,393	5,136	772,348	メディア・娯楽	
VIATRIS INC	5,801	6,842	9,257	1,391,947	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENPHASE ENERGY INC	683	825	9,757	1,467,177	半導体・半導体製造装置	
AIRBNB INC-CLASS A	—	2,618	39,971	6,010,149	消費者サービス	
APA CORP	1,513	1,973	5,927	891,304	エネルギー	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	771	14,556	2,188,737	資本財	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	921	1,069	9,409	1,414,766	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ORGANON & CO	1,128	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CONSTELLATION ENERGY	1,595	1,973	26,440	3,975,595	公益事業	
WARNER BROS DISCOVERY INC	10,748	13,487	11,612	1,746,043	メディア・娯楽	
JACOBS SOLUTIONS INC	597	785	11,544	1,735,801	商業・専門サービス	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,913	2,262	20,155	3,030,563	ヘルスケア機器・サービス	
LINDE PLC	2,383	2,961	132,531	19,927,498	素材	
KENVUE INC	8,397	10,341	19,834	2,982,349	家庭用品・パーソナル用品	
VERALTO CORP	—	1,227	10,639	1,599,818	商業・専門サービス	
BUNGE GLOBAL SA	—	798	7,474	1,123,934	食品・飲料・タバコ	
合 計	株 数	金 額	1,495,100	1,877,953	25,496,841	3,833,705,135
	銘柄 数 < 比 率 >		474	474	—	< 96.0% >

(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	279	364	6,064	911,895	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73	94	11,548	1,736,392	0.0	
PROLOGIS INC	449	557	74,315	11,174,152	0.3	
CAMDEN PROPERTY TRUST	52	70	6,654	1,000,568	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	138	188	25,919	3,897,204	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	31	36	8,283	1,245,580	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	105	121	17,078	2,567,943	0.1	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37	37	3,699	556,309	0.0	
WELLTOWER INC	239	343	32,059	4,820,498	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	73	100	6,518	980,196	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	53	71	9,081	1,365,478	0.0	
REALTY INCOME CORP	324	531	28,143	4,231,630	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	72	87	5,295	796,254	0.0	
UDR INC	144	172	6,182	929,548	0.0	
VENTAS INC	202	262	11,575	1,740,549	0.0	
WEYERHAEUSER CO	363	453	15,134	2,275,647	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	228	280	53,206	8,000,117	0.2	
IRON MOUNTAIN INC	138	182	13,714	2,062,057	0.1	
EQUINIX INC	45	56	49,921	7,506,231	0.2	
CROWN CASTLE INC	209	265	28,819	4,333,247	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	170	223	13,476	2,026,334	0.1	
INVITATION HOMES INC	278	377	12,564	1,889,222	0.0	
VICI PROPERTIES INC	487	632	19,018	2,859,562	0.1	
SBA COMMUNICATIONS CORP	53	65	14,019	2,108,016	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	339	402	8,164	1,227,588	0.0	
PUBLIC STORAGE	77	98	28,147	4,232,324	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	162	202	30,500	4,585,980	0.1	
KIMCO REALTY CORP	301	414	8,092	1,216,789	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	69	83	14,584	2,192,953	0.1	
合 計	口 数 ・ 金 額	5,207	6,779	561,786	84,470,278	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	29	—	< 2.1% >	

(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) 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 81,692	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

(2024年2月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 3,833,705,135	% 96.0
投資証券	84,470,278	2.1
コール・ローン等、その他	76,552,918	1.9
投資信託財産総額	3,994,728,331	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (3,988,750,078千円) の投資信託財産総額 (3,994,728,331千円) に対する比率は99.9%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=150.36円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年2月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,006,070,972,922
コール・ローン等	48,322,818,651
株式(評価額)	3,833,705,135,020
投資証券(評価額)	84,470,278,568
未収入金	12,776,909,096
未収配当金	3,763,354,893
差入委託証拠金	23,032,476,694
(B) 負債	11,347,253,916
未払金	11,346,180,523
未払解約金	1,072,789
未払利息	604
(C) 純資産総額(A-B)	3,994,723,719,006
元本	812,212,760,364
次期繰越損益金	3,182,510,958,642
(D) 受益権総口数	812,212,760,364口
1万口当たり基準価額(C/D)	49,183円

<注記事項>

- ①期首元本額 650,934,696,266円
 期中追加設定元本額 172,905,113,932円
 期中一部解約元本額 11,627,049,834円
 また、1口当たり純資産額は、期末4.9183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&P500)	769,100,490,026円
eMAXIS S&P500インデックス	11,957,717,055円
MAXIS 米国株式(S&P500) 上場投信	10,644,385,638円
MAXIS 米国株式(S&P500) 上場投信(為替ヘッジあり)	6,930,095,594円
つみたて米国株式(S&P500)	6,616,233,752円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	2,577,366,525円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	1,937,812,325円
MUAM S&P500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)	1,599,747,811円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07(適格機関投資家限定)	193,251,440円
MUKAM S&P500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)	121,706,006円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	106,778,784円
S&P500インデックスファンドV(適格機関投資家限定)	94,754,066円
日米コアバランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	72,454,886円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	56,160,521円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	55,551,068円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	54,895,994円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	48,583,006円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	44,775,867円
合計	812,212,760,364円

○損益の状況 (2023年8月26日～2024年2月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	24,308,621,735
受取配当金	22,687,504,457
受取利息	1,620,874,552
その他収益金	771,891
支払利息	△ 529,165
(B) 有価証券売買損益	591,555,931,341
売買益	641,187,098,155
売買損	△ 49,631,166,814
(C) 先物取引等取引損益	11,955,565,119
取引益	15,007,525,646
取引損	△ 3,051,960,527
(D) 保管費用等	△ 140,672,984
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	627,679,445,211
(F) 前期繰越損益金	2,007,923,602,301
(G) 追加信託差損益金	585,972,483,642
(H) 解約差損益金	△ 39,064,572,512
(I) 計(E+F+G+H)	3,182,510,958,642
次期繰越損益金(I)	3,182,510,958,642

- (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。

【お 知 ら せ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)