

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	無期限（2022年12月16日設定）	
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、各投資対象ファンドの受益証券への投資を通じて瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）の株式および先進国の株式に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。 各投資対象ファンドの受益証券については、以下の組入比率を目途に投資を行います。 <ul style="list-style-type: none"> 瀬戸内3県株式マザーファンドの受益証券 <ul style="list-style-type: none"> …信託財産の純資産総額の50% 先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）の受益証券 <ul style="list-style-type: none"> …信託財産の純資産総額の50% 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 	
主要投資対象	当ファンド	瀬戸内3県株式マザーファンドの受益証券および先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）の受益証券を主要投資対象とします。
	瀬戸内3県株式マザーファンド 先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 日本を除く先進国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
収益分配方針	<ul style="list-style-type: none"> 年1回の決算時（12月15日（休業日の場合は翌営業日））に分配を行います。経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案のうえ決定します。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。 	

せとうち応援株式ファンド （愛称：せとうちサポーター）

第1期 運用報告書（全体版）

決算日 2023年12月15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、「せとうち応援株式ファンド（愛称：せとうちサポーター）」は2023年12月15日に第1期の決算を行いました。

当ファンドは、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）の株式および先進国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行ってまいりました。ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

◆ 中銀アセットマネジメント

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

〈お問い合わせ先〉

サポートダイヤル：086-224-5310

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページ：<https://www.chugin-am.jp/>

* お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 込 金	期 騰 落 中 率			
(設 定 時) 2022年12月16日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 1,203
1期 (2023年12月15日)	12,438	0	24.4	47.1	49.7	2,734

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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」は実質比率を記載しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

(注) 当ファンドにはベンチマークおよび参考指数はありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		騰 落 率			
(設 定 時) 2022年12月16日	円 10,000	% —	% —	% —	
12月末	9,756	△ 2.4	46.2	40.6	
2023年 1月末	10,080	0.8	46.3	48.2	
2月末	10,396	4.0	46.3	48.1	
3月末	10,491	4.9	47.0	48.9	
4月末	10,740	7.4	47.4	48.4	
5月末	11,071	10.7	46.9	49.5	
6月末	11,868	18.7	46.7	48.5	
7月末	12,073	20.7	47.2	48.5	
8月末	12,401	24.0	47.6	48.5	
9月末	12,273	22.7	46.9	48.7	
10月末	11,790	17.9	47.6	48.6	
11月末	12,568	25.7	47.5	49.0	
(期 末) 2023年12月15日	12,438	24.4	47.1	49.7	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定時比です。

(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」は実質比率を記載しております。

運用経過

■基準価額等の推移について（2022年12月16日～2023年12月15日）



設定時：10,000円

第1期末：12,438円（既払分配金0円）

騰落率：24.4%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについては、お客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 分配金再投資基準価額は、設定時の値が基準価額と同一になるように指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から当期末12,438円へ2,438円の上昇となりました。騰落率は、24.4%の上昇となりました。

【主な上昇要因】

国内株式ならびに先進国株式がそろって大幅に上昇したこと、加えて米ドルが円に対して上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

■投資環境について（2022年12月16日～2023年12月15日）

【国内株式】

当期の国内株式は上昇しました。

前半は、米国の景気減速懸念や欧米の金融システム不安により下落する局面がありましたが、日銀の金融緩和政策の継続や堅調な企業業績見通し、ならびに東京証券取引所によるPBR（株価純資産倍率）が1倍割れ企業に対する取組みへの期待から上昇基調となりました。後半は、国内外の金融政策に関する思惑が交錯するなかで、国内経済の回復期待や円安による企業業績の上振れ観測などから、国内株式は一時33年ぶりの高値を更新し、もみ合いながらも底堅い推移となりました。

【先進国株式】

当期の先進国株式は上昇しました。

米国では、米金融機関の経営破綻を発端とした金融システム不安や米金利の高騰により調整する局面はありましたが、インフレピークアウトやFRB（米連邦準備制度理事会）の利上げペース減速期待、ならびに底堅い米国経済指標などから、当期の米国株式は上昇しました。

欧州では、欧米の金融システム不安や、中国景気や域内経済の不透明感から軟調となる局面がありましたが、ECB（欧州中央銀行）による利上げペースの減速や底堅い米国経済指標などを背景とした米国株式の上昇にも支えられ、当期の欧州株式は上昇しました。

【為替】

米ドルは米国金利の上昇による日米金利差拡大などから円に対して上昇しました。

■当ファンドのポートフォリオについて（2022年12月16日～2023年12月15日）

【当ファンド】

瀬戸内3県株式マザーファンドの受益証券および先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）の受益証券への投資を通じて、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）および先進国の株式に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行いました。各投資対象ファンドの受益証券の組入比率は、信託財産の純資産総額のそれぞれ50%程度の組入比率を目途として、総じて高位に維持しました。当期末における瀬戸内3県株式マザーファンドと先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）の組入比率は、それぞれ48.6%、49.7%となりました。

瀬戸内3県株式マザーファンドと先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）がともに上昇したことが、基準価額にプラスに寄与しました。

【瀬戸内3県株式マザーファンド】

わが国の金融商品取引所上場株式の中から、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行いました。瀬戸内3県の企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（以下、「瀬戸内3県企業」といいます。）および瀬戸内3県に進出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。瀬戸内3県企業の株式への投資については、時価総額、市場流動性及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定しました。進出企業の株式への投資については、時価総額、瀬戸内3県との関連度及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定しました。結果、当期間の騰落率は+24.2%となりました。

【先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）】

先進国株式ESG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、主として日本を除く先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する成果を目指して運用を行いました。結果、当期間の騰落率は+25.8%となりました。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

■分配金について

当期につきましては、信託財産の成長を優先するため、収益分配の実施は見送りといたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

【分配原資の内訳】

(1万口当たり・税込み)

項 目	第 1 期
	2022年12月16日～2023年12月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	－円 －%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	2,437円

(注) 「当期の収益」は、費用控除後の配当等収益および費用控除後・繰越欠損補填後の有価証券売買等損益から分配に充当した金額です。また「当期の収益以外」は収益調整金および分配準備積立金から分配に充当した金額です。

(注) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は小数点以下切捨のため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(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、当ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針について

【当ファンド】

瀬戸内3県株式マザーファンドの受益証券および先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）の受益証券への投資を通じて、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）および先進国の株式に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。各投資対象ファンドの受益証券の組入比率は、信託財産の純資産総額のそれぞれ50%程度の組入比率を目途に投資を行います。

【瀬戸内3県株式マザーファンド】

わが国の金融商品取引所上場株式の中から、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。瀬戸内3県の企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（以下、「瀬戸内3県企業」といいます。）および瀬戸内3県に進出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。瀬戸内3県企業の株式への投資については、時価総額、市場流動性及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。進出企業の株式への投資については、時価総額、瀬戸内3県との関連度及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。

【先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）】

先進国株式ESG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、主として日本を除く先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する成果を目指して運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期 2022年12月16日～2023年12月15日		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	128円	1.133%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">※期中の平均基準価額は11,292円です。</div>
(投 信 会 社)	(62)	(0.550)	委託した資金の運用等の対価
(販 売 会 社)	(62)	(0.550)	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	4	0.034	(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
(株 式)	(4)	(0.034)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	1	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
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	133	1.172	

(注) 期中において発生した費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含まず。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

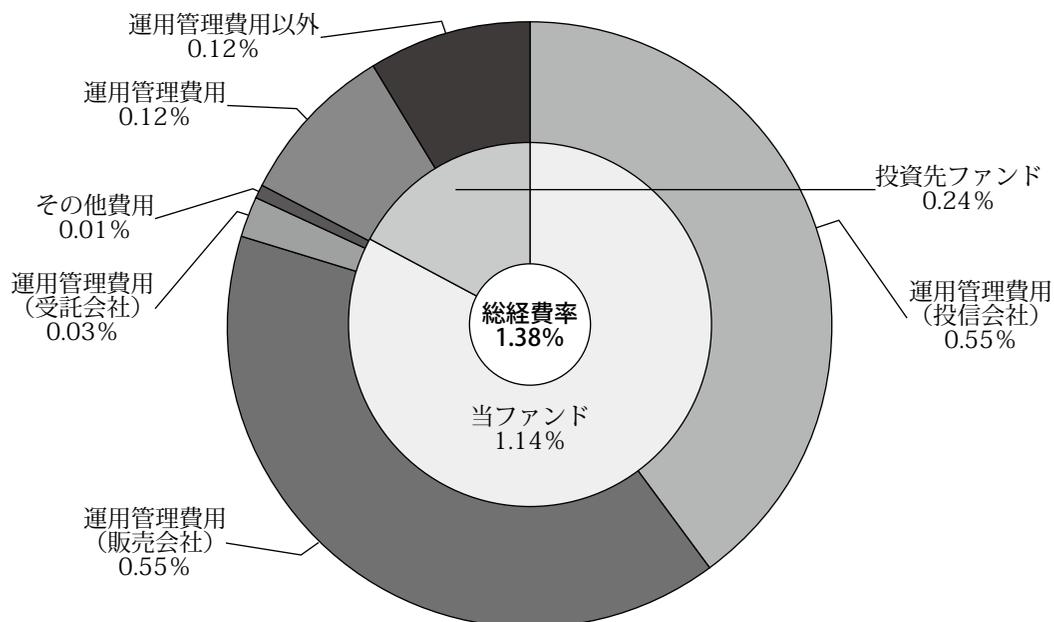
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点第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1.38%です。



総経費率 (①+②+③)	1.38%
①当ファンドの費用の比率	1.14%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.12%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.12%

- (注) ①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注) 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) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2022年12月16日から2023年12月15日まで）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド (適格機関投資家限定)	1,160,297,930	1,219,000	87,295,516	99,000
合計		1,160,297,930	1,219,000	87,295,516	99,000

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 口数、金額の単位未満は切捨てております。

親投資信託証券

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
瀬戸内3県株式マザーファンド	1,102,215	1,186,000	51,959	59,000

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 口数、金額の単位未満は切捨てております。

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	瀬戸内3県株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,408,595千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,534,607千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.91

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

■瀬戸内3県株式マザーファンドにおける主要な売買銘柄（2022年12月16日から2023年12月15日まで）
株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
I H I	7	25,528	3,646	大建工業	7.9	23,761	3,007
トレックス・セミコンダクター	9.3	23,720	2,550	T A K I S A W A	6.7	17,118	2,554
ダイヘン	4.3	22,748	5,290	ベネッセホールディングス	5.7	14,775	2,592
カルビー	7.2	20,950	2,909	ディスコ	0.5	10,263	20,526
ライオン	14.4	20,902	1,451	神戸製鋼所	8.5	9,916	1,166
日本ペイントホールディングス	18.3	20,650	1,128	イーグル工業	3.2	5,147	1,608
麒麟ホールディングス	9.5	19,946	2,099	大日本印刷	0.9	3,619	4,021
三菱瓦斯化学	10.1	19,632	1,943	プレス工業	5.8	3,417	589
アサヒグループホールディングス	3.6	19,459	5,405	エクセディ	1.5	3,413	2,275
積水化学工業	9.2	17,665	1,920	パナソニック ホールディングス	2.1	3,359	1,599

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 金額、平均単価の単位未満は切捨てております。

(注) 株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

■利害関係人との取引状況等（2022年12月16日から2023年12月15日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2023年12月15日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	口	千円	%
先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド (適 格 機 関 投 資 家 限 定)	1,073,002,414	1,360,352	49.7
合 計	1,073,002,414	1,360,352	49.7

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てております。

(注) 比率は、純資産総額に対する割合です。

親投資信託証券の明細

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
瀬戸内3県株式マザーファンド	1,050,256	1,330,254

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨てております。

(注) 瀬戸内3県株式マザーファンド全体の受益権口数は期末1,543,801千口です。

<補足情報>

■瀬戸内3県株式マザーファンドの組入資産の明細 (2023年12月15日現在)

国内株式

上場株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
建設業 (4.8%)		
ウエストホールディングス	2.8	8,610
ミライト・ワン	10.4	18,855
ビーアールホールディングス	27.6	9,687
大本組	3.5	8,221
大和ハウス工業	5	21,135
四電工	4.2	12,457
中電工	4.4	11,224
食料品 (10.5%)		
山崎製パン	8.4	26,476
カルビー	7.2	19,663
ヤクルト本社	5.5	17,066
明治ホールディングス	5.8	19,151
アサヒグループホールディングス	3.6	19,134
キリンホールディングス	9.4	19,580
やまみ	7.2	23,184
アヲハタ	4.1	10,204
日清食品ホールディングス	1.6	22,984
あじかん	0.4	404
日本たばこ産業	5.8	21,547
繊維製品 (2.8%)		
倉敷紡績	4.6	11,357
帝人	13.6	17,795
自重堂	1.1	10,978
マツオカコーポレーション	7.6	12,122
パルプ・紙 (0.0%)		
岡山製紙	0.4	428
化学 (14.0%)		
クラレ	7.8	10,962
旭化成	22	22,385
四国化成ホールディングス	7.2	12,024
戸田工業	5.5	8,723
三菱瓦斯化学	10.1	22,315
三菱ケミカルグループ	21.8	20,537
ダイセル	16.6	21,538
積水化学工業	9.2	18,602
大倉工業	4.3	11,558
ダイキョーニシカワ	13.3	9,376
日本ペイントホールディングス	17.9	19,976
中国塗料	8.3	13,462

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ライオン	14.4	18,792
ヤスハラケミカル	0.4	240
日東電工	2.2	21,848
エフビコ	4.3	12,345
ユニ・チャーム	4.1	20,020
医薬品 (1.2%)		
東和薬品	9.8	22,432
石油・石炭製品 (1.1%)		
E N E O Sホールディングス	35.4	20,677
ゴム製品 (4.0%)		
横浜ゴム	6.9	21,728
住友ゴム工業	13.1	21,064
西川ゴム工業	7.8	13,689
三ツ星ベルト	4.3	18,748
ガラス・土石製品 (1.0%)		
日本興業	0.4	312
東洋炭素	4.2	19,278
鉄鋼 (2.2%)		
神戸製鋼所	12.8	21,465
J F Eホールディングス	8.9	19,037
大和重工	0.4	396
非鉄金属 (5.2%)		
三井金属鉱業	5.5	23,754
三菱マテリアル	8.1	20,245
D O W Aホールディングス	4.4	22,272
住友電気工業	11.7	20,638
リョービ	4.3	11,192
金属製品 (0.0%)		
中国工業	0.4	256
機械 (14.8%)		
日本製鋼所	7.3	18,001
ディスコ	0.7	23,051
ジェイ・イー・ティ	2.7	18,117
横田製作所	0.4	498
タツモ	4.1	10,688
住友重機械工業	5.6	19,790
北川鉄工所	8.5	10,463
ローツェ	1.2	16,908
北川精機	0.4	299
石井表記	11.8	8,165

銘柄	当期末		
	株数	評価	金額
	千株		千円
タダノ	10		10,935
NTN	72		18,770
ジェイテクト	15.6		18,681
イーグル工業	12.3		19,470
三井E&S	42.3		26,099
日立造船	24.2		22,264
三菱重工業	2.7		20,552
IHI	7		18,308
電気機器 (11.2%)			
トレックス・セミコンダクター	9.2		16,780
ダイヘン	4.3		26,660
オムロン	3.2		20,153
アドテック プラズマ テクノロジー	7.3		12,475
パナソニック ホールディングス	13		17,777
シャープ	21.7		22,611
アオイ電子	5.9		12,732
フェローテックホールディングス	7		18,599
ローム	7.2		20,880
京セラ	2.8		22,666
村田製作所	7.5		21,165
輸送用機器 (5.4%)			
川崎重工業	5.5		16,159
内海造船	0.4		1,784
三菱自動車工業	38.3		16,721
プレス工業	29.5		16,992
マツダ	7.3		11,015
エクセディ	7.8		18,860
日本精機	19.3		21,847
精密機器 (0.5%)			
JMS	19.6		9,858
その他製品 (2.7%)			
ドリームベッド	0.4		305
オービス	5.4		7,657
萩原工業	6.8		9,662
南海ブライウッド	0.4		2,136
ウッドワン	9.6		9,715
大日本印刷	5.3		22,339
研創	0.4		207
セーラー万年筆	0.4		56
電気・ガス業 (1.7%)			
中国電力	11.9		12,179
四国電力	10.8		10,999
広島ガス	25.9		9,531
陸運業 (2.9%)			
西日本旅客鉄道	3.5		20,695

銘柄	当期末		
	株数	評価	金額
	千株		千円
広島電鉄	0.4		311
岡山県貨物運送	0.4		1,194
ヤマトホールディングス	7.8		20,315
福山通運	3.1		11,671
情報・通信業 (0.2%)			
データホライゾン	3.7		2,978
東和ハイシステム	0.4		627
卸売業 (3.6%)			
オルパヘルスケアホールディングス	6		10,314
アルフレッサ ホールディングス	8.3		19,737
メディバルホールディングス	8.2		18,581
長瀬産業	8		18,128
ポエック	0.4		485
コンセック	0.4		498
小売業 (7.9%)			
エディオン	7.2		10,656
ハローズ	2.8		11,214
大黒天物産	1.8		12,312
ウエルシアホールディングス	7.7		18,268
セブン&アイ・ホールディングス	3.6		19,753
サンマルクホールディングス	6		11,862
はるやまホールディングス	19.7		10,795
マルヨシセンター	0.4		1,440
テイツー	57		7,809
青山商事	7.9		12,134
イオン	6.8		20,801
イズミ	3.3		11,899
天満屋ストア	0.4		438
アシードホールディングス	0.4		234
不動産業 (0.6%)			
穴吹興産	5.3		10,578
サービス業 (1.7%)			
E・Jホールディングス	7.4		11,558
セーラー広告	0.4		120
KG情報	0.4		246
アスカネット	13.4		9,500
ウエスコホールディングス	21.6		10,908
フェニックスバイオ	0.4		182
合計	株数・金額	1,199	1,894,017
	銘柄数<比率>	139	<96.9%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 株数、評価額の単位未満は切捨てております。ただし株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

■投資信託財産の構成

(2023年12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,360,352	49.1
瀬戸内3県株式マザーファンド	1,330,254	48.0
コール・ローン等、その他	80,509	2.9
投資信託財産総額	2,771,115	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年12月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,771,115,271円
コール・ローン等	80,507,929
投資信託受益証券(評価額)	1,360,352,460
瀬戸内3県株式マザーファンド(評価額)	1,330,254,882
(B) 負 債	36,709,982
未払解約金	22,556,546
未払信託報酬	14,084,911
未払利息	220
その他未払費用	68,305
(C) 純資産総額(A-B)	2,734,405,289
元 本	2,198,498,430
次期繰越損益金	535,906,859
(D) 受益権総口数	2,198,498,430口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,438円

(注) 当ファンドの当初設定元本額は1,203,155,563円、期中追加設定元本額は1,535,693,229円、期中一部解約元本額は540,350,362円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2438円です。

■損益の状況

当期(自2022年12月16日 至2023年12月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,373,849円
受 取 配 当 金	6,449,665
支 払 利 息	△ 75,816
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	376,260,752
売 買 益	443,048,260
売 買 損	△ 66,787,508
(C) 信 託 報 酬 等	△ 23,467,609
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	359,166,992
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	176,739,867
(配 当 等 相 当 額)	(1,489,374)
(売 買 損 益 相 当 額)	(175,250,493)
(F) 計 (D+E)	535,906,859
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	535,906,859
追 加 信 託 差 損 益 金	176,739,867
(配 当 等 相 当 額)	(3,251,572)
(売 買 損 益 相 当 額)	(173,488,295)
分 配 準 備 積 立 金	359,166,992

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(E)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,934,212円)、費用控除後の有価証券等損益額(329,232,780円)、および信託約款に規定する収益調整金(176,739,867円)より分配対象収益は535,906,859円(10,000口当たり2,437円)ですが、当期に分配した金額はありません。

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

当期につきましては、信託財産の成長を優先するため、収益分配の実施は見送りといたしました。
なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■お知らせ

約款の運用の基本方針の投資制限において、投資信託証券を通じて行うデリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）については、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しない旨を明示し、所要の約款変更を行いました。

なお、上記約款変更により商品としての基本的な性格が変わるものではありません。

（実施日：2023年9月15日）

瀬戸内3県株式マザーファンド

運用報告書

《第1期》

決算日：2023年7月21日

(計算期間：2022年7月22日～2023年7月21日)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2022年7月22日から無期限です。
運用方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。



中銀アセットマネジメント

岡山県岡山市北区柳町2丁目11番23号

<https://www.chugin-am.jp/>

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰	落 中 率			
(設 定 時) 2022年7月22日	円 10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 499
1期 (2023年7月21日)	12,086	20.9	96.2	—	1,677	

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てております。

(注) 当ファンドにはベンチマークおよび参考指数はありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	率		
(設 定 時) 2022年 7月22日	円 10,000	% —	% —	% —	% —
7月末	9,886	△ 1.1	93.2	—	—
8月末	10,152	1.5	93.3	—	—
9月末	9,702	△ 3.0	93.1	—	—
10月末	9,961	△ 0.4	93.4	—	—
11月末	10,353	3.5	95.9	—	—
12月末	9,933	△ 0.7	96.0	—	—
2023年 1月末	10,279	2.8	96.0	—	—
2月末	10,595	6.0	96.0	—	—
3月末	10,844	8.4	96.7	—	—
4月末	11,110	11.1	96.7	—	—
5月末	11,237	12.4	97.5	—	—
6月末	12,086	20.9	96.3	—	—
(期 末) 2023年 7月21日	12,086	20.9	96.2	—	—

(注) 騰落率は設定時比です。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

■当期の運用概況と今後の運用方針（2022年7月22日から2023年7月21日まで）



◆基準価額の変動要因

基準価額は、設定時10,000円から当期末12,086円へ2,086円の上昇となりました。騰落率は、20.9%の上昇となりました。

<主な上昇要因>

国内の経済活動正常化期待や企業業績の回復
日米の金融政策運営方針の違いなどを背景とした為替相場の円安基調
東京証券取引所による市場改革への期待の高まり

<主な下落要因>

インフレ長期化懸念による各国中央銀行の金融引き締め動向に対する不透明感の高まり
米国や欧州における金融システム不安の台頭

◆投資環境について

当期の国内株式市場は上昇しました。期首から2023年2月にかけては、米国や欧州における金融引き締めの動向が相場の下押し要因になった一方で、日銀による金融緩和政策の継続に加えて、企業業績の改善や国内の経済活動正常化の動きに支えられたことにより、レンジ内で底堅く推移しました。2023年3月には、米銀行の経営破綻を発端とした金融システム不安が広がり大きく下落する場面がありました。その後は、東京証券取引所によるPBR（株価純資産倍率）が1倍割れ企業に対する取組みへの期待や、堅調な企業業績見通しならびに米著名投資家による国内株式に対する強気な発言などから上昇しました。

◆当ファンドのポートフォリオについて

わが国の金融商品取引所上場株式の中から、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行いました。瀬戸内3県の企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（以下、「瀬戸内3県企業」といいます。）および瀬戸内3県に進出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。瀬戸内3県企業の株式への投資については、時価総額、市場流動性及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定しました。進出企業の株式への投資については、時価総額、瀬戸内3県との関連度及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定しました。

なお、当期末において、瀬戸内3県企業の組入銘柄数は75、組入比率は約28.6%となり、進出企業の組入銘柄数は65、組入比率は約67.6%となりました。

株式の組入比率は総じて高位を維持し、当期末では96.2%となりました。

当期は、神戸製鋼所、ディスコ、東洋炭素、テイツーなどがプラス寄与した一方で、東和薬品、シャープ、トレックス・セミコンダクター、アスカネットなどがやや不冴えでした。

◆今後の運用方針について

わが国の金融商品取引所上場株式の中から、瀬戸内3県の企業（金融業を除きます。）に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。瀬戸内3県の企業とは、岡山県、広島県、香川県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（以下、「瀬戸内3県企業」といいます。）および瀬戸内3県に進出している企業（以下、「進出企業」といいます。）とします。瀬戸内3県企業の株式への投資については、時価総額、市場流動性及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。進出企業の株式への投資については、時価総額、瀬戸内3県との関連度及び投資リスク等を考慮して銘柄選定を行い、投資比率を決定します。

■1万口当たりの費用明細

項 目	金 額	比 率
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	11円 (11)	0.100% (0.100)
合 計	11	0.100

(注) 1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の計算期間のものであります。

(注) 項目の概要については、6ページの「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

■期中の売買及び取引の状況 (2022年7月22日から2023年7月21日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株	千円	千株	千円
		1,097 (3)	1,484,200 (-)	57	95,554

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 株数、金額の単位未満は切捨てております。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

■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	1,579,754千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	968,120千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.63

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) 金額の単位未満は切捨てております。

■主要な売買銘柄（2022年7月22日から2023年7月21日まで）

株 式

買		付			売		付		
銘	柄	株数	金額	平均単価	銘	柄	株数	金額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
シャープ		21.7	20,373	938	ディスコ		0.5	10,263	20,526
トレックス・セミコンダクター		7.6	20,019	2,634	神戸製鋼所		8.5	9,916	1,166
東和薬品		9.1	19,818	2,177	TAKI SAWA		2.9	7,279	2,510
ライオン		13.2	19,241	1,457	イーグル工業		3.2	5,147	1,608
ウエルシアホールディングス		6.4	19,232	3,005	大日本印刷		0.9	3,619	4,021
カルビー		6.4	18,750	2,929	プレス工業		5.8	3,417	589
IHI		4.8	18,530	3,860	エクセディ		1.5	3,413	2,275
旭化成		18.4	18,491	1,004	パナソニック ホールディングス		2.1	3,359	1,599
DOWAホールディングス		4.1	18,295	4,462	山崎製パン		1.6	3,263	2,039
京セラ		2.6	18,263	7,024	横浜ゴム		1	3,076	3,076

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 金額、平均単価の単位未満は切捨てております。

(注) 株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

■利害関係人との取引状況等（2022年7月22日から2023年7月21日まで）

期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細 (2023年7月21日現在)

国内株式
上場株式

銘柄	当期末		
	株数	評価	価額
	千株		千円
建設業 (4.8%)			
ウエストホールディングス	2.3		6,336
ミライト・ワン	9.8		17,571
ビーアールホールディングス	24.4		9,589
大本組	1.1		7,942
大和ハウス工業	4.7		17,502
四電工	4.2		9,454
中電工	4.1		9,618
食料品 (9.4%)			
山崎製パン	8.4		17,824
カルビー	6.4		17,600
ヤクルト本社	2		17,514
明治ホールディングス	5.2		17,430
アサヒグループホールディングス	3.2		17,728
キリンホールディングス	8.4		17,438
やまみ	7.1		9,570
アヲハタ	0.3		748
日清食品ホールディングス	1.5		17,842
あじかん	0.3		259
日本たばこ産業	5.7		17,624
繊維製品 (2.8%)			
倉敷紡績	4.1		9,471
帝人	11.9		17,457
自重堂	1		9,150
マツオカコーポレーション	7.6		9,712
パルプ・紙 (0.0%)			
岡山製紙	0.3		271
化学 (12.7%)			
クラレ	7		9,632
旭化成	18.4		17,498
四国化成ホールディングス	6.6		9,477
戸田工業	4.3		9,365
三菱ケミカルグループ	21.1		17,466
ダイセル	13.7		17,426
積水化学工業	8.6		17,423
大倉工業	4.3		9,417
ダイキョーニシカワ	12.4		9,362
日本ペイントホールディングス	14.8		17,338
中国塗料	8		9,320
ライオン	13.2		17,681
ヤスハラケミカル	0.3		168

銘柄	当期末		
	株数	評価	価額
	千株		千円
日東電工	1.7		17,229
エフビコ	3.4		9,644
ユニ・チャーム	3.3		17,262
医薬品 (1.0%)			
東和薬品	9.1		15,915
石油・石炭製品 (1.1%)			
E N E O Sホールディングス	35.4		17,590
ゴム製品 (3.9%)			
横浜ゴム	5.7		17,493
住友ゴム工業	12.3		17,644
西川ゴム工業	7.2		9,842
三ツ星ベルト	3.9		17,062
ガラス・土石製品 (1.1%)			
日本興業	0.3		228
東洋炭素	3.3		17,490
鉄鋼 (2.2%)			
神戸製鋼所	12.8		17,804
J F Eホールディングス	8.5		18,041
大和重工	0.3		234
非鉄金属 (5.0%)			
三井金属鉱業	5.4		17,312
三菱マテリアル	7.1		17,515
D O W Aホールディングス	4		17,800
住友電気工業	10		17,605
リョービ	4.3		11,081
金属製品 (0.0%)			
中国工業	0.3		219
機械 (14.3%)			
日本製鋼所	6		17,472
T A K I S A W A	3.8		9,682
ディスコ	0.7		16,243
横田製作所	0.3		339
タツモ	4.1		9,179
住友重機械工業	5.2		17,690
北川鉄工所	8.1		9,509
ロートエ	0.9		9,153
北川精機	0.3		235
石井表記	10.8		9,525
タダノ	8.7		9,596
N T N	57.2		17,434
ジェイテクト	13.4		17,466

銘柄	当期末		
	株数	評価額	千円
イーグル工業	9.8	17,208	
三井E&S	35.2	17,459	
日立造船	19.4	17,537	
三菱重工業	2.7	17,679	
I H I	4.8	17,683	
電気機器 (10.9%)			
トレックス・セミコンダクター	7.5	17,025	
ダイヘン	3.2	17,344	
オムロン	2.1	17,679	
アドテック プラズマ テクノロジー	6.5	10,302	
パナソニック ホールディングス	10.3	17,901	
シャープ	21.7	17,316	
アオイ電子	5.3	9,635	
フェローテックホールディングス	4.9	16,929	
ローム	1.3	16,919	
京セラ	2.3	17,401	
村田製作所	2.1	17,272	
輸送用機器 (6.1%)			
川崎重工業	4.8	17,294	
内海造船	0.3	549	
三菱自動車工業	34.6	17,953	
プレス工業	27.7	17,367	
マツダ	7.2	9,860	
エクセディ	7.2	17,532	
日本精機	17.8	17,355	
精密機器 (0.6%)			
JMS	16.9	9,582	
その他製品 (3.9%)			
ドリームベッド	0.3	263	
オービス	5.4	7,003	
萩原工業	6.3	9,657	
南海プライウッド	0.3	1,584	
ウッドワン	7.9	9,298	
大建工業	7.6	17,464	
大日本印刷	4.4	17,604	
研創	0.3	149	
セーラー万年筆	0.3	48	
電気・ガス業 (1.8%)			
中国電力	10.4	9,974	
四国電力	9.9	9,797	
広島ガス	24.3	9,039	
陸運業 (2.8%)			
西日本旅客鉄道	3	17,136	
広島電鉄	0.3	242	
岡山県貨物運送	0.3	918	

銘柄	当期末		
	株数	評価額	千円
ヤマトホールディングス	6.7	17,557	
福山通運	2.4	9,600	
情報・通信業 (0.6%)			
データホライズン	3.3	8,679	
東和ハイシステム	0.3	549	
卸売業 (3.9%)			
オルパヘルスケアホールディングス	5.3	9,259	
アルフレッサ ホールディングス	8.1	17,649	
メディバルホールディングス	7.4	17,889	
長瀬産業	7.4	17,538	
ボエック	0.3	440	
コンセック	0.3	337	
小売業 (8.1%)			
エディオン	6.6	9,589	
ハローズ	2.6	9,555	
大黒天物産	1.6	9,680	
ウエルシアホールディングス	6.4	17,436	
セブン&アイ・ホールディングス	2.9	16,999	
サンマルクホールディングス	5.1	9,781	
はるやまホールディングス	19.1	9,702	
マルヨシセンター	0.3	924	
テイソー	42.4	9,158	
青山商事	7.4	9,472	
イオン	6.1	17,836	
イズミ	2.8	9,724	
天満屋ストア	0.3	319	
アシードホールディングス	0.3	171	
不動産業 (0.6%)			
穴吹興産	4.3	9,219	
サービス業 (2.4%)			
E・Jホールディングス	6	9,582	
セーラー広告	0.3	97	
KG情報	0.3	116	
アスカネット	11.7	9,535	
ウエストホールディングス	18.3	9,607	
フェニックスバイオ	0.3	175	
ベネッセホールディングス	5.2	9,500	
合計	1,042	1,614,439	
	銘柄数<比率>	140	<96.2%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 株数、評価額の単位未満は切捨てております。ただし株数が単位未満の場合は小数で記載しております。

(注) 一印は組み入れなしです。

■投資信託財産の構成

(2023年7月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 1,614,439	% 93.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	108,649	6.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,723,088	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年7月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,723,088,240円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	102,262,042
株 式(評価額)	1,614,439,370
未 収 入 金	3,062,628
未 収 配 当 金	3,324,200
(B) 負 債	45,355,780
未 払 金	45,355,500
未 払 利 息	280
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,677,732,460
元 本	1,388,202,798
次 期 繰 越 損 益 金	289,529,662
(D) 受 益 権 総 口 数	1,388,202,798口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,086円

(注) 当マザーファンドの当初設定元本額は499,000,000円、期中追加設定元本額は945,194,453円、期中一部解約元本額は55,991,655円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、下記の通りです。

元本の内訳

せとうち応援株式会社ファンド 893,235,095円

瀬戸内3県株式会社ファンド(適格機関投資家専用) 494,967,703円

(注) 1口当たり純資産額は1,2086円です。

■損益の状況

当期(自2022年7月22日 至2023年7月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	27,238,828円
受 取 配 当 金	27,292,020
そ の 他 収 益 金	210
支 払 利 息	△ 53,402
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	225,793,632
売 買 益	250,871,527
売 買 損	△ 25,077,895
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	253,032,460
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	43,805,547
(E) 解 約 差 損 益 金	△ 7,308,345
(F) 計 (C+D+E)	289,529,662
次 期 繰 越 損 益 金(F)	289,529,662

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

(注) 損益の状況の中で(E)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

該当事項はございません。

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	2032年5月20日まで（2022年9月26日設定）	
運用方針	先進国株式ESG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、主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。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	先進国株式ESG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。
	マザーファンド	日本を除く先進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。	

※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。

運用報告に係わる情報

先進国株式ESGリーダーズ インデックスファンド (適格機関投資家限定)



第1期（決算日：2023年5月22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「先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）」は、去る5月22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。



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)

お客さまのお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			MSCIコクサイESGリーダーズ指数		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)	税金	み	期	中				
(設定日)	円	円	騰	騰	騰	%	%	%	百万円
2022年9月26日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	1
1期(2023年5月22日)	10,998	85	10.8	10,966.73	10.5	94.2	3.5	2.1	1,432

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）とは、MSCI Inc.が開発したMSCIコクサイESGリーダーズ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が計算したものです。MSCIコクサイESGリーダーズ指数（米ドルベース）は、MSCI ESGリサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、日本を除く先進国の株式から、業種内において相対的にESG（環境、社会、ガバナンス）評価が優れた企業で構成されています。

MSCIコクサイESGリーダーズ指数（米ドルベース）に対する著作権およびその他の財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(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		MSCIコクサイESGリーダーズ指数		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	騰	落	騰	落			
(設定日)	円	%	%	%	%	%	%
2022年9月26日	10,000	—	—	—	—	—	—
9月末	9,641	△ 3.6	9,533.50	△ 4.0	92.8	4.8	2.2
10月末	10,525	5.3	10,419.84	5.0	92.0	5.6	2.1
11月末	10,292	2.9	10,196.44	2.7	90.7	6.8	2.2
12月末	9,677	△ 3.2	9,588.66	△ 3.4	92.3	8.9	2.3
2023年1月末	10,026	0.3	9,945.78	0.2	93.4	3.8	2.4
2月末	10,387	3.9	10,292.31	3.7	92.7	5.9	2.2
3月末	10,356	3.6	10,256.19	3.3	93.2	4.2	2.2
4月末	10,626	6.3	10,520.06	6.0	92.5	5.2	2.1
(期末)							
2023年5月22日	11,083	10.8	10,966.73	10.5	94.2	3.5	2.1

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 期末基準価額は分配金込み、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

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ10.8%（分配金再投資ベース）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（10.5%）を0.3%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは設定時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

◎ 外国株式市況

- ・外国株式市況は上昇しました。
- ・世界的なインフレへの警戒、米銀破綻による金融システム不安を受けて外国株式市況は期間中下落したものの、米国の利上げペース減速やインフレピークアウトへの期待、堅調な経済指標などを受けて上昇して期間を終えました。

◎ 為替市況

- ・米ドルは円に対して下落、ユーロ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4.7%の円高・米ドル安、5.1%の円安・ユーロ高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

＜先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）＞

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。

＜先進国株式ESGインデックスマザーファンド＞

- ・MSCIコクサイESGリーダーズ指数（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。

- ・株式の国別比率、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

- ・なお、MSCIコクサイESGリーダーズ指数は各業界ごとに相対的にESG評価に優れると判断した企業で構成される指数で、ファンドはその構成比率を高位に維持しました。加えて、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の対象期間の騰落率は10.5%、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の同期間の騰落率は8.6%となっております。

ESGスコアは下表の通りとなっております。

ESGスコア (2023年4月28日時点)

MSCIコクサイ・インデックス	6.931
MSCIコクサイESGリーダーズ指数	7.774

※ESGスコアとは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数を構成する個別銘柄ごとのスコア（評点）を、指数構成銘柄の組入比率によって加重平均し0～10点（0が最低評価）で示したものです。ESGリスク（ESGへの取り組み姿勢）を相対的に比較することができます。個別銘柄ごとのスコアは、業種ごとに直面するESGリスク特性などを勘案して相対的に評価・算出したものです。

なお、MSCIコクサイESGリーダーズ指数と同様の条件で構成され、ESGを考慮していないMSCIコクサイ・インデックスと比較しています。

※MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
 <先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）>

ベンチマークとのカイ離は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△0.2%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0.5%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）

・取引要因によるものです。

●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
	2022年9月26日～ 2023年5月22日
当期分配金	85
（対基準価額比率）	0.767%
当期の収益	85
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	998

（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

<先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）>

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

<先進国株式ESG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。

○ 1万口当たりの費用明細

(2022年9月26日～2023年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	16	0.158	(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 ）	(10)	(0.101)	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 ）	(4)	(0.036)	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 ）	(2)	(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	0.003	(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)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.023	(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 ）	(2)	(0.022)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	14	0.136	(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 ）	(14)	(0.134)	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)	(0.002)	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	32	0.320	
期中の平均基準価額は、10,206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。

○売買及び取引の状況

(2022年9月26日～2023年5月22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
先進国株式ESGインデックスマザーファンド	1,328,029 千口	1,316,425 千円	23,354 千口	25,192 千円

○株式売買比率

(2022年9月26日～2023年5月22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	
	先進国株式ESGインデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	1,433,908千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,716,732千円	
(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

(2022年9月26日～2023年5月22日)

利害関係人との取引状況

<先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド（適格機関投資家限定）>
該当事項はございません。

<先進国株式ESG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 1,591	百万円 1,540	% 96.8	百万円 267	百万円 262	% 98.1

平均保有割合 30.5%

※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信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年9月26日～2023年5月22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 1	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2023年5月22日現在)

親投資信託残高

銘柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
先進国株式ESGインデックスマザーファンド	千口 1,304,674	千円 1,432,271

○投資信託財産の構成

(2023年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
先進国株式ESGインデックスマザーファンド	千円 1,432,271	% 99.1
コール・ローン等、その他	12,738	0.9
投資信託財産総額	1,445,009	100.0

(注) 先進国株式ESG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(3,645,056千円)の投資信託財産総額(3,658,788千円)に対する比率は99.6%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=137.72円	1 カナダドル=102.08円	1 ユーロ=149.01円	1 イギリスポンド=171.70円
1 スイスフラン=153.35円	1 スウェーデンクローネ=13.11円	1 ノルウェークローネ=12.66円	1 デンマーククローネ=20.01円
1 オーストラリアドル=91.76円	1 ニュージーランドドル=86.57円	1 香港ドル=17.61円	1 シンガポールドル=102.49円
1 イスラエルシェケル=37.8146円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年5月22日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,445,009,226
コール・ローン等	1,577,866
先進国株式ESGインデックスマザーファンド(評価額)	1,432,271,562
未収入金	11,159,798
(B) 負債	12,538,448
未払収益分配金	11,070,963
未払信託報酬	1,447,157
未払利息	2
その他未払費用	20,326
(C) 純資産総額(A-B)	1,432,470,778
元本	1,302,466,299
次期繰越損益金	130,004,479
(D) 受益権総口数	1,302,466,299口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,998円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 1,313,456,316円
 期中一部解約元本額 11,990,017円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0998円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年9月26日～ 2023年5月22日
費用控除後の配当等収益額	13,871,975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	124,674,469円
収益調整金額	2,528,998円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	141,075,442円
1万円当たり収益分配対象額	1,083円
1万円当たり分配金額	85円
収益分配金金額	11,070,963円

○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金（税込み）	85円
----------------	-----

- ◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。
 ◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2023年5月22日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

○損益の状況（2022年9月26日～2023年5月22日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 63
支払利息	△ 63
(B) 有価証券売買損益	140,013,990
売買益	142,155,979
売買損	△ 2,141,989
(C) 信託報酬等	△ 1,467,483
(D) 当期損益金(A+B+C)	138,546,444
(E) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	2,528,998 (2,528,998)
(F) 計(D+E)	141,075,442
(G) 収益分配金	△ 11,070,963
次期繰越損益金(F+G)	130,004,479
追加信託差損益金 (配当等相当額)	2,528,998 (1,780,799)
(売買損益相当額)	(748,199)
分配準備積立金	127,475,481

- (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) (E)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。

[お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、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す。

先進国株式ESGインデックスマザーファンド

《第2期》決算日2023年5月22日

[計算期間：2022年5月21日～2023年5月22日]

「先進国株式ESGインデックスマザーファンド」は、5月22日に第2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2期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として日本を除く先進国の株式に投資を行います。 株式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。 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	日本を除く先進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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (配当込み、円換算ベース)		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
	期騰落	中率	期騰落	中率				
(設定日) 2021年10月29日	円	%	10,000.00	%	%	%	%	百万円 999
1期(2022年5月20日)	9,299	△ 7.0	9,304.91	△ 7.0	96.4	3.4	2.4	1,605
2期(2023年5月22日)	10,978	18.1	10,966.73	17.9	94.3	3.5	2.1	3,647

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (配当込み、円換算ベース) とは、MSCI Inc. が開発した MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (米ドルベース) をもとに委託会社が計算したものです。MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (米ドルベース) は、MSCI ESG リサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、日本を除く先進国の株式から、業種内において相対的に ESG (環境、社会、ガバナンス) 評価が優れた企業で構成されています。

MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (米ドルベース) に対する著作権およびその他の知的財産権はすべて MSCI Inc. に帰属します。

(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		M S C I ESGリー	コクサイ	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	率	ダ ー ジ 指 数	騰 落 率			
(期 首) 2022年5月20日	円	%	(配当込み、円換算ベース)	%	%	%	%
	9,299	—	9,304.91	—	96.4	3.4	2.4
5月末	9,908	6.5	9,915.92	6.6	93.0	4.6	2.4
6月末	9,751	4.9	9,757.59	4.9	91.4	6.1	2.4
7月末	10,107	8.7	10,099.66	8.5	92.8	4.5	2.5
8月末	10,039	8.0	10,040.02	7.9	91.3	6.3	2.4
9月末	9,534	2.5	9,533.50	2.5	92.8	4.8	2.2
10月末	10,411	12.0	10,419.84	12.0	92.0	5.6	2.1
11月末	10,182	9.5	10,196.44	9.6	90.7	6.8	2.2
12月末	9,575	3.0	9,588.66	3.0	92.3	8.9	2.3
2023年1月末	9,923	6.7	9,945.78	6.9	93.4	3.8	2.4
2月末	10,282	10.6	10,292.31	10.6	92.7	5.9	2.2
3月末	10,253	10.3	10,256.19	10.2	93.2	4.2	2.2
4月末	10,523	13.2	10,520.06	13.1	92.5	5.2	2.1
(期 末) 2023年5月22日	10,978	18.1	10,966.73	17.9	94.3	3.5	2.1

(注) 騰落率は期首比。

(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

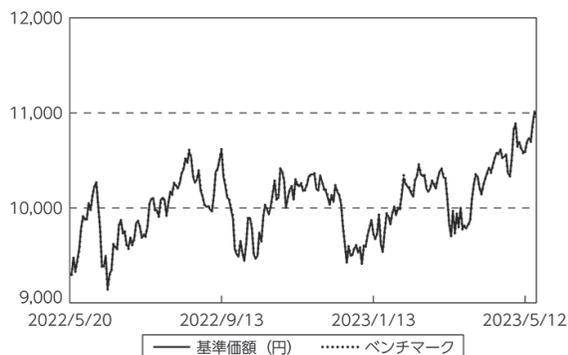
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ18.1%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(17.9%)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

◎外国株式市況

- ・外国株式市況は上昇しました。
- ・世界的なインフレへの警戒、米銀破綻による金融システム不安を受けて外国株式市況は期間中下落したものの、米国の利上げペース減速やインフレピークアウトへの期待、堅調な経済指標などを受けて上昇して期間を終えました。

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロ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7.7%の円安・米ドル高、10.2%の円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・MSCIコクサイESGリーダーズ指数（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。
- ・株式の国別比率、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

- ・なお、MSCIコクサイESGリーダーズ指数は各業界ごとに相対的にESG評価に優れると判断した企業で構成される指数で、ファンドはその構成比率を高位に維持しました。加えて、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の対象期間の騰

落率は17.9%、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の同期間の騰落率は17.5%となっております。

ESGスコアは下表の通りとなっております。

ESGスコア (2023年4月28日時点)	
MSCIコクサイ・インデックス	6.931
MSCIコクサイESGリーダーズ指数	7.774

※ESGスコアとは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数を構成する個別銘柄ごとのスコア（評点）を、指数構成銘柄の組入比率によって加重平均し0～10点（0が最低評価）で示したものです。ESGリスク（ESGへの取り組み姿勢）を相対的に比較することができます。個別銘柄ごとのスコアは、業種ごとに直面するESGリスク特性などを勘案して相対的に評価・算出したものです。

なお、MSCIコクサイESGリーダーズ指数と同様の条件で構成され、ESGを考慮していないMSCIコクサイ・インデックスと比較しています。

※MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは17.9%の上昇になったため、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)

- ・取引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

(2022年5月21日～2023年5月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(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
(株 式)	(0)	(0.005)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.032	(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
(株 式)	(3)	(0.032)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	25	0.245	(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
(保 管 費 用)	(25)	(0.245)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	29	0.283	
期中の平均基準価額は、10,051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。

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 352	千香港ドル 1,305	百株 18	千香港ドル 271
	シンガポール	55 (210)	千シンガポールドル 64 (-)	292 (0.17)	千シンガポールドル 70 (0.12429)
	イスラエル	3	千イスラエルシェケル 12	3	千イスラエルシェケル 9

(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
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	0.369	9	—	—
PROLOGIS INC	0.579	65	0.019	2
WELLTOWER INC	0.245	16	—	—
BOSTON PROPERTIES INC	0.026	1	—	—
VENTAS INC	0.532	26	0.107	5
WEYERHAEUSER CO	0.424	13	—	—
AMERICAN TOWER CORP	0.251	53	0.012	3
EQUINIX INC	0.041	26	—	—
CROWN CASTLE INC	0.197	27	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	—	—	0.184	14
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.109	33	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	0.393	7
小計	2	274	0.715	32
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
GECINA SA	0.029	2	—	—
KLEPIERRE	0.086	1	—	—
COVIVIO	0.034	1	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	(0.081)	(5)	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	(0.081)	(5)
小計	0.149	6	—	—
小計	(0.081)	(5)	(0.081)	(5)
ユーロ計	0.149	6	—	—
ユーロ計	(0.081)	(5)	(0.081)	(5)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	0.498	1	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.996	6	—	—
SEGRO PLC	1	11	0.498	4
小計	2	19	0.498	4
オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
VICINITY CENTRES	1	2	—	—
SCENTRE GROUP	3	10	—	—
DEXUS/AU	0.354	2	—	—
GPT GROUP	0.713	3	—	—
MIRVAC GROUP	4	10	2	6
GOODMAN GROUP	1	17	—	—
小計	12	47	2	6
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
CAPITALAND ASCOTT TRUST	—	—	0.114	0.12059
CAPITALAND ASCOTT TRUST	(0.114)	(0.12429)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	0.015	0.01828

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	—	—	—	—
		(—)	(△ 0.0056)		
小計		—	—	0.129	0.13887
		(0.114)	(0.11869)		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、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	百万円	百万円	百万円
		1,246	1,192	—	—

(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

(2022年5月21日～2023年5月22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	1,883,471千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,381,838千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.79

(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

(2022年5月21日～2023年5月22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 1,730	百万円 1,818	95.2	百万円 277	百万円 295	93.9

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

(2023年5月22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	3	6	100	13,839	金融サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1	2	36	5,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2	4	92	12,742	商業・専門サービス
AFLAC INC	3	5	37	5,213	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	4	7	39	5,465	保険
ACCENTURE PLC-CL A	3	6	185	25,512	ソフトウェア・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	—	2	108	14,880	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	2	5	22	3,149	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	1	2	19	2,671	一般消費財・サービス流通・小売り
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	11	21	142	19,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	0.88	1	106	14,690	金融サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	22	42	154	21,279	電気通信サービス
BALL CORP	1	3	20	2,759	素材
ALLSTATE CORP	1	2	31	4,314	保険
CHUBB LTD	2	3	77	10,694	保険
CATERPILLAR INC	2	5	115	15,943	資本財
COCA-COLA CO/THE	21	40	256	35,329	食品・飲料・タバコ
CAMPBELL SOUP CO	1	1	8	1,204	食品・飲料・タバコ
CSX CORP	12	20	66	9,210	運輸
CME GROUP INC	1	3	62	8,563	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	1	2	23	3,230	ヘルスケア機器・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	4	7	60	8,344	家庭用品・パーソナル用品
DEERE & CO	1	2	107	14,820	資本財
WALT DISNEY CO/THE	9	18	170	23,488	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	0.74	—	—	—	消費者サービス
TARGET CORP	2	4	68	9,374	生活必需品流通・小売り
DAVITA INC	0.19	0.41	4	566	ヘルスケア機器・サービス
DOVER CORP	0.78	1	24	3,361	資本財
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3	6	55	7,617	ヘルスケア機器・サービス
EXELON CORP	—	10	42	5,814	公益事業
ECOLAB INC	1	2	45	6,227	素材
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1	2	44	6,193	家庭用品・パーソナル用品
EATON CORP PLC	2	3	65	9,041	資本財
EDISON INTERNATIONAL	2	3	26	3,637	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	2	3	7	1,048	金融サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.22	0.32	12	1,746	金融サービス
GENERAL MILLS INC	3	5	50	7,011	食品・飲料・タバコ
WW GRAINGER INC	0.22	0.47	32	4,413	資本財
GENUINE PARTS CO	0.76	1	27	3,789	一般消費財・サービス流通・小売り
HALLIBURTON CO	—	9	28	3,922	エネルギー
HP INC	5	10	31	4,374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1	3	26	3,600	保険
HOME DEPOT INC	5	10	298	41,061	一般消費財・サービス流通・小売り
HASBRO INC	0.8	1	6	913	耐久消費財・アマパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1	2	39	5,488	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4	9	116	16,001	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末) 株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			株数	外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
INTERNATIONAL PAPER CO	1	5	18	2,535	素材
ILLINOIS TOOL WORKS	1	2	66	9,139	資本財
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2	2	11	1,578	メディア・娯楽
IDEX CORP	0.42	0.87	17	2,456	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1	2	21	2,996	素材
JOHNSON & JOHNSON	13	25	412	56,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	1	2	15	2,081	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	1	3	48	6,691	家庭用品・パーソナル用品
KROGER CO	3	6	33	4,573	生活必需品流通・小売り
ELI LILLY & CO	4	8	354	48,800	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	0.5	0.97	21	2,896	ヘルスケア機器・サービス
LOWE'S COS INC	3	6	126	17,470	一般消費財・サービス流通・小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	1	—	—	—	保険
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.09	0.27	7	1,071	資本財
MCDONALD'S CORP	3	7	214	29,509	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	1	3	130	17,915	金融サービス
MERCK & CO. INC.	13	25	289	39,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	2	5	52	7,296	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.86	1	47	6,595	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MASCO CORP	1	1	9	1,331	資本財
M & T BANK CORP	0.89	—	—	—	銀行
MARSH & MCLENNAN COS	2	4	83	11,536	保険
MOHAWK INDUSTRIES INC	0.16	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MOODY'S CORP	0.89	1	53	7,332	金融サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	1	2	49	6,867	運輸
NEWMONT CORP	4	7	34	4,708	素材
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1	2	24	3,306	食品・飲料・タバコ
NUCOR CORP	—	2	35	4,927	素材
NEWELL BRANDS INC	2	2	2	306	耐久消費財・アパレル
OMNICOM GROUP	1	—	—	—	メディア・娯楽
PEPSICO INC	7	13	263	36,222	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO/THE	12	23	359	49,551	家庭用品・パーソナル用品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2	3	46	6,461	銀行
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2	3	30	4,225	保険
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1	3	22	3,145	保険
PPG INDUSTRIES INC	1	2	33	4,628	素材
PENTAIR PLC	0.46	1	7	1,083	資本財
PROGRESSIVE CORP	2	5	74	10,193	保険
REPUBLIC SERVICES INC	—	2	33	4,615	商業・専門サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	4	6	11	1,571	銀行
ROPER TECHNOLOGIES INC	0.53	1	47	6,492	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	0.68	0.68	4	640	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	0.64	1	32	4,532	資本財
SCHLUMBERGER LTD	7	13	61	8,410	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	7	14	76	10,488	金融サービス
SEMPRA ENERGY	1	2	42	5,884	公益事業
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	2	55	7,597	素材
STANLEY BLACK & DECKER INC	0.89	—	—	—	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	1	2	41	5,718	保険
STATE STREET CORP	2	4	31	4,298	金融サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	4	8	151	20,827	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	3	6	42	5,824	資本財

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	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2	3	207	28,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNION PACIFIC CORP	3	6	128	17,701	運輸
US BANCORP	7	13	41	5,647	銀行
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	3	7	129	17,820	運輸
VALERO ENERGY CORP	2	3	42	5,853	エネルギー
VF CORP	2	2	5	701	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	6	11	34	4,755	エネルギー
WASTE MANAGEMENT INC	2	—	—	—	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.32	0.71	18	2,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KEYCORP	4	12	12	1,681	銀行
CARMAX INC	0.91	1	8	1,175	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COMPANIES INC	6	11	91	12,556	一般消費財・サービス流通・小売り
CLOROX COMPANY	0.67	1	23	3,276	家庭用品・パーソナル用品
CELANESE CORP	—	1	15	2,144	素材
CADENCE DESIGN SYS INC	1	2	57	7,879	ソフトウェア・サービス
CONAGRA BRANDS INC	2	5	20	2,759	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	1	3	32	4,417	公益事業
INTEL CORP	21	41	125	17,250	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	22	40	199	27,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	4	8	109	15,018	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	1	2	34	4,689	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	—	4	7	970	ソフトウェア・サービス
NIKE INC -CL B	6	12	147	20,340	耐久消費財・アパレル
AMGEN INC	3	5	119	16,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP	1	2	21	2,933	金融サービス
MICROSOFT CORP	37	70	2,239	308,470	ソフトウェア・サービス
ANSYS INC	0.48	0.95	29	3,997	ソフトウェア・サービス
CENTENE CORP	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
STARBUCKS CORP	6	—	—	—	消費者サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	3	—	—	—	メディア・娯楽
TRACTOR SUPPLY COMPANY	0.6	1	26	3,582	一般消費財・サービス流通・小売り
POOL CORP	0.22	0.3	10	1,425	一般消費財・サービス流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	0.71	1	76	10,542	半導体・半導体製造装置
COPART INC	1	4	38	5,322	商業・専門サービス
PACCAR INC	1	—	—	—	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	1	1	6	830	ヘルスケア機器・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.4	0.83	24	3,326	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	6	12	98	13,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	0.73	—	—	—	ソフトウェア・サービス
INTUIT INC	1	2	118	16,339	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	0.3	—	—	—	銀行
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	0.96	28	3,984	運輸
AUTODESK INC	1	2	42	5,892	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE INC	5	9	209	28,825	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	1	58	718	98,970	メディア・娯楽
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.29	0.38	10	1,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.24	0.32	9	1,254	金融サービス
GARMIN LTD	0.86	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TRIMBLE INC	1	1	8	1,179	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	1	2	22	3,162	ヘルスケア機器・サービス
T ROWE PRICE GROUP INC	1	2	31	4,390	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS INC	0.65	0.85	11	1,539	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	
STEEL DYNAMICS INC	1	1	13	1,858	素材
CERNER CORP	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EBAY INC	3	5	25	3,550	一般消費財・サービス流通・小売り
NVIDIA CORP	13	24	765	105,446	半導体・半導体製造装置
BOOKING HOLDINGS INC	0.21	—	—	—	消費者サービス
TRUIST FINANCIAL CORP	6	13	38	5,366	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	4	7	31	4,386	金融サービス
BORGWARNER INC	0.67	2	9	1,271	自動車・自動車部品
JM SMUCKER CO/THE	0.59	—	—	—	食品・飲料・タバコ
AMERISOURCEBERGEN CORP	0.81	1	27	3,796	ヘルスケア機器・サービス
ASSURANT INC	0.17	0.36	4	639	保険
PLUG POWER INC	—	3	2	405	資本財
BIOGEN INC	0.76	1	44	6,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	0.77	1	31	4,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	2	4	170	23,416	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1	2	83	11,435	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDITORS INTL WASH INC	0.89	1	19	2,682	運輸
FASTENAL CO	2	5	32	4,453	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2	5	1	272	メディア・娯楽
HUNTINGTON BANCSHARES INC	7	15	16	2,232	銀行
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0.68	0.91	9	1,258	運輸
ONEOK INC	2	4	25	3,530	エネルギー
BUNGE LTD	0.74	1	10	1,395	食品・飲料・タバコ
ADVANCE AUTO PARTS INC	0.35	0.44	5	711	一般消費財・サービス流通・小売り
NVR INC	0.02	—	—	—	耐久消費財・アパレル
AMERIPRISE FINANCIAL INC	0.61	1	31	4,352	金融サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	2	5	57	7,959	金融サービス
NASDAQ INC	0.72	4	25	3,496	金融サービス
CBRE GROUP INC - A	1	3	29	4,129	不動産管理・開発
CUMMINS INC	0.76	1	30	4,207	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	0.68	27	3,824	素材
MASTERCARD INC - A	4	8	329	45,401	金融サービス
WESTERN UNION CO	1	—	—	—	金融サービス
MOSAIC CO/THE	1	4	15	2,127	素材
INSULET CORP	0.39	0.84	25	3,482	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	0.63	1	27	3,763	保険
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1	2	29	4,037	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	0.61	1	41	5,735	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	0.24	0.45	58	8,124	一般消費財・サービス流通・小売り
VMWARE INC-CLASS A	1	2	29	4,086	ソフトウェア・サービス
LOEWS CORP	1	1	8	1,222	保険
ULTA BEAUTY INC	—	0.45	22	3,043	一般消費財・サービス流通・小売り
LKQ CORP	1	1	10	1,489	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	1	3	14	2,058	食品・飲料・タバコ
ESSENTIAL UTILITIES INC	1	1	7	986	公益事業
HUMANA INC	0.65	1	61	8,486	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	2	4	6	908	金融サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	0.96	2	20	2,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	8	16	380	52,342	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	3	7	24	3,379	食品・飲料・タバコ
RESMED INC	0.76	1	32	4,483	ヘルスケア機器・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1	4	32	4,459	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	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	—	0.6	10	1,391	運輸
QUANTA SERVICES INC	—	1	27	3,807	資本財
EVERSOURCE ENERGY	1	3	25	3,486	公益事業
DELTA AIR LINES INC	0.45	1	3	529	運輸
AMERICAN WATER WORKS CO INC	0.95	1	25	3,545	公益事業
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.12	0.22	30	4,200	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	2	45	6,216	半導体・半導体製造装置
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1	—	—	—	素材
HCA HEALTHCARE INC	1	2	61	8,480	ヘルスケア機器・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	3	4	53	7,322	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	0.7	1	20	2,825	公益事業
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	0.93	0.93	6	837	資本財
DEXCOM INC	0.51	3	44	6,129	ヘルスケア機器・サービス
XYLEM INC	1	2	24	3,368	資本財
ABIOMED INC	0.29	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0.17	0.43	5	795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	0.92	—	—	—	銀行
PHILLIPS 66	2	4	43	6,040	エネルギー
KINDER MORGAN INC	—	19	32	4,520	エネルギー
APTIV PLC	1	2	26	3,600	自動車・自動車部品
SPLUNK INC	—	1	18	2,571	ソフトウェア・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	0.25	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TESLA INC	4	26	483	66,636	自動車・自動車部品
CHENIERE ENERGY INC	1	2	31	4,277	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1	1	14	2,037	金融サービス
ZOETIS INC	2	4	81	11,176	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.39	0.83	29	4,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAP-ON INC	0.34	0.42	10	1,508	資本財
BIO-TECHNE CORP	0.21	2	19	2,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORKDAY INC-CLASS A	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	—	2	103	14,196	ソフトウェア・サービス
ALLEGION PLC	0.59	0.59	6	888	資本財
ALPHABET INC-CL C	1	55	681	93,900	メディア・娯楽
UNITED RENTALS INC	0.39	0.76	26	3,653	資本財
ALLY FINANCIAL INC	2	2	7	1,022	金融サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1	2	41	5,659	消費者サービス
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	0.96	1	28	3,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0.64	1	26	3,596	メディア・娯楽
OWENS CORNING	0.29	0.68	7	1,031	資本財
SYNCHRONY FINANCIAL	—	3	11	1,542	金融サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1	2	43	5,951	保険
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2	6	16	2,249	銀行
LEAR CORP	—	0.48	6	826	自動車・自動車部品
TARGA RESOURCES CORP	—	2	19	2,746	エネルギー
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	0.11	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	—	1	5	723	素材
HORIZON THERAPEUTICS PLC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	7	13	19	2,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
U-HAUL HOLDING CO	0.03	—	—	—	運輸
COGNEX CORP	0.49	1	6	875	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VAIL RESORTS INC	0.28	0.28	6	936	消費者サービス
DOMINO'S PIZZA INC	0.21	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
IDEXX LABORATORIES INC	0.45	0.83	40	5,579	ヘルスケア機器・サービス	
SMITH (A.O.) CORP	—	1	7	979	資本財	
UGI CORP	1	1	4	582	公益事業	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	1	2	14	1,974	食品・飲料・タバコ	
FORTIVE CORP	1	3	23	3,257	資本財	
HOWMET AEROSPACE INC	2	—	—	—	資本財	
TELEFLEX INC	0.26	0.33	8	1,107	ヘルスケア機器・サービス	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	0.64	0.84	11	1,607	金融サービス	
ROLLINS INC	—	1	6	881	商業・専門サービス	
BAKER HUGHES CO	4	11	32	4,438	エネルギー	
OKTA INC	0.86	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	2	—	—	—	素材	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	1	6	872	運輸	
INGERSOLL-RAND INC	—	4	26	3,613	資本財	
NOVOCURE LTD	0.26	0.69	5	754	ヘルスケア機器・サービス	
HUBSPOT INC	—	0.55	26	3,639	ソフトウェア・サービス	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	0.07	—	—	—	保険	
TELADOC HEALTH INC	0.39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LINDE PLC	2	—	—	—	素材	
EQUITABLE HOLDINGS INC	2	3	7	1,079	金融サービス	
BURLINGTON STORES INC	0.4	0.53	8	1,225	一般消費財・サービス流通・小売り	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	3	3	444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
THE CIGNA GROUP	1	3	82	11,349	ヘルスケア機器・サービス	
STERIS PLC	0.53	1	22	3,116	ヘルスケア機器・サービス	
AMCOR PLC	8	16	17	2,393	素材	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	0.64	12	1,745	金融サービス	
CABLE ONE INC	0.02	—	—	—	メディア・娯楽	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	10	3	6	949	金融サービス	
GENERAC HOLDINGS INC	0.38	0.55	6	861	資本財	
AON PLC-CLASS A	1	—	—	—	保険	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	4	35	4,867	資本財	
CARRIER GLOBAL CORP	—	8	35	4,914	資本財	
CARLYLE GROUP INC/THE	0.78	2	6	849	金融サービス	
CATALENT INC	1	1	3	527	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	2	4	670	メディア・娯楽	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	2	3	417	自動車・自動車部品	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	—	10	2	393	運輸	
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	1	5	791	銀行	
WARNER BROS DISCOVERY INC	11	24	29	4,109	メディア・娯楽	
HF SINCLAIR CORP	—	1	5	700	エネルギー	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	—	0.63	3	486	運輸	
LINDE PLC	—	4	183	25,222	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	702	1,482	17,838	2,456,746	
	銘柄 数 < 比 率 >	259	260	—	< 67.4% >	
(カナダ)			千カナダドル			
THOMSON REUTERS CORP	0.5	1	25	2,605	商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	2	4	29	3,007	電気通信サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	3	—	—	—	保険	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	1	—	—	—	資本財	
BANK OF MONTREAL	3	7	82	8,430	銀行	
BROOKFIELD CORP	8	14	58	5,949	金融サービス	
BANK OF NOVA SCOTIA	6	11	77	7,939	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		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
CAE INC	1	2	6	614	資本財	
CAMECO CORP	1	3	10	1,113	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4	—	—	—	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	3	6	101	10,379	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	0.3	1	22	2,249	一般消費財・サービス流通・小売り	
ENBRIDGE INC	11	22	110	11,244	エネルギー	
LOBLAW COMPANIES LTD	1	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
MANULIFE FINANCIAL CORP	11	—	—	—	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2	3	21	2,181	自動車・自動車部品	
NATIONAL BANK OF CANADA	2	3	35	3,617	銀行	
POWER CORP OF CANADA	—	4	16	1,635	保険	
AGNICO EAGLE MINES LTD	3	4	31	3,252	素材	
KINROSS GOLD CORP	4	10	6	711	素材	
GILDAN ACTIVWEAR INC	1	1	3	403	耐久消費財・アパレル	
FORTIS INC	2	5	32	3,268	公益事業	
LUNDIN MINING CORP	2	6	6	651	素材	
TORONTO-DOMINION BANK	—	18	154	15,771	銀行	
FRANCO-NEVADA CORP	1	—	—	—	素材	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	3	5	32	3,314	素材	
METRO INC/CN	1	2	15	1,535	生活必需品流通・小売り	
OPEN TEXT CORP	—	3	16	1,720	ソフトウェア・サービス	
INTACT FINANCIAL CORP	0.86	2	46	4,697	保険	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	0.4	0.77	5	594	商業・専門サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	3	6	25	2,574	エネルギー	
DOLLARAMA INC	—	3	25	2,588	一般消費財・サービス流通・小売り	
KEYERA CORP	1	2	6	636	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	1	3	11	1,198	公益事業	
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	4	4	458	素材	
SHOPIFY INC - CLASS A	0.56	11	92	9,420	ソフトウェア・サービス	
NUTRIEN LTD	3	5	41	4,273	素材	
WSP GLOBAL INC	1	—	—	—	資本財	
CANOPY GROWTH CORP	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	2	—	—	—	公益事業	
PARKLAND CORP	—	1	3	350	エネルギー	
FIRSTSERVICE CORP	—	0.35	6	712	不動産管理・開発	
NORTHLAND POWER INC	—	2	5	608	公益事業	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	0.5	0.5	5	575	資本財	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	4	8	52	5,390	生活必需品流通・小売り	
小 計	株 数	金 額	96	189	1,231	125,676
銘 柄 数 < 比 率 >	37	36	—	—	< 3.4% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
COMMERZBANK AG	2	7	7	1,109	銀行	
BASF SE	4	—	—	—	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	0.49	1	11	1,670	家庭用品・パーソナル用品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1	3	37	5,653	自動車・自動車部品	
ALLIANZ SE-REG	2	3	83	12,492	保険	
DEUTSCHE POST AG-REG	5	—	—	—	運輸	
SAP SE	5	10	129	19,327	ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	1	1	32	4,808	金融サービス	
ADIDAS AG	1	1	30	4,573	耐久消費財・アパレル	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0.74	—	—	—	保険	
BEIERSDORF AG	0.28	0.74	9	1,404	家庭用品・パーソナル用品	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEIDELBERG MATERIALS AG	1	1	7	1,076		素材
MERCK KGAA	0.66	1	21	3,224		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PUMA SE	0.29	0.88	4	612		耐久消費財・アパレル
LANXESS AG	0.23	—	—	—		素材
GEA GROUP AG	—	1	4	734		資本財
SYMRISE AG	0.72	1	18	2,683		素材
HENKEL AG & CO KGAA	1	1	10	1,607		家庭用品・パーソナル用品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	0.16	0.47	4	685		自動車・自動車部品
BRENTAG SE	1	2	15	2,315		資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	0.35	3	575		ヘルスケア機器・サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	2	2	0.79401	118		電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE	0.32	0.55	2	421		不動産管理・開発
EVONIK INDUSTRIES AG	—	1	3	560		素材
ZALANDO SE	—	3	9	1,416		一般消費財・サービス流通・小売り
MTU AERO ENGINES AG	0.32	0.67	15	2,291		資本財
DELIVERY HERO SE	0.45	1	4	695		消費者サービス
HELLOFRESH SE	0.52	1	3	462		生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	35 24	53 24	473 —	70,523 <1.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	5	—	—	—		保険
INTESA SANPAOLO	89	172	41	6,217		銀行
ENEL SPA	42	79	47	7,110		公益事業
PRYSMIAN SPA	—	1	6	954		資本財
AMPLIFON SPA	0.35	1	3	571		ヘルスケア機器・サービス
NEXI SPA	—	3	2	397		金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	137 4	258 5	102 —	15,250 <0.4%>	
(ユーロ…フランス)						
MICHELIN (CGDE)	0.97	7	21	3,265		自動車・自動車部品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	—	2	243	36,347		耐久消費財・アパレル
AXA SA	10	17	49	7,426		保険
DANONE	3	6	38	5,742		食品・飲料・タバコ
CARREFOUR SA	3	4	8	1,237		生活必需品流通・小売り
VIVENDI SE	1	5	5	827		メディア・娯楽
SOCIETE GENERALE SA	4	6	14	2,200		銀行
AIR LIQUIDE SA	2	5	87	13,012		素材
TOTALENERGIES SE	12	25	140	20,989		エネルギー
L'OREAL	1	2	102	15,328		家庭用品・パーソナル用品
ACCOR SA	0.47	1	4	726		消費者サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2	5	92	13,710		資本財
BNP PARIBAS	5	10	65	9,703		銀行
ESSILORLUXOTTICA	1	2	50	7,516		ヘルスケア機器・サービス
VALEO	0.64	1	3	450		自動車・自動車部品
KERING	0.4	0.74	39	5,900		耐久消費財・アパレル
ORANGE	10	23	26	3,987		電気通信サービス
CNP ASSURANCES	0.48	—	—	—		保険
PUBLICIS GROUPE	1	2	20	3,008		メディア・娯楽
BOUYGUES SA	0.64	1	5	821		資本財
ALSTOM	0.88	2	6	1,017		資本財
WENDEL	0.08	—	—	—		金融サービス
BUREAU VERITAS SA	0.82	2	6	964		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		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EURAZEO SE	0.11	—	—	—	金融サービス	
EIFFAGE	0.24	1	13	2,023	資本財	
BIOMERIEUX	—	0.33	3	497	ヘルスクエア機器・サービス	
SEB SA	0.08	0.08	0.8136	121	耐久消費財・アパレル	
AMUNDI SA	1	—	—	—	金融サービス	
TELEPERFORMANCE	0.34	0.76	12	1,794	商業・専門サービス	
WORLDLINE SA	—	1	6	1,022	金融サービス	
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >					
		70	145	1,071	159,647	
		27	26	—	< 4.4% >	
(ユーロ…オランダ)						
CNH INDUSTRIAL NV	5	12	15	2,372	資本財	
WOLTERS KLUWER	1	2	30	4,504	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE KPN NV	19	27	8	1,313	電気通信サービス	
AKZO NOBEL N.V.	1	2	19	2,883	素材	
AEGON NV	12	—	—	—	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	5	10	32	4,910	生活必需品流通・小売り	
RANDSTAD NV	0.33	0.97	4	694	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE DSM NV	0.95	—	—	—	素材	
ING GROEP NV	20	37	45	6,795	銀行	
ASML HOLDING NV	2	4	261	38,924	半導体・半導体製造装置	
NN GROUP NV	1	1	6	1,031	保険	
IMCD NV	—	0.4	5	829	資本財	
PROSUS NV	4	8	54	8,089	一般消費財・サービス流通・小売り	
JDE PEET'S NV	—	0.78	2	317	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >					
		76	109	487	72,666	
		12	12	—	< 2.0% >	
(ユーロ…スペイン)						
IBERDROLA SA	29	60	70	10,491	公益事業	
REPSOL SA	7	14	18	2,805	エネルギー	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	33	59	38	5,783	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	0.54	1	3	469	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	6	11	34	5,163	一般消費財・サービス流通・小売り	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1	4	6	979	公益事業	
CAIXABANK SA	24	—	—	—	銀行	
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >					
		103	150	172	25,693	
		7	6	—	< 0.7% >	
(ユーロ…ベルギー)						
UCB SA	0.68	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE	1	1	3	580	素材	
COLRUYT SA	0.15	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
D' IETEREN GROUP	—	0.14	2	352	一般消費財・サービス流通・小売り	
KBC GROUP NV	1	3	18	2,802	銀行	
SOLVAY SA	0.21	0.62	6	962	素材	
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >					
		3	5	31	4,698	
		5	4	—	< 0.1% >	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	2	—	—	—	銀行	
VERBUND AG	—	0.61	4	679	公益事業	
OMV AG	0.41	1	4	711	エネルギー	
VOESTALPINE AG	0.32	1	3	492	素材	
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	銘柄 数 < 比 率 >					
		3	2	12	1,883	
		3	3	—	< 0.1% >	

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TENARIS SA	1	3	3	595	エネルギー
小計	株数・金額	1	3	3	595
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
(ユーロ…フィンランド)					
STORA ENSO OYJ-R SHS	3	3	3	589	素材
UPM-KYMMENE OYJ	3	6	18	2,691	素材
KESKO OYJ-B SHS	0.76	2	3	536	生活必需品流通・小売り
SAMPO OYJ-A SHS	—	5	22	3,371	保険
WARTSILA OYJ ABP	1	4	4	666	資本財
ELISA OYJ	0.4	0.95	5	784	電気通信サービス
NESTE OYJ	2	4	16	2,527	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	0.29	0.65	2	398	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	11	26	77	11,566
	銘柄数<比率>	7	8	—	<0.3%>
(ユーロ…アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	0.88	1	14	2,176	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	0.89	1	8	1,193	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	—	1	6	923	素材
CRH PLC	4	8	37	5,632	素材
小計	株数・金額	6	12	66	9,925
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.3%>
(ユーロ…ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS	0.7	2	4	717	生活必需品流通・小売り
GALP ENERGIA SGPS SA	1	3	3	534	エネルギー
小計	株数・金額	2	5	8	1,251
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
(ユーロ…スイス)					
DSM-FIRMENICH AG	—	1	20	3,082	素材
小計	株数・金額	—	1	20	3,082
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.1%>
ユーロ計	株数・金額	450	776	2,528	376,784
	銘柄数<比率>	95	96	—	<10.3%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	392	691	32	5,543	銀行
ASTRAZENECA PLC	7	15	186	31,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEXT PLC	0.89	1	12	2,105	一般消費財・サービス流通・小売り
UNILEVER PLC	13	24	106	18,296	家庭用品・パーソナル用品
TESCO PLC	40	82	22	3,780	生活必需品流通・小売り
RELX PLC	9	18	45	7,892	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3	6	45	7,758	家庭用品・パーソナル用品
PRUDENTIAL PLC	—	27	31	5,465	保険
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	37	68	16	2,751	保険
HSBC HOLDINGS PLC	—	206	125	21,628	銀行
SCHRODERS PLC	0.82	9	4	750	金融サービス
WPP PLC	6	8	7	1,345	メディア・娯楽
BT GROUP PLC	48	50	7	1,246	電気通信サービス
STANDARD CHARTERED PLC	14	—	—	—	銀行
COMPASS GROUP PLC	9	17	38	6,646	消費者サービス
KINGFISHER PLC	5	13	3	552	一般消費財・サービス流通・小売り
PEARSON PLC	—	3	2	510	消費者サービス
GSK PLC	25	38	55	9,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VODAFONE GROUP PLC	146	281	23	4,016	電気通信サービス

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
SAINSBURY (J) PLC	4	13	3	661	生活必需品流通・小売り	
JOHNSON MATTHEY PLC	0.54	1	2	460	素材	
RENTOKIL INITIAL PLC	11	28	18	3,104	商業・専門サービス	
WHITBREAD PLC	1	1	5	982	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	18	34	38	6,558	公益事業	
BUNZL PLC	—	2	7	1,244	資本財	
INTERTEK GROUP PLC	1	1	4	723	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	1	3	8	1,403	耐久消費財・アパレル	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1	2	13	2,292	消費者サービス	
PERSIMMON PLC	—	6	8	1,409	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	0.31	0.86	3	625	耐久消費財・アパレル	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2	21	10	1,821	耐久消費財・アパレル	
TAYLOR WIMPEY PLC	10	26	3	569	耐久消費財・アパレル	
ABRDN PLC	24	24	5	895	金融サービス	
MONDI PLC	3	3	4	723	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	0.99	2	5	907	食品・飲料・タバコ	
ANTOFAGASTA PLC	1	2	3	595	素材	
ST JAMES'S PLACE PLC	2	8	9	1,698	金融サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	0.52	0.52	5	1,003	資本財	
CRODA INTERNATIONAL PLC	0.82	1	7	1,214	素材	
COCA-COLA HBC AG-DI	0.56	1	3	579	食品・飲料・タバコ	
ASHTAD GROUP PLC	2	4	22	3,803	資本財	
OCADO GROUP PLC	1	4	1	276	生活必需品流通・小売り	
DCC PLC	0.27	0.78	3	666	資本財	
INFORMA PLC	9	15	11	1,890	メディア・娯楽	
FERGUSON PLC	1	—	—	—	資本財	
JD SPORTS FASHION PLC	7	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
小計	株数・金額	873	1,778	977	167,841	
	銘柄数<比率>	41	43	—	<4.6%>	
(スイス)				千スイスフラン		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	2	5	80	12,313	耐久消費財・アパレル	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3	6	201	30,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GIVAUDAN-REG	0.05	0.09	27	4,212	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	0.28	0.4	10	1,569	ヘルスケア機器・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.84	—	—	—	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.65	0.84	11	1,812	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	0.39	0.75	43	6,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GEBERIT AG-REG	0.21	0.45	22	3,497	資本財	
SWISS RE AG	1	3	28	4,332	保険	
ADECCO GROUP AG-REG	0.43	1	3	468	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	0.13	—	—	—	電気通信サービス	
ABB LTD-REG	8	15	51	7,852	資本財	
CLARIANT AG-REG	0.6	1	2	372	素材	
SGS SA-REG	0.03	2	18	2,790	商業・専門サービス	
TEMENOS AG - REG	—	0.35	2	411	ソフトウェア・サービス	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0.31	0.4	10	1,591	運輸	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.18	0.4	21	3,284	保険	
SIKA AG-REG	0.73	1	37	5,797	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.01	0.02	22	3,379	食品・飲料・タバコ	
VIFOR PHARMA AG-NEW	0.14	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額	21	40	594	91,187	
	銘柄数<比率>	19	17	—	<2.5%>	

銘柄	株数	当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
ELECTROLUX AB-B	0.63	1	420	420		耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS	15	36	201	2,636		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLAS COPCO AB-B SHS	4	13	180	2,363		資本財
ATLAS COPCO AB-B RDS	1	—	—	—		資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	19	29	458	6,005		資本財
ATLAS COPCO AB- A RDS	2	—	—	—		資本財
SKF AB-B SHARES	1	2	47	623		資本財
ASSA ABLOY AB-B	5	11	277	3,641		資本財
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	4	4	69	910		一般消費財・サービス流通・小売り
SANDVIK AB	6	12	252	3,308		資本財
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	3	5	73	969		素材
HOLMEN AB-B SHARES	—	1	48	637		素材
TELE2 AB-B SHS	1	4	45	601		電気通信サービス
TELIA CO AB	16	16	42	562		電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	0.87	2	79	1,044		資本財
BOLIDEN AB	1	3	129	1,701		素材
BOLIDEN AB RED SHS	—	3	4	55		素材
HUSQVARNA AB-B SHS	1	3	33	438		資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	8	11	128	1,680		資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	3	6	201	2,643		家庭用品・パーソナル用品
EPIROC AB-B	—	6	113	1,487		資本財
EPIROC AB-A	—	5	112	1,473		資本財
NORDEA BANK ABP	17	33	369	4,838		銀行
EQT AB	—	2	62	820		金融サービス
EVOLUTION AB	0.97	—	—	—		消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	115 20	217 22	2,964 —	38,862 <1.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
NORSK HYDRO ASA	3	11	78	996		素材
ORKLA ASA	2	4	35	443		食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	5	9	296	3,752		エネルギー
TELENOR ASA	5	5	61	780		電気通信サービス
MOWI ASA	2	2	51	647		食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	—	1	31	401		保険
AKER BP ASA	0.7	2	57	727		エネルギー
SALMAR ASA	—	0.53	24	315		食品・飲料・タバコ
DNB BANK ASA	6	14	276	3,501		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	25 7	52 9	913 —	11,566 <0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	9	16	1,902	38,061		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	1	1	55	1,101		素材
DEMANT A/S	0.3	0.93	26	521		ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5	10	216	4,333		資本財
GN STORE NORD A/S	0.35	—	—	—		耐久消費財・アパレル
COLOPLAST-B	0.71	1	91	1,826		ヘルスケア機器・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	—	0.04	47	949		運輸
TRYG A/S	1	—	—	—		保険
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	—	0.03	35	702		運輸
PANDORA A/S	0.28	0.61	36	728		耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	0.29	0.78	41	838		素材
GENMAB A/S	0.37	0.7	197	3,952		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	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
ORSTED A/S	1	2	152	3,049		公益事業
AMBU A/S-B	0.47	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	20	34	2,801	56,065	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	11	—	< 1.5% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5	18	63	5,843		エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	14	—	—	—		銀行
QBE INSURANCE GROUP LTD	8	19	27	2,554		保険
LENDLEASE GROUP	1	5	4	388		不動産管理・開発
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	8	17	174	16,035		銀行
BRAMBLES LTD	9	14	20	1,873		商業・専門サービス
TELSTRA CORP LTD	24	—	—	—		電気通信サービス
COMPUTERSHARE LTD	1	4	9	838		商業・専門サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2	8	30	2,826		消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	1	3	66	6,106		金融サービス
ASX LTD	1	2	19	1,762		金融サービス
COCHLEAR LTD	0.4	0.94	23	2,139		ヘルスケア機器・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	2	3	13	1,266		素材
NEWCREST MINING LTD	5	11	32	2,965		素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	6	—	—	—		保険
ORICA LTD	1	3	5	492		素材
SONIC HEALTHCARE LTD	1	3	11	1,045		ヘルスケア機器・サービス
SANTOS LTD	—	38	27	2,529		エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	—	9	12	1,103		保険
TRANSURBAN GROUP	17	34	50	4,604		運輸
BLUESCOPE STEEL LTD	1	3	6	555		素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	9	17	36	3,349		素材
AURIZON HOLDINGS LTD	5	13	4	425		運輸
APA GROUP	8	8	8	759		公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	0.94	1	9	836		ヘルスケア機器・サービス
SEEK LTD	0.93	2	5	474		メディア・娯楽
REA GROUP LTD	0.15	0.4	5	513		メディア・娯楽
EVOLUTION MINING LTD	5	—	—	—		素材
IDP EDUCATION LTD	—	1	4	418		消費者サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3	9	12	1,171		素材
COLES GROUP LTD	7	18	33	3,076		生活必需品流通・小売り
MINERAL RESOURCES LTD	1	1	10	955		素材
XERO LTD	0.37	1	11	1,030		ソフトウェア・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	10	6	630		生活必需品流通・小売り
TELSTRA GROUP LTD	—	47	20	1,903		電気通信サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	30	72	6,644		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	158	365	840	77,120	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	32	—	< 2.1% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD	5	14	7	636		電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3	8	7	657		運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	4	4	11	962		ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	1	—	—	—		ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	3	9	5	434		公益事業
MERCURY NZ LTD	1	1	1	106		公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	19	37	32	2,797	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	< 0.1% >	

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
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	—	5	28	497	不動産管理・開発
MTR CORP	5	10	38	678	運輸
HONG KONG & CHINA GAS	70	170	126	2,227	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	7	—	—	—	金融サービス
HANG SENG BANK LTD	2	5	56	986	銀行
SINO LAND CO	—	20	20	364	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	25	50	121	2,139	銀行
AIA GROUP LTD	—	124	978	17,228	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	4	4	7	140	不動産管理・開発
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	10	30	30	536	電気通信サービス
WH GROUP LTD	—	45	18	332	食品・飲料・タバコ
ESR GROUP LTD	6	—	—	—	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	129 8	463 10	1,427 —	25,132 <0.7%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	20	—	—	—	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	1	4	2	282	不動産管理・開発
DBS GROUP HOLDINGS LTD	9	—	—	—	銀行
KEPPEL CORP LTD	4	11	7	730	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	—	13	36	3,715	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	49	—	—	—	電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	4	10	6	641	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	2	6	5	571	金融サービス
UOL GROUP LTD	1	5	3	345	不動産管理・開発
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7	20	6	709	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	97 9	69 7	68 —	6,997 <0.2%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM	3	—	—	—	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	8	12	35	1,356	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	11 2	12 1	35 —	1,356 <0.0%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,722 545	5,519 549	— —	3,438,136 <94.3%>

(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) 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	0.309	0.678	13	1,858	0.1	
PROLOGIS INC	0.4	0.96	118	16,269	0.4	
WELLTOWER INC	0.224	0.469	35	4,943	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	0.083	0.109	5	736	0.0	
VENTAS INC	—	0.425	19	2,620	0.1	
WEYERHAEUSER CO	0.376	0.8	23	3,260	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	0.247	0.486	92	12,765	0.3	
EQUINIX INC	0.046	0.087	62	8,669	0.2	
CROWN CASTLE INC	0.22	0.417	47	6,494	0.2	
EQUITY RESIDENTIAL	0.184	—	—	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	0.109	25	3,503	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	0.393	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	2	4	443	61,122	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<1.7%>	
(カナダ)			千カナダドル			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.1	0.1	4	496	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.1	0.1	4	496	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
GECINA SA	0.013	0.042	4	607	0.0	
KLEPIERRE	0.057	0.143	2	446	0.0	
COVIVIO	0.014	0.048	2	337	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	0.081	3	530	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.081	—	—	—	—	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	0.165	0.314	12	1,922	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	0.245	0.743	2	454	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.305	1	8	1,403	0.0	
SEGRO PLC	0.681	1	13	2,247	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1	3	23	4,105	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
VICINITY CENTRES	1	2	4	443	0.0	
SCENTRE GROUP	—	3	10	941	0.0	
DEXUS/AU	0.62	0.974	7	724	0.0	
GPT GROUP	0.533	1	5	496	0.0	
MIRVAC GROUP	1	3	7	690	0.0	
STOCKLAND	1	1	8	763	0.0	
GOODMAN GROUP	0.918	1	39	3,580	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	6	15	83	7,640	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	7	—	<0.2%>	

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	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円	%
CDL HOSPITALITY TRUSTS	0.015	—	—	—	—
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	4	4	7	815	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	4	4	7	815
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	14	27	—	76,102
	銘柄 数 < 比 率 >	26	26	—	<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	百万円
			115	—
		EURO ST	13	—

(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

(2023年5月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 3,438,136	% 94.0
投資証券	76,102	2.1
コール・ローン等、その他	144,550	3.9
投資信託財産総額	3,658,788	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (3,645,056千円) の投資信託財産総額 (3,658,788千円) に対する比率は99.6%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=137.72円	1 カナダドル=102.08円	1 ユーロ=149.01円	1 イギリスポンド=171.70円
1 スイスフラン=153.35円	1 スウェーデンクローネ=13.11円	1 ノルウェークローネ=12.66円	1 デンマーククローネ=20.01円
1 オーストラリアドル=91.76円	1 ニュージーランドドル=86.57円	1 香港ドル=17.61円	1 シンガポールドル=102.49円
1 イスラエルシェケル=37.8146円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月22日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	3,661,768,245
コール・ローン等	81,800,865
株式(評価額)	3,438,136,431
投資証券(評価額)	76,102,833
未収入金	7,187,061
未収配当金	4,970,321
差入委託証拠金	53,570,734
(B) 負債	14,139,462
未払金	2,979,646
未払解約金	11,159,798
未払利息	18
(C) 純資産総額(A-B)	3,647,628,783
元本	3,322,771,375
次期繰越損益金	324,857,408
(D) 受益権総口数	3,322,771,375口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,978円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,726,668,481円
 期中追加設定元本額 1,793,857,898円
 期中一部解約元本額 197,755,004円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0978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)

先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,304,674,406円
三菱UFJ D C先進国株式ESGリーダーズインデックスファンド	1,074,395,094円
海外株式セレクション(ラップ向け)	910,544,688円
アドバンスト・バランスII(FOF s用)(適格機関投資家限定)	29,012,538円
アドバンスト・バランスI(FOF s用)(適格機関投資家限定)	4,144,649円
合計	3,322,771,375円

○損益の状況 (2022年5月21日~2023年5月22日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	53,004,529
受取配当金	50,681,884
受取利息	2,334,304
その他収益金	304
支払利息	△ 11,963
(B) 有価証券売買損益	402,010,463
売買益	542,960,517
売買損	△140,950,054
(C) 先物取引等取引損益	19,345,556
取引益	35,461,008
取引損	△ 16,115,452
(D) 保管費用等	△ 6,345,692
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	468,014,856
(F) 前期繰越損益金	△121,036,214
(G) 追加信託差損益金	△ 12,636,764
(H) 解約差損益金	△ 9,484,470
(I) 計(E+F+G+H)	324,857,408
次期繰越損益金(I)	324,857,408

(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】

三菱UFJ国際投信株式会社は、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す。