

ブラックロックESG世界株式ファンド (限定為替ヘッジあり) / (為替ヘッジなし)

第6期 運用報告書(全体版)

(決算日:2021年9月21日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信/海外/株式 |
| 信託期間 | 無期限(設定日:2015年9月30日) |
| 決算日 | 9月20日(ただし休業日の場合は翌営業日) |
| 運用方針 | 各企業のESGに着目しながら、先進国の企業または先進国に主要な業務基盤がある企業の株式ならびに株式関連商品(デリバティブ含む)等に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 |
| 主要運用対象 | <p>「BSF ブラックロック・システマチックESGワールド・エクイティ・ファンド^{*1}」(主要投資対象ファンド)および「ICS ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド^{*2}」を投資対象ファンドとします。</p> <p>*1 正式名称は、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システマチックESGワールド・エクイティ・ファンド クラスI投資証券(円建て円ヘッジまたは円建て)」です。</p> <p>*2 正式名称は、「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド エージェンシークラス投資証券(米ドル建て)」です。</p> |
| 組入制限 | <p>①投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行ないません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> |
| 分配方針 | <p>年1回の毎決算時(原則として9月20日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行ないます。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないこともあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。</p> |

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行ないましたので、

期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますよう

お願い申し上げます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

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

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 投資信託証券 組入比率 | 純資産 |
|----------------|-------------|--------|-----------|----------------|-----------|
| | (分配落) | 税込分配金 | 期中騰落率 | | |
| 2期(2017年9月20日) | 円 12,706 | 円 0 | % 18.0 | % 98.0 | 百万円 41 |
| 3期(2018年9月20日) | 13,914 | 0 | 9.5 | 99.0 | 78 |
| 4期(2019年9月20日) | 13,775 | 0 | △ 1.0 | 98.8 | 78 |
| 5期(2020年9月23日) | 14,801 | 0 | 7.4 | 98.0 | 354 |
| 6期(2021年9月21日) | 19,692 | 0 | 33.0 | 98.9 | 1,013 |

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注3) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定しそれを上回る運用を目指したものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定していません。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | 投資信託証券 組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|----------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2020年9月23日 | 円 14,801 | % - | % 98.0 |
| 9月末 | 15,029 | 1.5 | 97.9 |
| 10月末 | 14,766 | △ 0.2 | 97.3 |
| 11月末 | 16,521 | 11.6 | 97.7 |
| 12月末 | 17,069 | 15.3 | 98.5 |
| 2021年1月末 | 17,216 | 16.3 | 98.8 |
| 2月末 | 17,812 | 20.3 | 98.6 |
| 3月末 | 17,914 | 21.0 | 98.4 |
| 4月末 | 18,905 | 27.7 | 98.7 |
| 5月末 | 19,179 | 29.6 | 97.9 |
| 6月末 | 19,425 | 31.2 | 98.5 |
| 7月末 | 19,815 | 33.9 | 97.9 |
| 8月末 | 20,180 | 36.3 | 97.8 |
| (期末) 2021年9月21日 | 19,692 | 33.0 | 98.9 |

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定しそれを上回る運用を目指したものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定していません。

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 投資信託証券 組入比率 | 純資産 |
|----------------|-------------|--------|-----------|----------------|-----------|
| | (分配落) | 税込分配金 | 期中騰落率 | | |
| 2期(2017年9月20日) | 円 11,964 | 円 0 | % 31.1 | % 98.7 | 百万円 76 |
| 3期(2018年9月20日) | 13,479 | 0 | 12.7 | 97.7 | 93 |
| 4期(2019年9月20日) | 13,255 | 0 | △ 1.7 | 100.4 | 101 |
| 5期(2020年9月23日) | 13,992 | 0 | 5.6 | 98.5 | 1,316 |
| 6期(2021年9月21日) | 19,521 | 0 | 39.5 | 98.0 | 3,604 |

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨て。

(注3) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定しそれを上回る運用を目指したものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定していません。

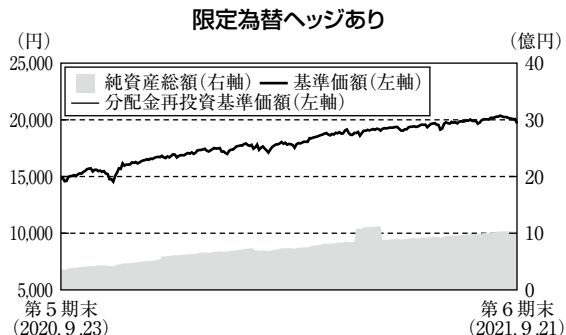
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | 投資信託証券 組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|----------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2020年9月23日 | 円 13,992 | % - | % 98.5 |
| 9月末 | 14,322 | 2.4 | 98.1 |
| 10月末 | 13,920 | △ 0.5 | 98.8 |
| 11月末 | 15,548 | 11.1 | 97.6 |
| 12月末 | 16,005 | 14.4 | 97.9 |
| 2021年1月末 | 16,270 | 16.3 | 96.9 |
| 2月末 | 17,101 | 22.2 | 97.5 |
| 3月末 | 17,869 | 27.7 | 97.6 |
| 4月末 | 18,659 | 33.4 | 98.7 |
| 5月末 | 19,070 | 36.3 | 97.8 |
| 6月末 | 19,418 | 38.8 | 97.6 |
| 7月末 | 19,660 | 40.5 | 98.4 |
| 8月末 | 20,052 | 43.3 | 98.1 |
| (期末) 2021年9月21日 | 19,521 | 39.5 | 98.0 |

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定しそれを上回る運用を目指したものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定していません。

■当期中の基準価額等の推移について(第6期:2020年9月24日~2021年9月21日)



第6期首: 14,801円

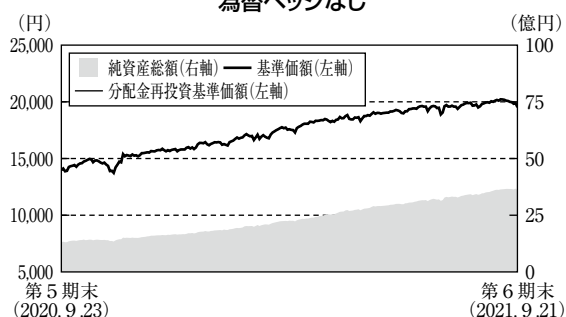
第6期末: 19,692円(既払分配金0円)

騰落率: 33.0%(分配金再投資ベース)

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

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

* 分配金再投資基準価額は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。



第6期首: 13,992円

第6期末: 19,521円(既払分配金0円)

騰落率: 39.5%(分配金再投資ベース)

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

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

* 分配金再投資基準価額は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

<世界株式市場>

当期(2020年9月24日から2021年9月21日まで)、新型コロナウイルス感染動向、米国経済の見通し、そして米国の金融政策などマクロ面の影響が強くなりました。特に2020年11月に、ファイザーによる新型コロナウイルスワクチンの開発が一つの契機となり、新型コロナウイルスの克服とその後の経済回復の期待が強まりました。この期待を裏付けるように各種マクロ統計は堅調な結果を示し、米政権による積極的な財政政策も市場のリスクテイク姿勢を強めました。このように経済回復期待が強まり、経済の回復が統計により裏付けられると、その後はインフレや米国の金融政策の引き締めへの転換への懸念が発生しました。この懸念が市場参加者のリスクテイク姿勢の重しとなるも、FRB(米連邦準備制度理事会)関

係者による「インフレは一時的」とのコメントが信認を得ると、市場動向も落ち着きを取り戻しました。銘柄選択の観点では、期の前半と後半で変化が発生しました。前半は、新型コロナウイルス感染拡大にともなう景気減速懸念から、コロナ禍でも業績確信度の高い銘柄が好まれる環境でした。しかし、徐々に新型コロナウイルスワクチンの普及や経済回復への期待が強まってくると、後半は、今後の経済回復から恩恵を受けると考えられるコロナ禍で株価が出遅れていた景気敏感業種が市場を牽引する環境へと変化しました。米国金利の上昇見通しも、出遅れて割安となっていた銘柄が好まれる要因となりました。

<米国債券市場>

米国の短期債利回りは、FRBによる金融緩和と政策が継続されるなか、低位なレンジで推移しました。

ポートフォリオについて

<ブラックロックESG世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)>

期を通じて、主要投資対象ファンドである「BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ)」を高位に、「ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド」を低位に組み入れた運用を行ないました。

また、主要投資対象ファンドにおいて、当該ファンドの純資産額を米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図りました。

<ブラックロックESG世界株式ファンド(為替ヘッジなし)>

期を通じて、主要投資対象ファンドである「BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て)」を高位に、「ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド」を低位に組み入れた運用を行ないました。

<BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド>

当期、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(企業統治)の3つの切り口による分析をもとに、優れた経営をしている企業に着眼しつつ、投資収益を追求する運用を行ないました。

これら優れた経営をしている企業に着目した上記の指標は全体としてプラス寄与となりました。3つの切り口による個別の指標では、「Environment(環境)」指標が最も大きなプラス寄与となりました。特に地球温暖化ガスの排出量の推移に着目した投資アイデアがリターンを牽引しました。

上記以外の指標では、ファンダメンタルズ指標、センチメント指標ともにプラス寄与となりました。

<ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド>

主に、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引に投資することで、流動性と元本の安定性を確保しつつ、安定的なインカム水準を追求した運用を行ないました。

基準価額の主な変動要因

<ブラックロックESG世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)>

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+33.0%となりました。

当期、「BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ)」が上昇したことが、当ファンドの上昇要因となりました。

■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|--|-------|
| BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ) | 34.6% |

<ブラックロックESG世界株式ファンド(為替ヘッジなし)>

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+39.5%となりました。

当期、「BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て)」が上昇したことが、当ファンドの上昇要因となりました。

■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|--|-------|
| BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て) | 41.3% |

ベンチマークとの差異について

当ファンドは、特定のベンチマークを設定しそれを上回る運用を目指したものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定しておりません。また、参考指数についても設定しておりません。

分配金について

<ブラックロックESG世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)>

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

■分配原資の内訳(1万口当り)

| 項目 | 当期 2020年9月24日 ～2021年9月21日 |
|------------|---------------------------------|
| 当期分配金(税込み) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 9,691 |

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

<ブラックロックESG世界株式ファンド(為替ヘッジなし)>

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

■分配原資の内訳(1万口当り)

| 項目 | 当期 2020年9月24日 ～2021年9月21日 |
|------------|---------------------------------|
| 当期分配金(税込み) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 9,520 |

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針について

<ブラックロックESG世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)>

引き続き、当ファンドでは主要投資対象ファンドである「BSF ブラックロック・システマチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ)」を高位に組入れた運用を行なう方針です。また、主要投資対象ファンドにおいて、当該ファンドの純資産額を米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。

<ブラックロックESG世界株式ファンド(為替ヘッジなし)>

引き続き、当ファンドでは主要投資対象ファンドである「BSF ブラックロック・システマチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て)」を高位に組入れた運用を行なう方針です。

<BSF ブラックロック・システムチックESG ワールド・エクイティ・ファンド>

当ファンドでは、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(企業統治)の3つの切り口による分析をもとに、優れた経営をしている企業に着眼しつつ、投資収益を追求する運用を行なう方針です。疾病研究に取り組んでいる企業、従業員満足度の底上げを通じた企業統治の向上を図っている企業、そして環境技術の開発を通じて環境保全への取組みを行なっている企業など社会にプラスの影響を与えることを目指す企業への投資比率を比較的高位に保つ方針です。一方、訴訟や社会的・道徳的等問題を抱えているような企業への投資比率を比較的低位に保つ方針です。

<ICS ブラックロック・ICS・USTレジャー リー・ファンド>

主に、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引に投資することで、流動性と元本の安定性を確保しつつ、安定的なインカム水準を追求した運用を行なう方針です。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|--------------|-----------------------|------------|---|
| | (2020.9.24~2021.9.21) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 円 64 | % 0.359 | 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 期中の平均基準価額は17,952円です。 |
| (投信会社) | (2) | (0.011) | 投信会社分は、委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (59) | (0.328) | 販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託銀行) | (4) | (0.020) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | - | - | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 21 | 0.116 | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数 |
| (印刷費用・監査費用等) | (20) | (0.112) | 目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用 |
| (その他) | (1) | (0.004) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 85 | 0.475 | |

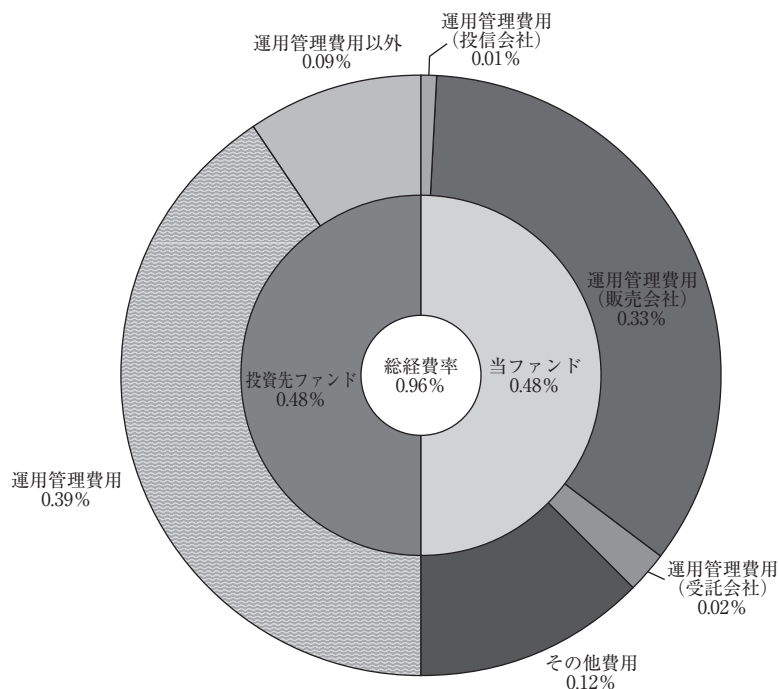
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.96%です。

| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 0.96% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.48% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.39% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.09% |

(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) 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7) 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異なります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2020年9月24日から2021年9月21日まで)
投資信託証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|---|---|---------------|-------------|---------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 | B S F ブラックロック・システムチックESGワールド・ エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ)(ルクセンブルグ) | 千口 40 | 千円 743,356 | 千口 14 | 千円 277,241 |
| | 国 | I C S ブラックロック・I C S・U S トレジャ リー・ファンド(アイルランド) | 千口 0.69477 | 千米・ドル 73 | 千口 0.17907 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2020年9月24日から2021年9月21日まで)
投資信託証券

| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|-------|--|----------|---------------|-------|--|----------|---------------|
| 銘 | 柄 | 口 数 | 金 額 | 銘 | 柄 | 口 数 | 金 額 |
| B S F | ブラックロック・システムチックESG ワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ) | 千口 40 | 千円 743,356 | B S F | ブラックロック・システムチックESG ワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ) | 千口 14 | 千円 277,241 |
| I C S | ブラックロック・I C S・U S トレジャリー・ファンド | 0.69477 | 7.915 | I C S | ブラックロック・I C S・U S トレジャリー・ファンド | 0.17907 | 2,101 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | |
|--|----------|------------|-----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| B S F ブラックロック・システマチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て円ヘッジ) | 千口 48 | 百万円 992 | % 97.9 |
| 合 計 | 48 | 992 | 97.9 |

(注1) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | | 比 率 |
|----------------------------------|---------------|-------------|----------|----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| I C S ブラックロック・ICS・US トレジャリー・ファンド | 千口 0.82796 | 千米・ドル 87 | 百万円 9 | % 0.9 |
| 合 計 | 0.82796 | 87 | 9 | 0.9 |

(注1) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|--------------|-----------------------|------------|---|
| | (2020.9.24~2021.9.21) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 円 63 | % 0.359 | 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 期中の平均基準価額は17,460円です。 |
| (投信会社) | (2) | (0.011) | 投信会社分は、委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (57) | (0.328) | 販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託銀行) | (3) | (0.020) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | - | - | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | - | - | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 14 | 0.081 | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数 |
| (印刷費用・監査費用等) | (14) | (0.078) | 目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用 |
| (その他) | (1) | (0.003) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 77 | 0.440 | |

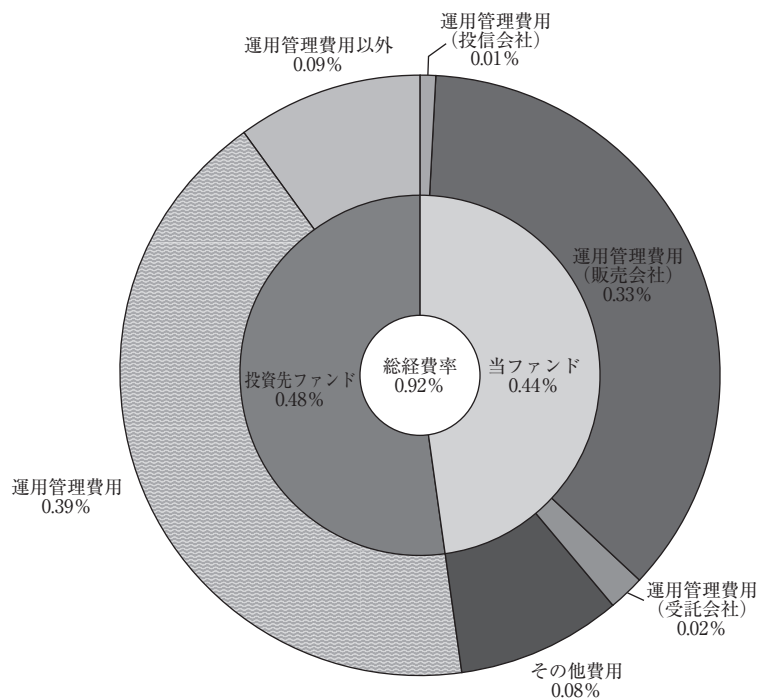
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.92%です。

| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 0.92% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.44% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.39% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.09% |

(注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) 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7) 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異なります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2020年9月24日から2021年9月21日まで)
投資信託証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---|----------|-----------------|---------|--------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | B S F ブラックロック・システムチックE S Gワ ールド・エクイティ・ファンド(円建て)(ルクセンブルグ) | 千口 85 | 千円 1,568,221 | 千口 1 | 千円 19,842 |
| | I C S ブラックロック・I C S・U S トレジャ リー・ファンド(アイルランド) | 千口 1 | 千米・ドル 191 | 千口 - | 千米・ドル - |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2020年9月24日から2021年9月21日まで)
投資信託証券

| 買 付 | | 売 付 | | | |
|---|----------|-----------------|---|---------|--------------|
| 銘 柄 | 口 数 | 金 額 | 銘 柄 | 口 数 | 金 額 |
| B S F ブラックロック・システムチックE S Gワールド・エクイティ・ファンド(円建て) | 千口 85 | 千円 1,568,221 | B S F ブラックロック・システムチックE S Gワールド・エクイティ・ファンド(円建て) | 千口 1 | 千円 19,842 |
| I C S ブラックロック・I C S・U S トレジャリー・ファンド | 1 | 20,724 | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | |
|--|-----------|--------------|-----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| B S F ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド(円建て) | 千口 174 | 百万円 3,498 | % 97.1 |
| 合 計 | 174 | 3,498 | 97.1 |

(注1) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------------|---------|--------------|-----------|----------|
| | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| I C S ブラックロック・ICS・US トレジャリー・ファンド | 千口 2 | 千米・ドル 318 | 百万円 34 | % 1.0 |
| 合 計 | 2 | 318 | 34 | 1.0 |

(注1) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 1,002,401 | % 97.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 28,235 | 2.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,030,636 | 100.0 |

(注1) 当期末における外貨建資産(9,626千円)の投資信託財産総額(1,030,636千円)に対する比率は、0.9%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=109.57円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,030,636,542円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 28,235,447 |
| 投 資 証 券(評価額) | 1,002,401,095 |
| (B) 負 債 | 16,675,103 |
| 未 払 金 | 10,701,332 |
| 未 払 解 約 金 | 3,805,487 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,661,698 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 506,586 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,013,961,439 |
| 元 本 | 514,910,510 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 499,050,929 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 514,910,510口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 19,692円 |

<注記事項>

| | |
|-----------|--------------|
| 期首元本額 | 239,217,248円 |
| 期中追加設定元本額 | 526,468,711円 |
| 期中一部解約元本額 | 250,775,449円 |

■損益の状況

自2020年9月24日 至2021年9月21日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 129,918,689円 |
| 売 買 益 | 174,118,710 |
| 売 買 損 | △ 44,200,021 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 3,535,055 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 126,383,634 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 12,901,823 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 359,765,472 |
| (配 当 等 相 当 額) | (152,975,207) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (206,790,265) |
| (F) 合 計(C+D+E) | 499,050,929 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | 499,050,929 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 359,765,472 |
| (配 当 等 相 当 額) | (152,975,207) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (206,790,265) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 139,285,457 |

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第6期計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(126,383,634円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(206,790,265円)、収益調整金(その他収益調整金)(152,975,207円)、分配準備積立金(12,901,823円)により、分配対象収益は499,050,929円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 3,533,775 | % 97.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 84,547 | 2.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 3,618,323 | 100.0 |

(注1) 当期末における外貨建資産(34,875千円)の投資信託財産総額(3,618,323千円)に対する比率は、1.0%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=109.57円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 3,618,323,921円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 84,547,930 |
| 投 資 証 券(評価額) | 3,533,775,991 |
| (B) 負 債 | 13,523,579 |
| 未 払 解 約 金 | 7,251,698 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 5,396,582 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 875,299 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 3,604,800,342 |
| 元 本 | 1,846,655,404 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 1,758,144,938 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,846,655,404口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 19,521円 |

<注記事項>

| | |
|-----------|----------------|
| 期首元本額 | 941,278,167円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,375,410,239円 |
| 期中一部解約元本額 | 470,033,002円 |

■損益の状況

自2020年9月24日 至2021年9月21日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 545,518,387円 |
| 売 買 益 | 667,063,771 |
| 売 買 損 | △ 121,545,384 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 10,279,967 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 535,238,420 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 9,552,478 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,213,354,040 |
| (配 当 等 相 当 額) | (533,403,361) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (679,950,679) |
| (F) 合 計(C+D+E) | 1,758,144,938 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | 1,758,144,938 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,213,354,040 |
| (配 当 等 相 当 額) | (533,403,361) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (679,950,679) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 544,790,898 |

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第6期計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(535,238,420円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(679,950,679円)、収益調整金(その他収益調整金)(533,403,361円)、分配準備積立金(9,552,478円)により、分配対象収益は1,758,144,938円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

<参考情報>

ブラックロック・ストラテジック・ファンズ
 ブラックロック・システムチック E S G ワールド・エクイティ・ファンドの運用状況について
 (計算期間:2020年6月1日~2021年5月31日)

ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムチック E S G ワールド・エクイティ・ファンド(以下 B S F ブラックロック・システムチック E S G ワールド・エクイティ・ファンド)はブラックロック E S G 世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)／(為替ヘッジなし)が投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年5月末日)です。

よって、入手可能な直前の計算期間(決算)である2021年5月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

| B S F ブラックロック・システムチック E S G ワールド・エクイティ・ファンド | |
|---|--|
| 形態 | (限定為替ヘッジあり) ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て円ヘッジ) (為替ヘッジなし) ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て) |
| 投資目的および投資態度 | 各企業の E S G に着目しながら株式へ投資します。 当ファンドは、純資産総額の80%以上を、先進国の企業または先進国に主要な業務基盤がある企業が発行する株式ならびに株式関連商品(デリバティブ含む)に投資します。 投資目的ならびに投資方針を達成するため、ファンドは、ブラックロックが独自に開発した E S G 分析や定量モデル分析を含む様々な投資戦略を活用します。 なお、ポートフォリオ構築にあたっては、E S G に加え投資リスクや取引コスト等も考慮します。 |
| 設定日 | 2015年8月20日 |
| 存続期間 | 無期限 |
| 主な投資対象 | 世界の株式ならびに株式関連商品(デリバティブ含む)を投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。 |
| 管理報酬 | 年0.40% |
| その他費用 | 管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。 |
| 決算日 | 年1回(原則として5月末日)に決算を行いません。 |
| 収益分配方針 | 原則として、分配を行いません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 管理会社 | ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー |
| 投資顧問会社 | ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー |
| 保管会社 | ステート・ストリート・バンク・インターナショナル G m b H、ルクセンブルグ支店 |

損益および純資産変動計算書 2020年6月1日から2021年5月31日までの期間

BSF ブラックロック・
システマチックESGワールド・
エクイティ・ファンド

米ドル

| | |
|-------------------------|--------------------|
| 期首純資産 | 220,697,286 |
| 収益 | |
| 預金利息 | 9 |
| 配当金、源泉徴収税控除後 | 4,202,656 |
| 有価証券貸付 | 52,531 |
| 収益合計 | 4,255,196 |
| 費用 | |
| 銀行利息 | 3,032 |
| 年間サービス費用 | 196,658 |
| 預託報酬 | 82,379 |
| 税金 | 56,871 |
| 販売報酬 | 74,894 |
| ローン・コミットメント・フィー | 355 |
| 投資運用報酬および投資運用再委託報酬 | 407,630 |
| その他の費用 | 449 |
| 費用合計 | 822,268 |
| 投資純利益 | 3,432,928 |
| 以下に係る実現純利益／(損失): | |
| 投資有価証券 | 54,591,682 |
| 先物取引 | 1,015,185 |
| 外国通貨および先渡為替予約 | 4,230,312 |
| 当期実現純利益 | 59,837,179 |
| 以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額: | |
| 投資有価証券 | 33,647,803 |
| 先物取引 | (136,840) |
| 外国通貨および先渡為替予約 | (37,944) |
| 当期未実現評価益／(損)の純変動 | 33,473,019 |
| 運用成績による純資産の増加 | 96,743,126 |
| 資本の変動 | |
| 投資証券発行による正味受取額 | 101,287,922 |
| 投資証券買戻しによる正味支払額 | (60,389,663) |
| 資本の変動による純資産の増加 | 40,898,259 |
| 期末純資産 | 358,338,671 |

BSF ブラックロック・システムチックESGワールド・エクイティ・ファンド

投資有価証券明細表 2021年5月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|----------------|--------------------------------|-------------|--------------|
| 普通株式 | | | |
| オーストラリア | | | |
| 20,647 | Alumina Ltd^ | 27,405 | 0.01 |
| 9,516 | APA Group (Unit) | 67,978 | 0.02 |
| 14,070 | Aristocrat Leisure Ltd | 447,013 | 0.12 |
| 8,641 | ASX Ltd | 510,004 | 0.14 |
| 4,941 | BlueScope Steel Ltd | 81,185 | 0.02 |
| 2,821 | Cochlear Ltd^ | 495,699 | 0.14 |
| 7,934 | Commonwealth Bank of Australia | 612,333 | 0.17 |
| 1,938 | CSL Ltd | 435,290 | 0.12 |
| 3,544 | Fortescue Metals Group Ltd | 61,523 | 0.02 |
| 6,696 | Goodman Group (REIT) | 100,693 | 0.03 |
| 1,983 | IDP Education Ltd | 34,532 | 0.01 |
| 3,205 | Medibank Pvt Ltd | 7,764 | 0.00 |
| 3,029 | Mineral Resources Ltd | 106,384 | 0.03 |
| 197,495 | Mirvac Group (REIT) | 426,455 | 0.12 |
| 10,371 | Northern Star Resources Ltd | 93,912 | 0.03 |
| 6,246 | REA Group Ltd | 791,148 | 0.22 |
| 8,590 | Rio Tinto Ltd | 822,586 | 0.23 |
| 1,396 | SEEK Ltd | 33,018 | 0.01 |
| 273,689 | Stockland (REIT) | 989,207 | 0.28 |
| 40,662 | Tabcorp Holdings Ltd | 160,814 | 0.04 |
| 39,132 | Westpac Banking Corp | 800,162 | 0.22 |
| 3,574 | Worley Ltd | 29,210 | 0.01 |
| | | 7,134,315 | 1.99 |
| オーストリア | | | |
| 1,778 | ANDRITZ AG | 103,199 | 0.03 |
| | | 103,199 | 0.03 |
| ベルギー | | | |
| 32,660 | Anheuser-Busch InBev SA | 2,463,640 | 0.69 |
| 4,047 | Umicore SA | 242,849 | 0.07 |
| | | 2,706,489 | 0.76 |
| バミューダ | | | |
| 692 | Athene Holding Ltd 'A' | 43,340 | 0.01 |
| 20,476 | Invesco Ltd | 584,180 | 0.16 |
| 28,000 | Shangri-La Asia Ltd | 26,120 | 0.01 |
| | | 653,640 | 0.18 |
| カナダ | | | |
| 34,896 | ARC Resources Ltd | 271,219 | 0.08 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|----------------|-------------------------------------|-------------|--------------|
| カナダ(続き) | | | |
| 9,239 | Bank of Montreal | 971,733 | 0.27 |
| 1,931 | Bank of Nova Scotia | 130,390 | 0.04 |
| 2,021 | Canadian Western Bank | 62,530 | 0.02 |
| 1,000 | CGI Inc | 89,492 | 0.02 |
| 450 | Colliers International Group Inc | 50,030 | 0.01 |
| 3,043 | First Quantum Minerals Ltd | 75,058 | 0.02 |
| 365 | FirstService Corp | 59,205 | 0.02 |
| 44,001 | Hydro One Ltd | 1,121,012 | 0.31 |
| 364 | Intact Financial Corp | 49,628 | 0.01 |
| 1,258 | National Bank of Canada | 98,170 | 0.03 |
| 16,455 | Rogers Communications Inc 'B' | 852,612 | 0.24 |
| 7,566 | Royal Bank of Canada | 786,002 | 0.22 |
| 1,423 | Shopify Inc 'A'^ | 1,764,219 | 0.49 |
| 13,298 | Sun Life Financial Inc^ | 718,201 | 0.20 |
| 324 | TMX Group Ltd | 35,880 | 0.01 |
| 28,060 | Toronto-Dominion Bank | 2,022,717 | 0.56 |
| 351 | West Fraser Timber Co Ltd | 27,310 | 0.01 |
| 34,335 | Wheaton Precious Metals Corp | 1,644,067 | 0.46 |
| | | 10,829,475 | 3.02 |
| ケイマン諸島 | | | |
| 3,852 | Herbalife Nutrition Ltd | 202,500 | 0.06 |
| 10,000 | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | 58,626 | 0.01 |
| | | 261,126 | 0.07 |
| デンマーク | | | |
| 219 | AP Moller - Maersk A/S 'A' | 577,550 | 0.16 |
| 357 | AP Moller - Maersk A/S 'B' | 984,547 | 0.28 |
| 1,616 | Coloplast A/S 'B' | 255,227 | 0.07 |
| 38,422 | Novo Nordisk A/S 'B' | 3,039,181 | 0.85 |
| 1,516 | Orsted A/S | 228,486 | 0.06 |
| 57 | ROCKWOOL International A/S 'B' | 28,437 | 0.01 |
| | | 5,113,428 | 1.43 |
| フィンランド | | | |
| 2,493 | Neste Oyj^ | 163,623 | 0.05 |
| 82,185 | Nordea Bank Abp | 886,180 | 0.25 |
| 9,004 | UPM-Kymmene Oyj | 343,171 | 0.10 |
| 3,743 | Valmet Oyj^ | 161,797 | 0.04 |
| 994 | Wartsila Oyj Abp | 13,623 | 0.00 |
| | | 1,568,394 | 0.44 |
| フランス | | | |
| 2,971 | Air Liquide SA | 505,946 | 0.14 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|------------------------------|-------------------|--------------|
| | フランス(続き) | | |
| 1,549 | Alstom SA | 86,977 | 0.02 |
| 7,585 | Amundi SA | 675,742 | 0.19 |
| 89,256 | AXA SA | 2,468,310 | 0.69 |
| 10,756 | BNP Paribas SA | 736,535 | 0.21 |
| 2,081 | Casino Guichard Perrachon SA | 67,072 | 0.02 |
| 2,949 | Cie de Saint-Gobain | 198,159 | 0.05 |
| 3,799 | CNP Assurances | 68,872 | 0.02 |
| 21,304 | Constellium SE | 380,490 | 0.11 |
| 3,614 | Electricite de France SA | 50,302 | 0.01 |
| 10,659 | Engie SA | 158,753 | 0.04 |
| 687 | Faurecia SE | 37,318 | 0.01 |
| 991 | Imerys SA | 51,957 | 0.01 |
| 773 | Kering SA | 707,150 | 0.20 |
| 2,445 | Legrand SA | 257,091 | 0.07 |
| 6,449 | L'Oreal SA | 2,904,164 | 0.81 |
| 6,660 | Pernod Ricard SA | 1,469,925 | 0.41 |
| 1,133 | Renault SA | 47,088 | 0.01 |
| 9,362 | Rexel SA | 191,033 | 0.05 |
| 9,340 | Rubis SCA | 451,382 | 0.13 |
| 8,541 | Schneider Electric SE | 1,353,588 | 0.38 |
| 9,432 | Valeo SA | 308,720 | 0.09 |
| 3,028 | Vinci SA | 344,446 | 0.10 |
| | | 13,521,020 | 3.77 |
| | ドイツ | | |
| 3,332 | adidas AG | 1,221,132 | 0.34 |
| 1,505 | Allianz SE Reg | 396,269 | 0.11 |
| 5,317 | BASF SE | 434,105 | 0.12 |
| 3,118 | Bayerische Motoren Werke AG | 331,243 | 0.09 |
| 2,448 | Beiersdorf AG | 289,433 | 0.08 |
| 1,067 | Covestro AG | 75,109 | 0.02 |
| 9,751 | Daimler AG | 911,907 | 0.25 |
| 9,771 | Deutsche Post AG Reg | 664,912 | 0.19 |
| 13,012 | E.ON SE | 157,052 | 0.04 |
| 819 | HelloFresh SE | 74,603 | 0.02 |
| 7,561 | Infineon Technologies AG | 308,289 | 0.09 |
| 431 | Knorr-Bremse AG | 53,625 | 0.02 |
| 1,892 | Rheinmetall AG | 196,588 | 0.06 |
| 126 | SAP SE | 17,521 | 0.01 |
| 11,537 | Siemens AG Reg | 1,869,793 | 0.52 |
| 2,323 | Siemens Energy AG | 73,625 | 0.02 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|------------------------------------|-------------|--------------|
| | ドイツ(続き) | | |
| 5,414 | Zalando SE | 576,813 | 0.16 |
| | | 7,652,019 | 2.14 |
| | 香港 | | |
| 67,600 | AIA Group Ltd | 864,048 | 0.24 |
| 295,000 | BOC Hong Kong Holdings Ltd^ | 1,066,189 | 0.30 |
| 220,500 | MTR Corp Ltd | 1,227,360 | 0.34 |
| 222,800 | Swire Properties Ltd | 655,965 | 0.19 |
| 10,000 | Vitasoy International Holdings Ltd | 39,106 | 0.01 |
| | | 3,852,668 | 1.08 |
| | アイルランド | | |
| 10,870 | Accenture Plc 'A' | 3,067,079 | 0.85 |
| 5,692 | Allegion Plc | 799,612 | 0.22 |
| 1,294 | Flutter Entertainment Plc | 243,196 | 0.07 |
| 2,265 | Kingspan Group Plc | 212,844 | 0.06 |
| 500 | Linde Plc | 150,300 | 0.04 |
| 244 | Medtronic Plc | 30,888 | 0.01 |
| 14,583 | Perrigo Co Plc | 672,860 | 0.19 |
| 4,767 | Trane Technologies Plc | 888,569 | 0.25 |
| | | 6,065,348 | 1.69 |
| | イスラエル | | |
| 139,057 | Bank Hapoalim BM | 1,182,343 | 0.33 |
| 24,925 | Israel Discount Bank Ltd 'A' | 124,040 | 0.04 |
| 390 | Nice Ltd | 85,488 | 0.02 |
| 1,003 | Teva Pharmaceutical Industries Ltd | 10,629 | 0.00 |
| | | 1,402,500 | 0.39 |
| | イタリア | | |
| 52,111 | Enel SpA | 514,176 | 0.14 |
| 181,143 | Intesa Sanpaolo SpA | 535,867 | 0.15 |
| 18 | Italgas SpA | 119 | 0.00 |
| 42,861 | Pirelli & C SpA | 254,476 | 0.07 |
| 1,409 | Prysmian SpA | 48,818 | 0.02 |
| | | 1,353,456 | 0.38 |
| | 日本 | | |
| 3,600 | Aeon Co Ltd^ | 96,271 | 0.03 |
| 29,300 | Alps Alpine Co Ltd | 314,539 | 0.09 |
| 82,300 | Asahi Kasei Corp | 904,519 | 0.25 |
| 25,900 | Astellas Pharma Inc | 424,619 | 0.12 |
| 7,500 | Azbil Corp^ | 299,959 | 0.08 |
| 4,200 | Benesse Holdings Inc^ | 96,304 | 0.03 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|------------------------------------|-------------|--------------|
| | 日本(続き) | | |
| 3,600 | Bridgestone Corp | 157,804 | 0.04 |
| 14,800 | Dai Nippon Printing Co Ltd | 318,435 | 0.09 |
| 5,100 | Daikin Industries Ltd | 1,004,975 | 0.28 |
| 3,600 | Denso Corp | 246,359 | 0.07 |
| 1,200 | Dowa Holdings Co Ltd | 49,635 | 0.01 |
| 1,300 | Ebara Corp | 64,028 | 0.02 |
| 50,000 | ENEOS Holdings Inc | 206,357 | 0.06 |
| 1,400 | FANUC Corp | 335,826 | 0.09 |
| 1,100 | Fast Retailing Co Ltd | 894,628 | 0.25 |
| 4,400 | Hitachi Transport System Ltd | 140,058 | 0.04 |
| 7,800 | Honda Motor Co Ltd | 238,539 | 0.07 |
| 123,100 | Inpex Corp^ | 845,442 | 0.24 |
| 6,000 | Japan Post Holdings Co Ltd | 49,843 | 0.01 |
| 9,700 | Kansai Paint Co Ltd | 261,433 | 0.07 |
| 57,000 | KDDI Corp | 1,932,406 | 0.54 |
| 1,500 | Keyence Corp | 737,003 | 0.21 |
| 13,800 | Komatsu Ltd | 403,150 | 0.11 |
| 800 | Kyowa Exeo Corp | 19,628 | 0.01 |
| 1,400 | Lintec Corp | 30,876 | 0.01 |
| 11,500 | Mitsubishi Chemical Holdings Corp | 91,841 | 0.03 |
| 5,800 | Mitsubishi Corp | 157,855 | 0.04 |
| 38,300 | Mitsubishi Materials Corp | 810,434 | 0.23 |
| 1,900 | Mitsui Mining & Smelting Co Ltd | 56,061 | 0.02 |
| 10,600 | MS&AD Insurance Group Holdings Inc | 323,201 | 0.09 |
| 2,000 | Nidec Corp | 228,566 | 0.06 |
| 5,000 | Nikon Corp | 51,168 | 0.01 |
| 1,000 | Nintendo Co Ltd | 617,475 | 0.17 |
| 8,100 | Nippon Paint Holdings Co Ltd^ | 117,023 | 0.03 |
| 3,300 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 88,234 | 0.02 |
| 800 | Nippon Yusen KK | 32,944 | 0.01 |
| 5,300 | Nitto Denko Corp | 410,407 | 0.11 |
| 3,600 | NOK Corp | 44,163 | 0.01 |
| 45,900 | Nomura Holdings Inc | 251,604 | 0.07 |
| 7,000 | Nomura Research Institute Ltd | 222,820 | 0.06 |
| 12,000 | Omron Corp | 943,451 | 0.26 |
| 29,900 | Panasonic Corp | 340,070 | 0.09 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|-------------------------------------|-------------|--------------|
| | 日本(続き) | | |
| 1,200 | Persol Holdings Co Ltd | 22,711 | 0.01 |
| 23,800 | Recruit Holdings Co Ltd | 1,205,846 | 0.34 |
| 900 | Secom Co Ltd | 70,348 | 0.02 |
| 12,100 | Sekisui House Ltd | 251,403 | 0.07 |
| 15,700 | SoftBank Corp | 201,405 | 0.06 |
| 8,700 | SoftBank Group Corp^ | 655,119 | 0.18 |
| 1,300 | Sohgo Security Services Co Ltd | 59,404 | 0.02 |
| 6,900 | Sompo Holdings Inc^ | 277,158 | 0.08 |
| 1,900 | Sony Corp | 186,898 | 0.05 |
| 3,500 | Stanley Electric Co Ltd | 104,068 | 0.03 |
| 335,000 | Sumitomo Chemical Co Ltd | 1,833,273 | 0.51 |
| 5,200 | Sumitomo Metal Mining Co Ltd | 232,776 | 0.07 |
| 44,600 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 1,607,211 | 0.45 |
| 11,300 | Sumitomo Rubber Industries Ltd | 145,940 | 0.04 |
| 2,300 | Sysmex Corp | 234,112 | 0.07 |
| 700 | Taisei Corp | 24,389 | 0.01 |
| 37,800 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd^ | 1,282,180 | 0.36 |
| 9,100 | Teijin Ltd | 146,659 | 0.04 |
| 3,200 | Tokio Marine Holdings Inc | 151,157 | 0.04 |
| 2,300 | Tokyo Electron Ltd | 1,020,777 | 0.28 |
| 5,300 | Tokyo Gas Co Ltd | 104,729 | 0.03 |
| 67,000 | Toray Industries Inc^ | 434,241 | 0.12 |
| 4,400 | Toyota Motor Corp^ | 365,797 | 0.10 |
| 700 | Yaskawa Electric Corp^ | 33,902 | 0.01 |
| 7,000 | Z Holdings Corp | 32,855 | 0.01 |
| | | 25,544,311 | 7.13 |
| | ジャージー | | |
| 1,415 | Aptiv Plc | 212,844 | 0.06 |
| 5,656 | Ferguson Plc | 768,115 | 0.21 |
| 128,455 | Glencore Plc | 585,106 | 0.16 |
| 19,094 | Janus Henderson Group Plc^ | 735,310 | 0.21 |
| | | 2,301,375 | 0.64 |
| | オランダ | | |
| 7,754 | Akzo Nobel NV | 997,399 | 0.28 |
| 2,744 | ASML Holding NV | 1,845,512 | 0.52 |
| 5,949 | Heineken NV | 711,496 | 0.20 |
| 2,970 | JDE Peet's NV | 118,488 | 0.03 |
| 18,420 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 532,883 | 0.15 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|-------------------------------------|-------------|--------------|
| | オランダ(続き) | | |
| 17,493 | NN Group NV | 886,389 | 0.25 |
| 7,464 | PostNL NV | 43,842 | 0.01 |
| 5,966 | Randstad NV | 466,998 | 0.13 |
| 5,886 | Stellantis NV | 117,461 | 0.03 |
| 3,697 | STMicroelectronics NV [^] | 138,851 | 0.04 |
| | | 5,859,319 | 1.64 |
| | ニュージーランド | | |
| 51,462 | Air New Zealand Ltd | 62,467 | 0.02 |
| 11,035 | Contact Energy Ltd | 63,204 | 0.02 |
| 23,671 | Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 512,545 | 0.14 |
| 64,253 | Mercury NZ Ltd | 306,133 | 0.09 |
| 42,534 | Meridian Energy Ltd | 161,690 | 0.04 |
| 2,103 | Xero Ltd | 215,903 | 0.06 |
| | | 1,321,942 | 0.37 |
| | ノルウェー | | |
| 104,260 | Equinor ASA | 2,263,002 | 0.63 |
| 11,326 | Norsk Hydro ASA | 74,263 | 0.02 |
| | | 2,337,265 | 0.65 |
| | ポルトガル | | |
| 20,573 | Galp Energia SGPS SA | 255,718 | 0.07 |
| | | 255,718 | 0.07 |
| | シンガポール | | |
| 10,400 | DBS Group Holdings Ltd | 236,287 | 0.07 |
| 37,508 | Flex Ltd | 685,271 | 0.19 |
| 149,400 | Keppel Corp Ltd | 602,461 | 0.17 |
| 9,000 | Oversea-Chinese Banking Corp Ltd | 84,161 | 0.02 |
| 202,700 | Singapore Telecommunications Ltd | 369,591 | 0.10 |
| | | 1,977,771 | 0.55 |
| | スペイン | | |
| 207 | Acciona SA | 34,912 | 0.01 |
| 104,108 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 654,452 | 0.18 |
| 36,400 | Iberdrola SA | 490,870 | 0.14 |
| 5,221 | Industria de Diseno Textil SA | 202,174 | 0.06 |
| 1,695 | Naturgy Energy Group SA | 44,454 | 0.01 |
| 8,843 | Repsol SA | 118,669 | 0.03 |
| 1,391 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | 45,648 | 0.01 |
| | | 1,591,179 | 0.44 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|--------------------------------------|-------------|--------------|
| | スウェーデン | | |
| 21,881 | Assa Abloy AB 'B' | 676,859 | 0.19 |
| 18,076 | Atlas Copco AB 'A' | 1,102,617 | 0.31 |
| 3,495 | Atlas Copco AB 'B' | 181,495 | 0.05 |
| 8,578 | Epiroc AB 'B' | 172,192 | 0.05 |
| 8,578 | Epiroc AB 'B' | 3,093 | 0.00 |
| 136 | Evolution AB | 26,009 | 0.01 |
| 10,418 | Hennes & Mauritz AB 'B' | 267,676 | 0.07 |
| 1,679 | Intrum AB | 58,883 | 0.02 |
| 1,489 | Kinnevik AB 'B' | 56,727 | 0.01 |
| 1,489 | Kinnevik AB 'B' | 28,372 | 0.01 |
| 4,325 | SKF AB 'B' | 117,201 | 0.03 |
| 51,045 | Tele2 AB 'B' | 692,239 | 0.19 |
| 85,683 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 1,139,760 | 0.32 |
| 8,132 | Volvo AB 'B' | 214,677 | 0.06 |
| | | 4,737,800 | 1.32 |
| | スイス | | |
| 2,388 | Adecco Group AG Reg | 165,644 | 0.05 |
| 363 | Chubb Ltd | 61,706 | 0.02 |
| 521 | Givaudan SA Reg | 2,330,021 | 0.65 |
| 1,780 | Kuehne + Nagel International AG Reg^ | 600,746 | 0.17 |
| 6,228 | Nestle SA Reg | 767,598 | 0.21 |
| 2,352 | Roche Holding AG | 818,609 | 0.23 |
| 10 | SGS SA Reg | 31,240 | 0.01 |
| 1,679 | Sika AG Reg^ | 540,741 | 0.15 |
| 13,346 | Swiss Re AG | 1,284,726 | 0.36 |
| 43,195 | UBS Group AG Reg | 702,288 | 0.19 |
| | | 7,303,319 | 2.04 |
| | 英国 | | |
| 1 | Associated British Foods Plc | 33 | 0.00 |
| 16,800 | AstraZeneca Plc | 1,915,399 | 0.53 |
| 209,108 | BP Plc | 907,141 | 0.25 |
| 10,747 | British Land Co Plc (REIT)^ | 77,665 | 0.02 |
| 20,626 | Compass Group Plc | 470,117 | 0.13 |
| 484 | Croda International Plc | 47,926 | 0.01 |
| 7,650 | Dunelm Group Plc | 159,132 | 0.04 |
| 46,838 | GlaxoSmithKline Plc | 892,139 | 0.25 |
| 9,974 | HomeServe Plc | 132,074 | 0.04 |
| 5,307 | Howden Joinery Group Plc | 59,935 | 0.02 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|-----------|-----------------------------------|-------------|--------------|
| | 英国(続き) | | |
| 93,712 | HSBC Holdings Plc | 604,593 | 0.17 |
| 580 | InterContinental Hotels Group Plc | 40,444 | 0.01 |
| 6,947 | International Game Technology Plc | 168,534 | 0.05 |
| 167,199 | ITV Plc | 304,207 | 0.09 |
| 238,294 | J Sainsbury Plc^ | 896,832 | 0.25 |
| 62,680 | John Wood Group Plc | 217,514 | 0.06 |
| 10,037 | Johnson Matthey Plc | 433,215 | 0.12 |
| 153,909 | Kingfisher Plc | 785,775 | 0.22 |
| 1,982,362 | Lloyds Banking Group Plc | 1,401,414 | 0.39 |
| 6,464 | Micro Focus International Plc | 47,629 | 0.01 |
| 1,236 | National Grid Plc | 16,449 | 0.01 |
| 158,482 | Natwest Group Plc | 464,858 | 0.13 |
| 26,618 | RELX Plc | 693,629 | 0.19 |
| 7,843 | Rightmove Plc | 67,015 | 0.02 |
| 2,412 | Rio Tinto Plc | 207,256 | 0.06 |
| 2,810 | Smiths Group Plc | 61,698 | 0.02 |
| 6,076 | SSE Plc | 132,762 | 0.04 |
| 84,475 | Standard Chartered Plc | 607,842 | 0.17 |
| 21,193 | Taylor Wimpey Plc | 51,472 | 0.01 |
| 4,186 | Unilever Plc | 250,698 | 0.07 |
| 257,434 | Vodafone Group Plc | 468,018 | 0.13 |
| 159,779 | Wm Morrison Supermarkets Plc | 400,401 | 0.11 |
| | | 12,983,816 | 3.62 |
| | 米国 | | |
| 11,115 | AbbVie Inc | 1,258,218 | 0.35 |
| 1,566 | ABIOMED Inc | 445,652 | 0.12 |
| 6,242 | Adobe Inc | 3,149,588 | 0.88 |
| 518 | Advanced Drainage Systems Inc | 58,752 | 0.02 |
| 13,628 | Advanced Micro Devices Inc | 1,091,330 | 0.30 |
| 7,067 | Agilent Technologies Inc | 976,165 | 0.27 |
| 2,521 | Alaska Air Group Inc^ | 174,453 | 0.05 |
| 353 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 62,322 | 0.02 |
| 1,925 | Align Technology Inc | 1,136,039 | 0.32 |
| 83 | Alleghany Corp | 59,475 | 0.02 |
| 355 | Allegiant Travel Co | 78,618 | 0.02 |
| 22,628 | Ally Financial Inc | 1,237,978 | 0.35 |
| 2,150 | Alphabet Inc 'A' | 5,067,228 | 1.41 |
| 1,150 | Alphabet Inc 'C' | 2,773,294 | 0.77 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---------|----------------------------------|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 2,181 | Amazon.com Inc | 7,029,516 | 1.96 |
| 174 | Amedisys Inc | 44,956 | 0.01 |
| 17,740 | American Express Co^ | 2,840,706 | 0.79 |
| 5,253 | American International Group Inc | 277,569 | 0.08 |
| 1,558 | American Tower Corp (REIT) | 398,007 | 0.11 |
| 628 | Ameriprise Financial Inc | 163,180 | 0.05 |
| 4,323 | Amgen Inc | 1,028,615 | 0.29 |
| 1,549 | Anthem Inc | 616,843 | 0.17 |
| 107,192 | Apple Inc | 13,357,195 | 3.73 |
| 13,198 | Applied Materials Inc | 1,823,040 | 0.51 |
| 62,014 | AT&T Inc | 1,825,072 | 0.51 |
| 2,724 | Autodesk Inc | 778,683 | 0.22 |
| 5,138 | Automatic Data Processing Inc | 1,007,151 | 0.28 |
| 25,766 | Baker Hughes Co | 628,690 | 0.18 |
| 6,867 | Bank of America Corp | 291,092 | 0.08 |
| 20,041 | Bank of New York Mellon Corp^ | 1,043,735 | 0.29 |
| 6,108 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 1,767,900 | 0.49 |
| 1,833 | Best Buy Co Inc | 213,068 | 0.06 |
| 1,550 | Biogen Inc | 414,594 | 0.12 |
| 1,823 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 140,918 | 0.04 |
| 468 | Booking Holdings Inc | 1,105,205 | 0.31 |
| 11,287 | BorgWarner Inc | 578,910 | 0.16 |
| 37,720 | Bristol-Myers Squibb Co | 2,478,958 | 0.69 |
| 762 | Builders FirstSource Inc | 33,939 | 0.01 |
| 4,278 | Cadence Design Systems Inc | 543,263 | 0.15 |
| 13,748 | Carrier Global Corp | 631,446 | 0.18 |
| 5,057 | Caterpillar Inc | 1,219,142 | 0.34 |
| 22,969 | CBRE Group Inc 'A' | 2,016,219 | 0.56 |
| 4,523 | Centene Corp | 332,893 | 0.09 |
| 4,324 | Cerner Corp | 338,353 | 0.09 |
| 7,741 | CH Robinson Worldwide Inc | 751,032 | 0.21 |
| 8,101 | Charles Schwab Corp | 598,259 | 0.17 |
| 22,003 | Chevron Corp | 2,283,691 | 0.64 |
| 39 | Chipotle Mexican Grill Inc | 53,507 | 0.01 |
| 6,743 | Cigna Corp | 1,745,426 | 0.49 |
| 4,459 | Cisco Systems Inc | 235,881 | 0.07 |
| 4,656 | Citigroup Inc | 366,474 | 0.10 |
| 4,917 | Clorox Co | 868,981 | 0.24 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 1,436 | CME Group Inc | 314,139 | 0.09 |
| 38,914 | Coca-Cola Co | 2,151,555 | 0.60 |
| 5,239 | Cognizant Technology Solutions Corp 'A' | 374,903 | 0.10 |
| 30,107 | Colgate-Palmolive Co | 2,522,364 | 0.70 |
| 1,022 | Columbia Sportswear Co | 104,990 | 0.03 |
| 27,359 | Comcast Corp 'A' | 1,568,765 | 0.44 |
| 26,987 | Conagra Brands Inc | 1,028,205 | 0.29 |
| 987 | ConocoPhillips | 55,015 | 0.02 |
| 15,843 | Consolidated Edison Inc | 1,223,713 | 0.34 |
| 3,134 | Corning Inc | 136,736 | 0.04 |
| 4,556 | Costco Wholesale Corp | 1,723,398 | 0.48 |
| 3,323 | CSX Corp | 332,699 | 0.09 |
| 2,896 | Cummins Inc | 745,083 | 0.21 |
| 33,678 | CVS Health Corp | 2,911,126 | 0.81 |
| 183 | Danaher Corp | 46,874 | 0.01 |
| 613 | Deckers Outdoor Corp | 205,625 | 0.06 |
| 3,146 | Deere & Co | 1,136,021 | 0.32 |
| 12,517 | Delta Air Lines Inc | 596,811 | 0.17 |
| 910 | DexCom Inc | 336,145 | 0.09 |
| 1,347 | Donaldson Co Inc | 82,962 | 0.02 |
| 970 | DR Horton Inc | 92,431 | 0.03 |
| 5,693 | eBay Inc | 346,590 | 0.10 |
| 3,551 | Ecolab Inc | 763,749 | 0.21 |
| 3,192 | Edison International | 178,337 | 0.05 |
| 3,750 | Edwards Lifesciences Corp | 359,625 | 0.10 |
| 3,113 | Eli Lilly and Co | 621,791 | 0.17 |
| 438 | EMCOR Group Inc | 55,236 | 0.02 |
| 5,942 | EOG Resources Inc | 477,380 | 0.13 |
| 2,020 | Equinix Inc (REIT)^ | 1,488,174 | 0.42 |
| 6,406 | Equity Residential (REIT) | 496,145 | 0.14 |
| 296 | Estee Lauder Cos Inc 'A' | 90,730 | 0.03 |
| 1,405 | Etsy Inc | 231,446 | 0.06 |
| 11,191 | Exelon Corp | 504,938 | 0.14 |
| 19,751 | Expeditors International of Washington Inc^ | 2,482,503 | 0.69 |
| 11,014 | Facebook Inc 'A' | 3,620,632 | 1.01 |
| 76 | FactSet Research Systems Inc | 25,411 | 0.01 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|--|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 3,756 | FedEx Corp | 1,182,426 | 0.33 |
| 15,184 | Fidelity National Information Services Inc | 2,262,112 | 0.63 |
| 6,296 | Flowserve Corp^ | 266,887 | 0.07 |
| 9,439 | Genuine Parts Co | 1,237,642 | 0.35 |
| 10,464 | Gilead Sciences Inc | 691,775 | 0.19 |
| 1,356 | Hartford Financial Services Group Inc | 88,615 | 0.02 |
| 2,486 | Hasbro Inc | 238,581 | 0.07 |
| 2,312 | HCA Healthcare Inc | 496,594 | 0.14 |
| 69,099 | Hewlett Packard Enterprise Co | 1,102,820 | 0.31 |
| 528 | Hexcel Corp | 31,395 | 0.01 |
| 3,497 | Hilton Worldwide Holdings Inc | 438,069 | 0.12 |
| 13,208 | Hologic Inc | 832,897 | 0.23 |
| 8,645 | Home Depot Inc | 2,756,977 | 0.77 |
| 9,330 | HP Inc | 272,716 | 0.08 |
| 1,122 | HubSpot Inc | 565,914 | 0.16 |
| 2,300 | Humana Inc | 1,006,710 | 0.28 |
| 14,737 | Huntington Bancshares Inc | 233,729 | 0.06 |
| 1,761 | IDEXX Laboratories Inc | 982,832 | 0.27 |
| 941 | Illinois Tool Works Inc | 218,086 | 0.06 |
| 1,346 | Illumina Inc | 545,991 | 0.15 |
| 147 | Ingersoll Rand Inc | 7,297 | 0.00 |
| 2,373 | Insulet Corp | 639,927 | 0.18 |
| 52,473 | Intel Corp | 2,997,258 | 0.84 |
| 7,203 | International Business Machines Corp | 1,035,359 | 0.29 |
| 6,658 | Intuit Inc^ | 2,923,461 | 0.82 |
| 1,712 | Itron Inc | 163,239 | 0.05 |
| 1,134 | ITT Inc | 106,483 | 0.03 |
| 4,539 | J M Smucker Co | 605,003 | 0.17 |
| 23,449 | Johnson & Johnson | 3,968,743 | 1.11 |
| 16,525 | JPMorgan Chase & Co | 2,714,066 | 0.76 |
| 265 | Kansas City Southern | 78,885 | 0.02 |
| 28,664 | Kellogg Co | 1,877,205 | 0.52 |
| 10,512 | KeyCorp | 242,196 | 0.07 |
| 470 | Keysight Technologies Inc | 66,919 | 0.02 |
| 85,720 | Kinder Morgan Inc | 1,572,105 | 0.44 |
| 225 | Laboratory Corp of America Holdings | 61,758 | 0.02 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|----------------------------------|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 1,421 | Lam Research Corp | 923,437 | 0.26 |
| 3,084 | Lennar Corp 'A' | 305,347 | 0.08 |
| 566 | Lennox International Inc | 198,060 | 0.06 |
| 825 | LHC Group Inc | 162,401 | 0.05 |
| 1,781 | Lincoln National Corp | 124,296 | 0.03 |
| 4,559 | LKQ Corp | 232,327 | 0.06 |
| 7,879 | Lowe's Cos Inc | 1,535,066 | 0.43 |
| 8,772 | Marsh & McLennan Cos Inc | 1,213,606 | 0.34 |
| 13,983 | Masco Corp | 843,315 | 0.24 |
| 7,023 | Mastercard Inc 'A' | 2,532,353 | 0.71 |
| 6,954 | McDonald's Corp | 1,626,471 | 0.45 |
| 2,618 | McKesson Corp | 503,677 | 0.14 |
| 2,201 | MDU Resources Group Inc | 74,086 | 0.02 |
| 385 | MercadoLibre Inc | 523,088 | 0.15 |
| 1,818 | Mercury Systems Inc | 118,988 | 0.03 |
| 32,411 | MetLife Inc^ | 2,118,383 | 0.59 |
| 409 | Mettler-Toledo International Inc | 532,089 | 0.15 |
| 751 | MGM Resorts International | 32,195 | 0.01 |
| 38,190 | Microsoft Corp | 9,535,279 | 2.66 |
| 931 | Moderna Inc | 172,244 | 0.05 |
| 7,684 | Molson Coors Beverage Co 'B' | 448,131 | 0.12 |
| 29,957 | Morgan Stanley | 2,724,589 | 0.76 |
| 1,250 | Netflix Inc | 628,513 | 0.18 |
| 13,414 | New York Community Bancorp Inc | 160,566 | 0.04 |
| 13,338 | NextEra Energy Inc | 976,608 | 0.27 |
| 6,671 | NIKE Inc 'B' | 910,325 | 0.25 |
| 4,920 | NVIDIA Corp | 3,196,918 | 0.89 |
| 527 | Okta Inc | 117,226 | 0.03 |
| 1,618 | Oshkosh Corp | 212,670 | 0.06 |
| 5,590 | Otis Worldwide Corp | 437,865 | 0.12 |
| 471 | Owens Corning | 50,232 | 0.01 |
| 5,950 | Paychex Inc | 601,783 | 0.17 |
| 11,408 | PayPal Holdings Inc | 2,966,308 | 0.83 |
| 17,657 | PepsiCo Inc | 2,612,177 | 0.73 |
| 9,372 | Pfizer Inc | 362,978 | 0.10 |
| 1,357 | Phillips 66 | 114,287 | 0.03 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|--------------------------------|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 1,942 | PPG Industries Inc | 349,016 | 0.10 |
| 5,137 | Procter & Gamble Co | 692,724 | 0.19 |
| 2,390 | Progressive Corp | 236,801 | 0.07 |
| 7,395 | Prologis Inc (REIT) | 871,427 | 0.24 |
| 2,882 | PTC Inc | 386,591 | 0.11 |
| 4,936 | PulteGroup Inc | 285,251 | 0.08 |
| 10,564 | QUALCOMM Inc | 1,421,281 | 0.40 |
| 872 | Quidel Corp | 102,992 | 0.03 |
| 696 | Regeneron Pharmaceuticals Inc | 349,691 | 0.10 |
| 49,844 | Regions Financial Corp^ | 1,166,848 | 0.33 |
| 6,433 | Reliance Steel & Aluminum Co^ | 1,081,194 | 0.30 |
| 875 | ResMed Inc | 180,119 | 0.05 |
| 928 | Robert Half International Inc | 82,397 | 0.02 |
| 1,805 | Rockwell Automation Inc^ | 476,015 | 0.13 |
| 119 | Roku Inc | 41,259 | 0.01 |
| 1,294 | Roper Technologies Inc | 582,313 | 0.16 |
| 5,951 | salesforce.com Inc | 1,416,933 | 0.40 |
| 3,623 | SBA Communications Corp (REIT) | 1,080,089 | 0.30 |
| 2,518 | ServiceNow Inc | 1,193,230 | 0.33 |
| 73,434 | Sirius XM Holdings Inc | 458,963 | 0.13 |
| 3,854 | Snap Inc 'A' | 239,410 | 0.07 |
| 9,558 | Southwest Airlines Co | 587,435 | 0.16 |
| 3,554 | Square Inc 'A' | 790,836 | 0.22 |
| 11,045 | Starbucks Corp | 1,257,805 | 0.35 |
| 4,527 | State Street Corp | 393,758 | 0.11 |
| 423 | Synopsys Inc | 107,586 | 0.03 |
| 1,776 | Sysco Corp | 143,856 | 0.04 |
| 5,275 | T Rowe Price Group Inc^ | 1,009,371 | 0.28 |
| 1,956 | Tandem Diabetes Care Inc | 167,023 | 0.05 |
| 5,431 | Tapestry Inc | 243,798 | 0.07 |
| 5,237 | Target Corp | 1,188,380 | 0.33 |
| 1,892 | Teladoc Health Inc | 284,897 | 0.08 |
| 8,124 | Terminix Global Holdings Inc | 400,838 | 0.11 |
| 4,547 | Tesla Inc^ | 2,842,875 | 0.79 |
| 7,014 | Texas Instruments Inc | 1,331,398 | 0.37 |
| 2,749 | Thermo Fisher Scientific Inc | 1,290,656 | 0.36 |

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

| 保有高 | 銘柄 | 時価 (米ドル) | 純資産比率 (%) |
|--------|---|-------------|--------------|
| | 米国(続き) | | |
| 2,098 | Timken Co [^] | 185,568 | 0.05 |
| 19,424 | TJX Cos Inc | 1,311,897 | 0.37 |
| 616 | Travel + Leisure Co | 40,132 | 0.01 |
| 14,302 | Travelers Cos Inc | 2,284,029 | 0.64 |
| 11,674 | Truist Financial Corp | 721,220 | 0.20 |
| 13,573 | UGI Corp | 625,037 | 0.17 |
| 5,265 | United Parcel Service Inc 'B' | 1,129,869 | 0.32 |
| 9,005 | UnitedHealth Group Inc | 3,709,340 | 1.03 |
| 10,154 | Verizon Communications Inc | 573,599 | 0.16 |
| 2,362 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 492,784 | 0.14 |
| 8,540 | VF Corp | 680,809 | 0.19 |
| 15,908 | Visa Inc 'A' [^] | 3,615,888 | 1.01 |
| 9,766 | Voya Financial Inc | 639,868 | 0.18 |
| 3,118 | Walgreens Boots Alliance Inc | 164,194 | 0.05 |
| 17,991 | Walt Disney Co | 3,214,092 | 0.90 |
| 3,938 | Waters Corp | 1,269,021 | 0.35 |
| 15,744 | Wells Fargo & Co | 735,560 | 0.20 |
| 4,846 | Western Union Co | 118,582 | 0.03 |
| 1,532 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 58,155 | 0.02 |
| 682 | Wintrust Financial Corp | 54,846 | 0.02 |
| 3,195 | Workday Inc 'A' | 730,760 | 0.20 |
| 4,650 | WW Grainger Inc | 2,149,044 | 0.60 |
| 458 | Wyndham Hotels & Resorts Inc [^] | 34,377 | 0.01 |
| 10,845 | Xylem Inc [^] | 1,281,011 | 0.36 |
| 847 | Zebra Technologies Corp 'A' | 421,001 | 0.12 |
| 1,891 | Zendesk Inc | 258,424 | 0.07 |
| 2,024 | Zions Bancorp NA | 117,149 | 0.03 |
| 2,479 | Zoetis Inc | 437,990 | 0.12 |
| 507 | Zoom Video Communications Inc 'A' | 168,086 | 0.05 |
| 1,282 | Zscaler Inc | 248,964 | 0.07 |
| | | 225,420,376 | 62.91 |
| | 普通株式合計 | 353,851,268 | 98.75 |
| | 公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計 | 353,851,268 | 98.75 |
| | 投資有価証券(時価)合計 | 353,851,268 | 98.75 |
| | その他の純資産 | 4,487,403 | 1.25 |
| | 純資産合計(米ドル) | 358,338,671 | 100.00 |

[^] 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

| 契約数 | 契約通貨 | 契約/摘要 | 満期日 | 基礎となるエクスポージャー総額 (米ドル) | 未実現純評価益/ (損) (米ドル) |
|-------------------|------|--|---------|--------------------------|--------------------------|
| 金融デリバティブ商品 | | | | | |
| 先物取引 | | | | | |
| 11 | USD | E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021 | 2021年6月 | 2,313,080 | 880 |
| 10 | USD | MSCI EAFE Index Futures June 2021 | 2021年6月 | 1,166,500 | (736) |
| 合計 | | | | 3,479,580 | 144 |

| 通貨 | 買予約 | 通貨 | 売予約 | 取引相手 | 期日 | 未実現純評価益/(損) (米ドル) |
|-------------------------------------|---------------|-----|------------|-----------------------------------|-----------|----------------------|
| 金融デリバティブ商品 | | | | | | |
| 未決済先渡為替予約 | | | | | | |
| ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス | | | | | | |
| EUR | 8,793 | USD | 10,627 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2021 | 106 |
| USD | 345 | EUR | 284 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2021 | (1) |
| | | | | | | 105 |
| ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス | | | | | | |
| JPY | 1,112,004,496 | USD | 10,187,536 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2021 | (44,241) |
| USD | 287,170 | JPY | 31,329,593 | State Street Bank & Trust Company | 15/6/2021 | 1,393 |
| | | | | | | (42,848) |
| 合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 10,440,152米ドル) | | | | | | (42,743) |

<参考情報>

インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc
 ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンドの運用状況について
 (計算期間:2019年10月1日~2020年9月30日)

インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc(アイルランド籍投資法人)ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド(以下ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド)はブラックロックESG世界株式ファンド(限定為替ヘッジあり)／(為替ヘッジなし)が投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年9月末日)です。

よって入手可能な直前の計算期間(決算)である2020年9月30日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

| ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド | |
|--------------------------------|--|
| 形態 | アイルランド籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て) |
| 投資目的および投資態度 | ファンドは、流動性と元本の安定性を確保しつつ、安定的なインカム水準を追求します。ファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引に投資をします。現先取引の活用により流動性を確保します。 |
| 設定日 | 2008年9月29日 |
| 存続期間 | 無期限 |
| 主な投資対象 | 主としてファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | ・同一発行体の譲渡性のある証券もしくは短期金融商品への投資は原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 |
| 管理報酬 その他費用 | 管理報酬、保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。 |
| 決算日 | 年1回(原則として9月30日)に決算を行いません。 |
| 収益分配方針 | 原則として、分配を行いません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 管理会社 | ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド |
| 投資顧問会社 | ブラックロック・キャピタル・マネジメント・インク |
| 保管会社 | J Pモルガン・バンク(アイルランド)ピー・エル・シー |

ICS ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド

損益計算書

2019年10月1日から2020年9月30日までの期間

| | 2020年 千米ドル | 2019年 千米ドル |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 営業収益 | 138,139 | 272,710 |
| 金融商品に係る純利益 | 1,450 | 367 |
| 投資収益合計 | 139,589 | 273,077 |
| 営業費用 | (26,654) | (18,810) |
| 純営業利益 | 112,935 | 254,267 |
| 財務費用: | | |
| 償還可能投資証券保有者への分配金 | (109,243) | (238,800) |
| 財務費用合計 | (109,243) | (238,800) |
| 純利益 | 3,692 | 15,467 |
| 償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加 | 3,692 | 15,467 |

本損益計算書に計上された損益以外で当会計年度に認識された損益はない。

ICS ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド

償還可能投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書

2020年9月30日に終了した会計年度

| | 2020年 千米ドル | 2019年 千米ドル |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 期首純資産 | 14,146,140 | 11,308,849 |
| 償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加 | 3,692 | 15,467 |
| 投資証券取引: | | |
| 償還可能投資証券の発行 | 153,905,900 | 83,809,795 |
| 償還可能投資証券の買戻 | (146,833,759) | (81,072,165) |
| 分配金再投資額 | 59,337 | 84,194 |
| 投資証券取引による純資産の増加 | 7,131,478 | 2,821,824 |
| 期末純資産 | 21,281,310 | 14,146,140 |

ICS ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド

貸借対照表

2020年9月30日現在

| | 2020年 | 2019年 |
|----------------------------|-------------------|-------------------|
| | 千米ドル | 千米ドル |
| 流動資産 | | |
| 現金 | 791,865 | 377,875 |
| 未収金 | 6,207 | 11,789 |
| 損益を通じて公正価値で測定する金融資産 | 20,519,603 | 13,842,168 |
| 流動資産合計 | 21,317,675 | 14,231,832 |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 36,365 | 85,692 |
| 流動負債合計 | 36,365 | 85,692 |
| 償還可能投資証券保有者に帰属する純資産 | 21,281,310 | 14,146,140 |

ICS ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド
 投資有価証券明細表 2020年9月30日現在

| 保有高 | 通貨 | 銘柄 | 公正価値 (千米ドル) | 純資産比率 (%) |
|------------------------------|-----|--|----------------|--------------|
| 債券 | | | | |
| 国債(2019年9月30日:38.78%) | | | | |
| 米国(2019年9月30日:38.78%) | | | | |
| 22,760,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 01/12/2020 | 22,754 | 0.11 |
| 35,570,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 22/12/2020 | 35,558 | 0.17 |
| 74,655,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 05/01/2021 | 74,635 | 0.35 |
| 400,000,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 12/01/2021 | 399,897 | 1.88 |
| 154,315,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 19/01/2021 | 154,258 | 0.72 |
| 11,460,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 26/01/2021 | 11,456 | 0.05 |
| 468,535,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 02/02/2021 | 468,358 | 2.20 |
| 400,000,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 16/02/2021 | 399,816 | 1.88 |
| 721,940,000 | USD | United States of America Bill, 0.00%, 23/02/2021 | 721,642 | 3.39 |
| 13,405,000 | USD | US Treasury, 1.75%, 16/11/2020 | 13,407 | 0.06 |
| 25,685,000 | USD | US Treasury, 2.63%, 16/11/2020 | 25,716 | 0.12 |
| 114,510,000 | USD | US Treasury, 1.63%, 30/11/2020 | 114,511 | 0.54 |
| 89,655,000 | USD | US Treasury, 2.00%, 30/11/2020 | 89,710 | 0.42 |
| 150,255,000 | USD | US Treasury, 2.75%, 30/11/2020 | 150,722 | 0.71 |
| 23,160,000 | USD | US Treasury, 1.75%, 31/12/2020 | 23,165 | 0.11 |
| 18,070,000 | USD | US Treasury, 2.38%, 31/12/2020 | 18,125 | 0.09 |
| 213,115,000 | USD | US Treasury, 2.50%, 31/12/2020 | 213,571 | 1.00 |
| 11,530,000 | USD | US Treasury, 3.63%, 15/02/2021 | 11,661 | 0.05 |
| 110,000,000 | USD | US Treasury, 2.50%, 28/02/2021 | 110,786 | 0.52 |
| 2,171,000,000 | USD | US Treasury, FRN, 0.15%, 31/10/2020 | 2,170,766 | 10.20 |
| 1,930,000,000 | USD | US Treasury, FRN, 0.22%, 31/01/2021 | 1,929,951 | 9.07 |
| 220,849,700 | USD | US Treasury, FRN, 0.24%, 30/04/2021 | 220,980 | 1.04 |
| 69,865,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 06/10/2020 | 69,864 | 0.33 |
| 73,220,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 08/10/2020 | 73,218 | 0.34 |
| 208,360,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 13/10/2020 | 208,353 | 0.98 |
| 801,190,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 15/10/2020 | 801,142 | 3.76 |
| 63,540,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 22/10/2020 | 63,536 | 0.30 |
| 400,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 27/10/2020 | 399,974 | 1.88 |
| 611,120,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 29/10/2020 | 611,070 | 2.87 |
| 1,585,075,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/11/2020 | 1,584,930 | 7.45 |
| 110,285,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 10/11/2020 | 110,263 | 0.52 |
| 225,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 17/11/2020 | 224,944 | 1.06 |
| 65,095,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 19/11/2020 | 65,086 | 0.31 |
| 252,635,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2020 | 252,568 | 1.19 |

| 保有高 | 通貨 | 銘柄 | 公正価値 (千米ドル) | 純資産比率 (%) |
|-------------|-----|-------------------------------------|----------------|--------------|
| | | 米国(2019年9月30日:38.78%)(続き) | | |
| 35,250,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 27/11/2020 | 35,241 | 0.17 |
| 43,365,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 03/12/2020 | 43,352 | 0.20 |
| 514,045,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 24/12/2020 | 513,919 | 2.41 |
| 76,025,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 31/12/2020 | 75,994 | 0.36 |
| 300,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 07/01/2021 | 299,902 | 1.41 |
| 74,300,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 14/01/2021 | 74,276 | 0.35 |
| 950,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2021 | 949,692 | 4.46 |
| 94,155,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 28/01/2021 | 94,109 | 0.44 |
| 250,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 04/02/2021 | 249,908 | 1.17 |
| 160,060,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 11/02/2021 | 159,989 | 0.75 |
| 150,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 25/02/2021 | 149,890 | 0.70 |
| 125,000,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 18/03/2021 | 124,936 | 0.59 |
| 176,205,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 25/03/2021 | 176,052 | 0.83 |
| 144,235,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021 | 144,087 | 0.68 |
| 54,555,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 15/07/2021 | 54,488 | 0.26 |
| 74,575,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 12/08/2021 | 74,484 | 0.35 |
| 47,955,000 | USD | US Treasury Bill, 0.00%, 09/09/2021 | 47,891 | 0.23 |
| | | 米国合計 | 15,114,603 | 71.03 |
| 国債に対する投資合計 | | | 15,114,603 | 71.03 |
| 債券に対する投資合計 | | | 15,114,603 | 71.03 |

| 保有高 | 通貨 | 取引相手 | 金利 | 期日 | 公正価値 (千米ドル) | 純資産比率 (%) |
|---|-----|---------------------|-------|------------|-------------------|---------------------------|
| リバースレボ取引 ¹ (2019年9月30日:59.07%) | | | | | | |
| フランス(2019年9月30日:0.78%) | | | | | - | - |
| 米国(2019年9月30日:58.29%) | | | | | | |
| 400,000,000 | USD | Bank of Nova Scotia | 0.07% | 01/10/2020 | 400,000 | 1.88 |
| 1,300,000,000 | USD | Barclays | 0.06% | 01/10/2020 | 1,300,000 | 6.11 |
| 850,000,000 | USD | BNP Paribas | 0.06% | 01/10/2020 | 850,000 | 3.99 |
| 325,000,000 | USD | BofA Securities | 0.06% | 01/10/2020 | 325,000 | 1.53 |
| 150,000,000 | USD | BofA Securities | 0.06% | 01/10/2020 | 150,000 | 0.70 |
| 70,000,000 | USD | Citigroup | 0.06% | 01/10/2020 | 70,000 | 0.33 |
| 185,000,000 | USD | Credit Agricole | 0.06% | 01/10/2020 | 185,000 | 0.87 |
| 500,000,000 | USD | Credit Suisse | 0.06% | 01/10/2020 | 500,000 | 2.35 |
| 196,078,431 | USD | J.P. Morgan | 0.08% | 01/10/2020 | 196,078 | 0.92 |
| 148,427,801 | USD | J.P. Morgan | 0.08% | 01/10/2020 | 148,428 | 0.70 |
| 104,485,294 | USD | J.P. Morgan | 0.08% | 01/10/2020 | 104,485 | 0.49 |
| 51,009,436 | USD | J.P. Morgan | 0.08% | 01/10/2020 | 51,009 | 0.24 |
| 500,000,000 | USD | Societe Generale | 0.06% | 01/10/2020 | 500,000 | 2.35 |
| 540,000,000 | USD | TD Securities (USA) | 0.06% | 01/10/2020 | 540,000 | 2.54 |
| 84,000,000 | USD | Wells Fargo | 0.06% | 01/10/2020 | 84,000 | 0.39 |
| 1,000,000 | USD | Wells Fargo | 0.06% | 01/10/2020 | 1,000 | - |
| 米国合計 | | | | | 5,405,000 | 25.39 |
| リバースレボ取引に対する投資合計 | | | | | 5,405,000 | 25.39 |
| 損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計 | | | | | 20,519,603 | 96.42 |
| 現金 | | | | | 791,865 | 3.72 |
| その他の資産および負債 | | | | | (30,158) | (0.14) |
| 償還可能投資証券保有者に帰属する純資産 | | | | | 21,281,310 | 100.00 |
| 資産合計額の内訳 | | | | | | 資産合計に対する割合 (%) |
| 公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計 | | | | | | 23.89 |
| その他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券 | | | | | | 72.37 |
| その他の資産 | | | | | | 3.74 |
| 資産合計 | | | | | | 100.00 |

¹ 担保として保有する有価証券は5,481,565,000米ドルであった。