

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（2010年4月28日設定）	
運用方針	MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA外国株式インデックスマザーファンド」に投資します。	
主要投資対象	東京海上セレクション・外国株式インデックス	主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか外国の株式等に直接投資することがあります。
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	主として外国の株式に投資します。
投資制限	東京海上セレクション・外国株式インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> ・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割合には、制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として経費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。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。</p> <p>ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>	

東京海上セレクション・外国株式インデックス

第10期 運用報告書（全体版）

（決算日 2020年4月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京海上セレクション・外国株式インデックス」は、このたび、第10期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税金 分配	み 騰 落	期 騰 落	中 率	ベンチマーク		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
						騰 落	中 率				
6期(2016年4月15日)	円 17,948	0	△	834,056	% 12.0	% 11.4	% 94.8	% 2.4	% 2.7	百万円 730	
7期(2017年4月17日)	19,861	0	10.7	928,924	11.4	93.1	4.2	2.6	1,702		
8期(2018年4月16日)	22,884	0	15.2	1,072,943	15.5	90.4	7.0	2.2	4,486		
9期(2019年4月15日)	25,433	0	11.1	1,200,119	11.9	94.2	3.2	2.5	8,852		
10期(2020年4月15日)	23,081	0	△ 9.2	1,092,057	△ 9.0	93.4	4.7	2.6	14,573		

(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います。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準 騰落率	ベンチ 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率
(期首) 2019年4月15日	円 25,433	% —	% 94.2	% 3.2	% 2.5
4月末	25,451	0.1	94.3	5.3	2.5
5月末	23,830	△ 6.3	97.0	2.3	2.7
6月末	24,667	△ 3.0	98.0	2.1	2.7
7月末	25,346	△ 0.3	97.6	2.3	2.7
8月末	24,094	△ 5.3	97.7	2.5	2.9
9月末	24,885	△ 2.2	98.0	2.3	2.8
10月末	25,864	1.7	98.2	1.8	2.8
11月末	26,806	5.4	93.7	3.7	2.6
12月末	27,625	8.6	94.4	6.3	2.6
2020年1月末	27,651	8.7	98.5	1.6	2.7
2月末	25,478	0.2	98.7	1.6	2.8
3月末	21,672	△14.8	98.9	3.4	2.7
(期末) 2020年4月15日	23,081	△ 9.2	93.4	4.7	2.6

(注) 騰落率は期首比です。

(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います。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

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

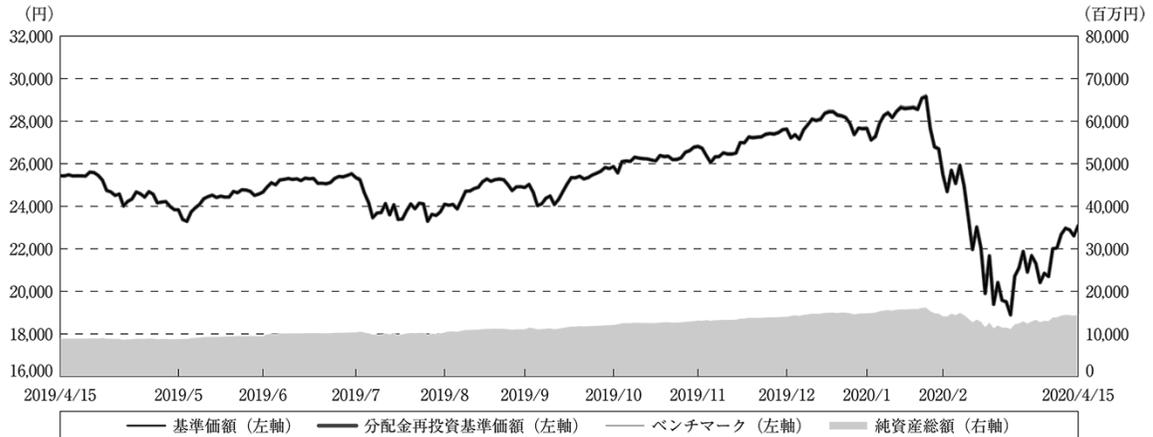
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値（TTM）を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数（米ドルベース）を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

○運用経過

(2019年4月16日～2020年4月15日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：25,433円

期 末：23,081円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 9.2% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、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) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2019年4月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・FRB(米連邦準備制度理事会)による金融緩和期待
- ・米中貿易協議の部分合意

マイナス要因

- ・米中貿易摩擦の激化による景気減速懸念の高まり
- ・新型コロナウイルス感染拡大による世界的な景気後退懸念の高まり

■投資環境

(2019年4月から5月)

期初から2019年5月末にかけては、米国による対中輸入関税引き上げの表明を受けて景気減速懸念が高まったことから、外国株式市場は下落しました。

(2019年6月から8月)

6月から7月にかけては、FRBによる利下げへの期待などが相場を下支えしたものの、8月に入り中国が人民元安を容認する姿勢を示すと、米国が対抗措置として中国を為替操作国に認定するなど米中貿易摩擦への懸念が一段と高まり、外国株式市場は下落しました。

(2019年9月から2020年4月)

9月以降は、低調な米経済指標などから景気減速懸念が高まり、外国株式市場は下落する局面もあったものの、米中貿易協議の部分合意などが好感され、2020年2月中旬にかけて上昇基調で推移しました。2月下旬以降は、新型コロナウイルス感染拡大による世界経済への影響が懸念され、外国株式市場は大幅に下落しました。

以上のような経過を経て、当期の外国株式市場は下落しました。

■ポートフォリオについて

<東京海上セレクション・外国株式インデックス>

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、9.2%下落しました。

<TMA外国株式インデックスマザーファンド>

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、最適化法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の1,007銘柄に対して、当期末には1,022銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上のような運用の結果、基準価額は9.0%下落しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は $\Delta 9.2\%$ となり、ベンチマークの騰落率 $\Delta 9.0\%$ にほぼ連動しました。

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、過去1年で0.2%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

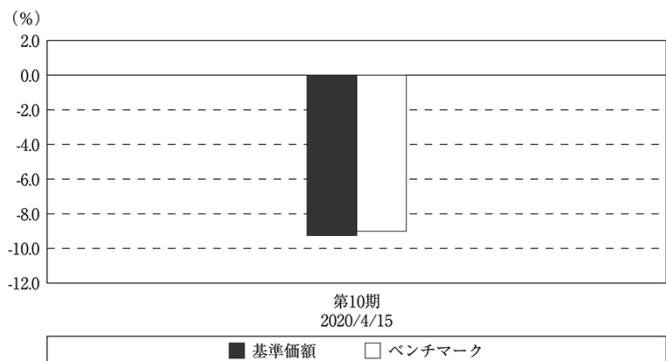
- ・特にありません

マイナス要因

- ・信託報酬などのコスト
- ・配当課税の影響

※毎月の対ベンチマーク超過収益率(ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差)の標準偏差(ばらつき度合い)を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

■分配金

当期においては、当ファンドが確定拠出年金向けに設定されたファンドであるという性格を鑑み、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第10期
	2019年4月16日～ 2020年4月15日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	14,360

(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

<東京海上セレクション・外国株式インデックス>

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<TMA外国株式インデックスマザーファンド>

ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○ 1万口当たりの費用明細

(2019年4月16日～2020年4月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	円 56 (31) (19) (6)	% 0.220 (0.121) (0.077) (0.022)	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 *委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価 *購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 *運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	6 (5) (0) (1)	0.022 (0.018) (0.001) (0.004)	(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 *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 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	6 (6) (0)	0.026 (0.025) (0.000)	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 *有価証券取引税は、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 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	22 (21) (1) (0)	0.087 (0.082) (0.005) (0.000)	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 *監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 *その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	90	0.355	
期中の平均基準価額は、25,280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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

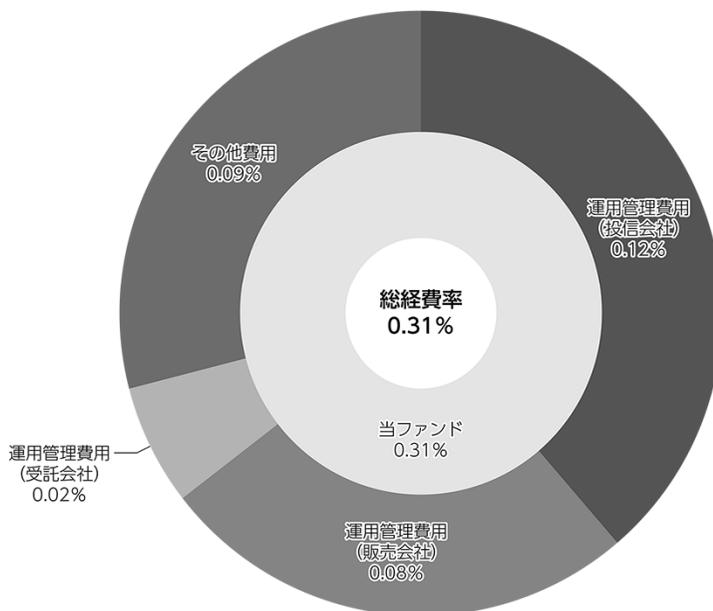
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.31%です。



(注) 当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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

(2019年4月16日～2020年4月15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
		千口	千円	千口	千円
TMA外国株式インデックスマザーファンド		3,619,860	9,078,948	822,315	2,062,564

○株式売買比率

(2019年4月16日～2020年4月15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	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	7,751,429千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,931,534千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.59	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年4月16日～2020年4月15日)

該当事項はございません。

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

(2020年4月15日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
TMA外国株式インデックスマザーファンド		3,455,363	6,252,908	14,573,029

○投資信託財産の構成

(2020年4月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA外国株式インデックススマザーファンド	14,573,029	99.9
コール・ローン等、その他	15,314	0.1
投資信託財産総額	14,588,343	100.0

(注) TMA外国株式インデックススマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(16,783,464千円)の投資信託財産総額(16,813,067千円)に対する比率は99.8%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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=107.18円、1カナダドル=77.11円、1ユーロ=117.73円、1英ポンド=135.22円、1スイスフラン=111.62円、1スウェーデンクローネ=10.80円、1ノルウェークローネ=10.39円、1デンマーククローネ=15.78円、1豪ドル=68.87円、1ニュージーランドドル=65.38円、1香港ドル=13.83円、1シンガポールドル=75.85円、1イスラエルシェケル=29.90円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年4月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,588,343,570
TMA外国株式インデックススマザーファンド(評価額)	14,573,029,135
未収入金	15,314,435
(B) 負債	15,314,435
未払信託報酬	14,984,918
その他未払費用	329,517
(C) 純資産総額(A-B)	14,573,029,135
元本	6,313,731,924
次期繰越損益金	8,259,297,211
(D) 受益権総口数	6,313,731,924口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,081円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,480,718,536円、期中追加設定元本額は3,651,309,495円、期中一部解約元本額は818,296,107円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2019年4月16日～2020年4月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△1,254,777,796
売買益	131,751,825
売買損	△1,386,529,621
(B) 信託報酬等	△ 26,296,684
(C) 当期損益金(A+B)	△1,281,074,480
(D) 前期繰越損益金	833,407,174
(E) 追加信託差損益金	8,706,964,517
(配当等相当額)	(7,987,602,398)
(売買損益相当額)	(719,362,119)
(F) 計(C+D+E)	8,259,297,211
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	8,259,297,211
追加信託差損益金	8,706,964,517
(配当等相当額)	(8,001,969,205)
(売買損益相当額)	(704,995,312)
分配準備積立金	1,065,086,208
繰越損益金	△1,512,753,514

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	231,679,034円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	8,001,969,205円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	833,407,174円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	9,067,055,413円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	14,360円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2020年4月15日現在)

<TMA外国株式インデックスマザーファンド>

下記は、TMA外国株式インデックスマザーファンド全体(7,207,504千口)の内容です。

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千米ドル	千円	
AFLAC INC	15	28	107	11,540	保険
AT&T INC	175	312	972	104,246	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	43	76	682	73,126	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	36	66	546	58,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	1	2	41	4,479	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	18	36	229	24,626	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	1	2	19	2,102	資本財
ADOBE INC	12	21	729	78,159	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	2	4	51	5,503	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	24	48	267	28,712	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8	16	127	13,619	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4	9	210	22,599	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	5	9	97	10,448	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	3	5	34	3,747	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5	12	121	13,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	4	83	9,000	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	0.53	0.84	47	5,049	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1	4	17	1,884	ソフトウェア・サービス
ALLSTATE CORP	7	11	122	13,098	保険
ALPHABET INC-CL C	7	13	1,688	180,927	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	7	12	1,633	175,069	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	45	79	334	35,844	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	10	18	4,189	449,072	小売
AMEREN CORPORATION	6	10	78	8,378	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	11	19	169	18,174	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	17	29	259	27,843	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	6	49	5,344	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	22	34	89	9,626	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5	8	107	11,542	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	4	8	73	7,916	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4	5	59	6,370	各種金融
AMETEK INC	6	8	70	7,523	資本財
AMGEN INC	15	26	603	64,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	6	13	108	11,658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	12	—	—	—	エネルギー
ANALOG DEVICES	9	17	182	19,510	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	2	4	118	12,753	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	6	11	279	29,954	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	11	19	15	1,662	エネルギー
APPLE INC	115	192	5,530	592,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	24	40	214	22,978	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	9	20	45	4,918	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11	20	76	8,178	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	1	2	59	6,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	千米ドル	千円	
ASSURANT INC		2	4	49	5,332	保険
ATMOS ENERGY CORP		3	7	80	8,667	公益事業
AUTODESK INC		5	10	187	20,045	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC		3	4	26	2,807	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING		10	18	264	28,295	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC		0.67	0.94	91	9,844	小売
EVERY DENNISON CORP		3	5	60	6,444	素材
BB&T CORPORATION		18	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES COMPANY		14	38	51	5,525	エネルギー
BALL CORP		9	14	100	10,751	素材
BANK OF AMERICA CORP		227	363	862	92,490	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		23	35	129	13,834	各種金融
BAXTER INTL INC		11	22	199	21,376	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO		6	12	308	33,056	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP		5	8	50	5,366	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		31	56	1,091	117,003	各種金融
BEST BUY COMPANY INC		7	11	77	8,302	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		5	10	90	9,659	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC		5	8	285	30,585	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC		2	5	250	26,804	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		—	30	145	15,621	各種金融
H&R BLOCK INC		7	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO		13	24	340	36,526	資本財
BOOKING HOLDINGS INC		1	1	242	25,943	小売
BORGWARNER INC		7	11	30	3,228	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP		35	65	234	25,178	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		5	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		40	103	623	66,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS		3	6	65	7,015	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC		9	18	482	51,746	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		7	13	81	8,754	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B		10	—	—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC		3	6	63	6,808	各種金融
CBRE GROUP INC - A		10	18	82	8,875	不動産
CDK GLOBAL INC		4	7	28	3,028	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE		4	7	84	9,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		—	15	45	4,847	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC		4	7	50	5,394	運輸
CIGNA CORP		9	16	310	33,283	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC		8	15	300	32,211	各種金融
CMS ENERGY CORP		8	14	90	9,750	公益事業
CSX CORP		18	31	198	21,268	運輸
CVS HEALTH CORPORATION		31	55	344	36,929	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP		11	20	40	4,389	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC		—	14	107	11,518	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO		6	9	49	5,280	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		12	18	102	11,038	各種金融
CARDINAL HEALTH INC		8	15	77	8,263	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC		5	9	60	6,501	小売
CARNIVAL CORP		9	27	34	3,647	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP		—	34	47	5,143	資本財
CATERPILLAR INC		14	22	265	28,426	資本財
CELANESE CORP-SERIES A		4	6	56	6,013	素材
CELGENE CORP		17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千米ドル	千円	
CENTENE CORP	10	27	182	19,571	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	14	31	54	5,808	公益事業
CERNER CORP	8	12	89	9,570	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4	6	319	34,264	メディア・娯楽
CHEVRONTEXACO CORP	46	81	686	73,581	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	0.68	1	93	10,016	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	7	12	87	9,378	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	3	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4	8	71	7,664	保険
CISCO SYSTEMS INC	109	179	766	82,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	2	3	69	7,479	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	60	94	427	45,852	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14	27	55	5,981	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	4	6	93	9,969	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	3	5	110	11,874	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY	95	172	842	90,330	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	6	9	42	4,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13	23	125	13,485	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	19	34	250	26,892	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	112	195	751	80,556	メディア・娯楽
COMERICA INC	5	12	37	4,029	銀行
CONAGRA BRANDS INC	14	23	77	8,286	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	4	9	50	5,369	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	27	43	148	15,870	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	6	13	124	13,361	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4	7	131	14,066	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	1	2	78	8,405	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	6	9	69	7,487	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	7	77	8,342	ソフトウェア・サービス
CORNING INC	18	32	66	7,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	33	89	9,595	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	10	18	590	63,332	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	1	1	99	10,714	商業・専門サービス
CUMMINS INC	3	4	69	7,462	資本財
DR HORTON INC	10	16	66	7,119	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	3	9	99	10,636	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	7	22	35	3,758	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	15	27	422	45,266	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	3	7	47	5,072	消費者サービス
DAVITA INC	5	6	46	5,030	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	7	12	176	18,905	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	7	15	62	6,740	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	15	23	21	2,303	エネルギー
DEXCOM INC	—	5	147	15,853	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO	43	78	830	89,027	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8	18	64	6,961	各種金融
DISCOVERY INC-A	5	14	31	3,360	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	10	22	45	4,907	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION	—	17	39	4,213	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD	1	3	63	6,835	保険
Dollar General Corp	6	11	201	21,585	小売
DOLLAR TREE INC	5	11	93	9,999	小売
DOMINION ENERGY INC	17	35	289	31,067	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	1	2	72	7,794	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千米ドル	千円	
DOVER CORP	4	7		7,191	資本財
DOW INC	18	33	118	12,699	素材
DOWDUPONT INC	55	—	—	—	素材
DUKE ENERGY CORP	16	30	278	29,819	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	—	37	142	15,252	素材
EOG RESOURCES INC	13	23	99	10,659	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORP	8	16	65	7,035	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	—	2	47	5,098	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4	12	45	4,874	消費者サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	8	23	2,516	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4	6	38	4,175	素材
EBAY INC	22	30	110	11,802	小売
ECOLAB INC	5	11	208	22,343	素材
BUNGE LIMITED	4	11	44	4,804	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	7	15	93	10,040	公益事業
Edwards Lifesciences Corp	5	9	207	22,241	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	7	14	159	17,086	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	14	20	104	11,223	資本財
ENTERGY CORP	5	9	96	10,292	公益事業
EQUIFAX INC	3	6	81	8,722	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	31	51	5,526	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	14	64	6,951	公益事業
EVERGY INC	6	13	81	8,734	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	6	14	136	14,655	公益事業
EXELON CORP	21	41	160	17,206	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	3	9	56	6,012	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	5	9	64	6,902	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	101	178	757	81,234	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	5	9	34	3,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	58	105	1,880	201,522	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	2	56	6,103	各種金融
FASTENAL CO	7	21	73	7,914	資本財
FEDEX CORP	6	10	134	14,424	運輸
F5 NETWORKS INC	2	4	58	6,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	6	28	354	38,038	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8	12	35	3,802	保険
FIFTH THIRD BANCORP	20	38	65	7,029	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4	8	79	8,549	銀行
FISERV INC	9	27	262	28,161	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	12	23	105	11,316	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2	3	81	8,773	ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	6	—	—	—	資本財
FLOWSERVE CORP	5	8	22	2,381	資本財
FORD MOTOR CO	92	154	81	8,738	自動車・自動車部品
FORTINET INC	4	8	97	10,442	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	7	14	90	9,717	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5	7	35	3,808	資本財
FOX CORP-CLASS A	10	18	49	5,304	メディア・娯楽
FOX CORP-CLASS B	6	15	39	4,198	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	10	13	22	2,403	各種金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5	9	78	8,412	保険
GARTNER INC	2	6	65	7,019	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	5	10	142	15,274	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	216	383	265	28,499	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	千米ドル	千円	
GENERAL MILS INC	14	25	152	16,298	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	31	52	119	12,807	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	3	8	60	6,510	小売
GILEAD SCIENCES INC	31	57	450	48,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	4	14	214	23,017	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	6	50	5,420	保険
GODADDY INC - CLASS A	5	11	70	7,540	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8	13	245	26,323	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11	—	—	—	自動車・自動車部品
WW GRAINGER INC	1	2	58	6,319	資本財
HCA HEALTHCARE INC	7	12	143	15,379	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	12	39	4,232	資本財
HP INC	38	65	104	11,195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	19	34	26	2,861	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	6	9	18	2,034	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	2	—	—	—	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10	15	64	6,964	保険
HASBRO INC	3	7	57	6,161	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE	3	—	—	—	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2	4	75	8,048	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE	—	7	102	10,963	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	7	14	56	6,040	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	37	63	66	7,098	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	6	12	84	9,079	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	5	9	22	2,434	エネルギー
HOME DEPOT INC	27	46	959	102,873	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	17	29	419	44,949	資本財
HORMEL FOODS CORP	9	14	68	7,393	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	3	5	193	20,724	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3	5	53	5,707	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	32	64	54	5,800	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	2	47	5,110	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	2	4	85	9,208	メディア・娯楽
IDEX CORP	—	4	60	6,440	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	2	3	98	10,514	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	7	12	196	21,008	資本財
ILLUMINA INC	3	7	215	23,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	5	11	102	10,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	20	54	5,812	資本財
INGREDION INC	2	5	40	4,387	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	110	188	1,142	122,423	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	12	25	218	23,386	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	21	36	453	48,567	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	4	60	6,518	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	10	17	59	6,330	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	14	30	49	5,282	メディア・娯楽
INTUIT INC	6	11	294	31,593	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	2	5	278	29,888	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	4	9	115	12,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	79	134	1,285	137,813	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4	7	61	6,637	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	12	19	26	2,879	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	64	113	1,654	177,284	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	—	19	43	4,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KLA CORPORATION	4	7	124	13,364	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO	7	12	77	8,291	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	31	61	68	7,308	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	5	8	84	9,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	8	15	215	23,107	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	51	91	138	14,807	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6	9	31	3,405	運輸
KOHL'S CORP	5	8	15	1,646	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	14	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	19	35	113	12,168	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	10	17	37	4,028	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	2	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	10	197	21,177	資本財
LAM RESEARCH CORP	3	7	191	20,532	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	9	16	80	8,619	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5	10	166	17,861	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	—	3	27	2,950	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	5	9	27	2,905	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	4	7	71	7,631	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	8	15	65	7,017	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	1	40	4,292	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	3	6	83	8,978	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6	13	46	4,957	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	20	37	571	61,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	6	11	36	3,878	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	6	11	422	45,252	資本財
LOEWS CORP	8	14	55	5,947	保険
LOWE'S COMPANIES	19	33	334	35,900	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	2	5	115	12,337	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	3	3	41	4,454	銀行
MSCI INC	2	3	120	12,899	各種金融
MANPOWERGROUP	2	2	16	1,768	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	25	43	18	1,958	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	17	30	80	8,673	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	10	21	215	23,095	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7	13	114	12,273	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	3	61	6,576	素材
MASCO CORP	9	14	58	6,282	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	22	38	1,042	111,739	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7	13	73	7,902	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3	5	86	9,293	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	18	32	590	63,281	消費者サービス
MCKESSON CORP	4	7	106	11,375	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	1	2	113	12,167	小売
MERCK & CO. INC.	63	110	918	98,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	19	26	90	9,712	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	0.73	1	88	9,459	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	176	314	5,470	586,310	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	13	107	11,478	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	28	51	244	26,183	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	2	3	17	1,921	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	2	4	33	3,609	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	6	10	50	5,380	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	33	60	332	35,603	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MONSTER BEVERAGE CORP	9	17	115	12,357	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	4	8	195	20,998	各種金融
MORGAN STANLEY	33	52	208	22,330	各種金融
MOSAIC CO/THE	12	35	43	4,693	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4	7	118	12,658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NATIONAL OILWELL VARCO INC	12	18	21	2,330	エネルギー
NETAPP INC	7	11	48	5,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	10	19	811	87,008	メディア・娯楽
NEWELL BRANDS INC	14	23	32	3,524	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	12	39	235	25,233	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	16	33	31	3,352	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	11	21	511	54,866	公益事業
NIKE INC -CL B	30	52	461	49,462	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	11	22	60	6,470	公益事業
NOBLE ENERGY INC	14	27	20	2,177	エネルギー
NORDSTROM INC	4	7	15	1,695	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	6	11	176	18,898	運輸
NORTHERN TRUST CORP	4	9	82	8,857	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	4	6	231	24,785	資本財
NORTONLIFELOCK INC	—	31	59	6,372	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	9	18	69	7,482	素材
NVIDIA CORP	14	26	740	79,401	半導体・半導体製造装置
OG E ENERGY CORP	6	12	40	4,344	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2	3	107	11,496	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	18	—	—	—	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	—	4	64	6,925	運輸
ONEOK INC	10	23	72	7,717	エネルギー
ORACLE CORPORATION	63	99	538	57,703	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	17	79	8,508	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11	18	179	19,264	銀行
PPG INDUSTRIES INC	4	10	93	10,054	素材
PPL CORPORATION	16	30	81	8,714	公益事業
PVH CORP	2	4	21	2,282	耐久消費財・アパレル
PACCAR INC	7	12	83	8,972	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	3	5	44	4,799	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	2	4	87	9,426	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	3	6	86	9,321	資本財
PAYCHEX INC	6	11	76	8,251	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	27	50	557	59,728	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14	29	34	3,733	銀行
PEPSICO INC	33	59	819	87,785	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	141	237	864	92,626	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	37	67	519	55,679	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	10	16	100	10,773	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	3	7	63	6,814	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4	8	66	7,148	エネルギー
POLARIS INC	2	3	19	2,110	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	5	9	101	10,903	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8	14	46	5,009	保険
PROCTER & GAMBLE CO	59	106	1,293	138,629	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	13	25	205	22,001	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9	13	81	8,788	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11	20	111	11,951	公益事業
PULTE HOMES INC	9	14	36	3,864	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
QUALCOMM INC	29	50	390	41,825	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	4	7	69	7,455	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC-A	15	—	—	—	小売
RALPH LAUREN CORP	1	3	24	2,615	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	7	48	5,227	各種金融
RAYTHEON COMPANY	6	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	62	408	43,811	資本財
RED HAT INC	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
Regeneron Pharmaceuticals Inc	2	3	196	21,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	31	49	50	5,410	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	3	33	3,555	保険
REPUBLIC SERVICES INC	5	7	61	6,644	商業・専門サービス
RESMED INC	4	7	125	13,454	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	4	4	17	1,887	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	2	4	73	7,829	資本財
ROLLINS INC	5	10	37	4,060	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	2	4	130	13,978	資本財
ROSS STORES INC	8	16	148	15,892	小売
S&P GLOBAL INC	6	10	299	32,073	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	4	7	36	3,915	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7	14	74	7,960	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	1	2	47	5,089	銀行
SALESFORCE.COM INC	19	37	596	63,911	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	30	53	83	8,949	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	29	52	190	20,429	各種金融
SEALED AIR CORP	5	12	35	3,831	素材
SEATTLE GENETICS INC	3	6	83	8,902	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	5	12	160	17,180	公益事業
SERVICENOW INC	4	9	273	29,334	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2	3	170	18,272	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5	8	84	9,025	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP	—	6	27	2,929	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3	5	62	6,651	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	—	2	33	3,561	資本財
SOUTHERN CO	23	44	263	28,190	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	5	11	41	4,413	運輸
SPLUNK INC	4	7	105	11,325	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	8	18	117	12,588	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	3	7	91	9,856	資本財
STARBUCKS CORP	30	51	376	40,403	消費者サービス
STATE STREET CORP	9	14	89	9,620	各種金融
STRYKER CORP	8	15	273	29,268	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	10	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	17	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	4	8	121	12,988	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	17	30	47	5,117	各種金融
SYSCO CORP	10	22	109	11,704	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8	15	56	6,096	各種金融
TJX COMPANIES INC	29	52	262	28,145	小売
T-MOBILE US INC	7	16	146	15,676	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3	6	84	9,066	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	9	16	24	2,653	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	12	22	245	26,345	小売
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	2	67	7,232	資本財

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TELEFLEX INC	1	2	81	8,725	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC	3	6	445	47,705	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	22	40	447	48,006	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	8	10	29	3,156	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10	17	586	62,824	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	13	24	364	39,103	資本財
TIFFANY & CO	3	5	72	7,752	小売
TORCHMARK CORP	3	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3	6	58	6,286	小売
TRANSDIGM GROUP INC	1	2	71	7,706	資本財
TRANSUNION	5	9	68	7,311	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	5	10	109	11,762	保険
TRIMBLE INC	8	17	57	6,140	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	3	13	24	2,581	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	—	61	206	22,111	銀行
TWITTER INC	17	39	111	11,903	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	7	14	89	9,563	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	34	66	239	25,639	銀行
ULTA BEAUTY INC	1	3	74	7,997	小売
UNION PACIFIC CORP	17	29	437	46,925	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	16	29	304	32,593	運輸
UNITED RENTALS INC	2	4	53	5,693	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	19	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	23	40	1,106	118,578	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2	4	50	5,394	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	7	10	16	1,799	保険
VF CORP	7	14	84	9,079	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	1	2	39	4,200	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	10	18	92	9,878	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2	4	56	6,027	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3	6	108	11,591	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	3	5	109	11,782	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	99	176	1,024	109,785	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	2	6	97	10,503	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6	12	317	34,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	12	—	—	—	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B	—	39	63	6,844	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	42	73	1,278	136,999	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	2	5	70	7,597	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	5	11	50	5,387	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	3	7	78	8,450	素材
WABCO HOLDINGS INC	1	2	35	3,855	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	6	14	142	15,266	公益事業
WABTEC CORP/DE	4	10	57	6,171	資本財
WALMART INC	34	59	773	82,874	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19	31	146	15,673	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	4	11	97	10,428	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	8	17	174	18,719	商業・専門サービス
WATERS CORP	2	3	65	7,036	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & COMPANY	107	168	509	54,588	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	8	15	71	7,615	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	15	24	49	5,302	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
WESTROCK CO	8	14	45	4,856	素材	
WHIRLPOOL CORP	2	3	35	3,760	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	30	54	95	10,185	エネルギー	
WORKDAY INC-CLASS A	3	8	130	14,031	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY INC-CLASS A	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
XCEL ENERGY INC	11	22	150	16,139	公益事業	
XILINX INC	6	11	95	10,231	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	9	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	5	9	66	7,138	資本財	
XEROX HOLDINGS CORP	—	10	19	2,140	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUM! BRANDS INC	7	12	97	10,463	消費者サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	2	54	5,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4	10	119	12,819	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	12	22	286	30,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	14	23	23	2,503	各種金融	
CHUBB LTD	10	19	239	25,668	保険	
LyondellBasell Industries NV	7	11	65	6,970	素材	
GARMIN LTD	3	7	60	6,441	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	14	26	471	50,566	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8	13	126	13,609	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	8	11	58	6,256	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	5	—	—	—	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	7	14	100	10,761	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND PLC	5	—	—	—	資本財	
APTIV PLC	6	13	82	8,874	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	10	15	126	13,588	資本財	
IHS MARKIT LTD	8	20	133	14,314	商業・専門サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3	5	115	12,415	保険	
TECHNIPFMC PLC	14	28	24	2,581	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5	13	46	4,949	資本財	
PERRIGO CO PLC	4	7	41	4,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMCOR PLC	—	85	77	8,328	素材	
CAPRI HOLDINGS LTD	5	14	20	2,163	耐久消費財・アパレル	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	9	88	9,479	資本財	
AON PLC	—	9	188	20,255	保険	
PENTAIR PLC	6	9	29	3,162	資本財	
MEDTRONIC PLC	31	57	583	62,530	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	16	27	44	4,798	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11	—	—	—	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22	29	89	9,586	資本財	
ALLERGAN PLC	8	14	273	29,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7	15	66	7,089	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC	13	23	450	48,283	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6	8	24	2,595	保険	
小 計	株 数	金 額	7,017	12,561	104,049	11,151,986
銘柄 数 < 比 率 >	481	490	—	—	—	<66.4%>
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	20	—	—	—	—	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	5	15	115	8,937	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	11	39	141	10,943	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	6	10	63	4,930	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	14	26	196	15,156	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	27	50	280	21,666	銀行	
BARRICK GOLD CORP	37	81	275	21,259	素材	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	22	65	310	23,956	各種金融
CAE INC	10	18	36	2,850	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6	10	47	3,631	素材
CGI INC	7	10	86	6,680	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP	16	35	46	3,559	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9	18	153	11,817	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17	30	329	25,444	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	30	58	107	8,296	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3	6	200	15,437	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2	4	40	3,102	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6	11	40	3,152	公益事業
CENOVUS ENERGY INC	33	58	21	1,620	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.58	0.93	122	9,469	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	11	16	69	5,354	小売
ENCANA CORP	50	—	—	—	エネルギー
ENBRIDGE INC	50	89	365	28,220	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	—	1	63	4,872	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	10	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	11	—	—	—	不動産
FORTIS INC	13	22	123	9,534	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	4	8	153	11,860	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7	13	29	2,290	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	27	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	11	25	58	4,500	保険
HUSKY ENERGY INC	19	46	20	1,581	エネルギー
HYDRO ONE LTD	14	26	69	5,351	公益事業
IGM FINANCIAL INC	6	11	27	2,150	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	10	14	24	1,919	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	4	8	114	8,863	保険
INTER PIPELINE LTD	14	38	39	3,024	エネルギー
KEYERA CORP	8	22	35	2,756	エネルギー
LOBLAW COMPANIES LTD	6	12	92	7,114	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	9	12	62	4,823	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	51	71	125	9,646	保険
METRO INC	8	16	97	7,493	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	10	20	110	8,493	銀行
NUTRIEN LTD	15	24	121	9,406	素材
OPEN TEXT CORP	9	18	94	7,301	ソフトウェア・サービス
OVINTIV INC	—	14	8	690	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	13	35	99	7,659	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	12	38	82	6,348	保険
POWER FINANCIAL CORP	10	—	—	—	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10	20	17	1,353	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	7	16	100	7,760	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	9	19	115	8,890	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	33	59	518	39,973	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	7	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	8	12	44	3,433	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15	30	69	5,391	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	—	5	347	26,775	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	14	18	86	6,691	保険
SUNCOR ENERGY INC	42	65	148	11,414	エネルギー
TC ENERGY CORP	—	42	286	22,060	エネルギー
TELUS CORP	3	16	37	2,873	電気通信サービス

銘柄	株数	当期			業種等	
		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		
THOMSON REUTERS CORP	6	10	105	8,126	商業・専門サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	41	76	447	34,493	銀行	
TRANSCANADA CORP	23	—	—	—	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	7	—	—	—	エネルギー	
WESTON (GEORGE) LTD	3	4	50	3,910	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13	24	115	8,940	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	961	1,586	7,200	555,265	
(ユーロ…ドイツ)	63	58	—	—	<3.3%>	
			千ユーロ			
ADIDAS AG	4	7	169	19,964	耐久消費財・アパレル	
Presenius SE & CO KG	10	17	69	8,142	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5	8	26	3,090	電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	3	6	23	2,708	素材	
HANNOVER RUECK SE	2	3	53	6,293	保険	
GEA GROUP AG	6	11	24	2,845	資本財	
CONTINENTAL AG	3	5	40	4,753	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG	21	37	97	11,446	運輸	
AXEL SPRINGER SE	3	—	—	—	メディア・娯楽	
MERCK KGAA	4	6	67	7,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	14	25	65	7,751	公益事業	
SAP SE	22	41	466	54,931	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	50	89	78	9,284	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	3	7	51	6,069	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA AG	0.33	5	35	4,125	耐久消費財・アパレル	
BAYER AG	23	42	251	29,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	3	4	35	4,162	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	20	35	164	19,345	素材	
BEIERSDORF AG	3	6	59	7,046	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	—	7	33	3,965	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	6	9	58	6,832	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE	9	17	287	33,859	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	10	16	14	1,748	運輸	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3	5	109	12,883	保険	
VOLKSWAGEN AG	1	2	39	4,692	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG PFD	4	6	78	9,278	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	23	37	111	13,149	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG	17	31	260	30,712	資本財	
DEUTSCHE BANK AG -REG	60	103	64	7,551	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8	12	63	7,503	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	74	140	176	20,736	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	27	59	100	11,875	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	4	8	112	13,255	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	—	7	35	4,190	自動車・自動車部品	
WIRECARD AG	3	6	76	8,983	ソフトウェア・サービス	
LANXESS	3	5	24	2,871	素材	
MTU AERO ENGINES AG	1	3	40	4,726	資本財	
SYMRISE AG	3	7	69	8,237	素材	
BRENTAG AG	5	6	25	2,946	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	6	9	21	2,523	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	35	117	30	3,588	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	38	71	24	2,849	銀行	
VONOVIA SE	12	25	113	13,408	不動産	
PROSIEBENSAT1 MEDIA SE	12	—	—	—	メディア・娯楽	

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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
METRO AG	8	17	13	1,563	食品・生活必需品小売り	
INNOGY SE	4	—	—	—	公益事業	
COVESTRO AG	6	6	18	2,177	素材	
UNIPER SE	6	11	27	3,189	公益事業	
DELIVERY HERO SE	4	7	47	5,537	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額	614	1,128	3,859	454,345	
	銘柄 数 < 比 率 >	48	46	—	< 2.7% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	30	34	45	5,379	保険	
INTESA SANPAOLO	404	712	100	11,796	銀行	
MEDIOBANCA SPA	26	61	32	3,855	銀行	
ENEL SPA	203	356	229	27,068	公益事業	
ENI SPA	64	89	82	9,682	エネルギー	
ATLANTIA S. P. A	15	32	42	5,052	運輸	
TERNA SPA	50	86	47	5,645	公益事業	
RECORDATI SPA	4	9	36	4,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONCLER SPA	6	11	39	4,697	耐久消費財・アパレル	
FINECOBANK SPA	—	41	39	4,709	銀行	
UNICREDIT SPA	56	111	78	9,284	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	22	46	39	4,599	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	24	52	34	4,108	食品・飲料・タバコ	
PIRELLI & C SPA	25	—	—	—	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	937	1,647	850	100,178	
	銘柄 数 < 比 率 >	13	13	—	< 0.6% >	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	7	12	36	4,282	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	17	27	52	6,207	公益事業	
L'OREAL	5	10	260	30,671	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6	11	420	49,563	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	3	5	38	4,481	資本財	
CAPGEMINI	4	6	54	6,458	ソフトウェア・サービス	
MICHELIN (CGDE)-B	3	6	52	6,215	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	4	8	119	14,085	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	5	10	18	2,137	自動車・自動車部品	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12	22	184	21,713	資本財	
VIVENDI SA	26	37	78	9,249	メディア・娯楽	
ORANGE	41	74	86	10,205	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	0.79	1	96	11,406	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	3	6	79	9,337	ソフトウェア・サービス	
KERING	1	3	171	20,217	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	8	20	18	2,191	保険	
CARREFOUR SA	—	34	49	5,810	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	2	4	28	3,385	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	26	49	409	48,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	7	12	34	4,008	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE-A	19	35	52	6,180	銀行	
TELEPERFORMANCE	1	3	65	7,695	商業・専門サービス	
SODEXO	2	6	41	4,928	消費者サービス	
AXA	41	72	112	13,202	保険	
PEUGEOT SA	17	26	32	3,870	自動車・自動車部品	
ESSILORLUXOTTICA	5	12	135	15,991	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	36	60	41	4,847	銀行	
BNP PARIBAS	27	45	127	15,001	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	13	21	53	6,317	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		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
Wendel	1	2	19	2,284	各種金融	
Iliad SA	1	—	—	—	電気通信サービス	
IMERYS SA	3	—	—	—	素材	
SAFRAN SA	7	15	122	14,479	資本財	
ENGIE	43	67	65	7,737	公益事業	
ALSTOM	6	13	51	6,059	資本財	
Eutelsat Communications	8	15	15	1,867	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	21	40	31	3,765	公益事業	
Legrand SA	6	8	51	6,080	資本財	
Eiffage SA	2	4	35	4,139	資本財	
TOTAL SA	56	98	323	38,031	エネルギー	
Aeroports de Paris	1	2	21	2,586	運輸	
Natixis	38	68	14	1,730	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2	6	44	5,207	メディア・娯楽	
SCOR SE	5	7	16	1,886	保険	
VINCI S. A.	10	21	168	19,799	資本財	
DANONE	12	25	155	18,253	食品・飲料・タバコ	
ATR LIQUIDE	9	18	235	27,702	素材	
Bureau Veritas SA	10	15	28	3,398	商業・専門サービス	
GETLINK SE	18	35	39	4,675	運輸	
SUEZ	15	24	24	2,850	公益事業	
EDENRED	7	13	52	6,226	ソフトウェア・サービス	
VALEO SA	9	10	17	2,038	自動車・自動車部品	
WORLDDLINE SA	—	8	51	6,110	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数	金 額	662	1,176	4,542	534,772
銘柄 数 < 比 率 >	51	51	—	< 3.2% >		
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	14	26	156	18,450	資本財	
RANDSTAD NV	4	6	20	2,417	商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER	6	9	62	7,326	商業・専門サービス	
Koninklijke Vopak NV	3	5	27	3,231	エネルギー	
AEGON NV	65	99	23	2,804	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	107	194	43	5,064	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	23	39	87	10,305	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	22	39	150	17,696	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	6	9	73	8,683	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	3	7	49	5,863	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	5	7	80	9,509	素材	
UNILEVER NV-CVA	36	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
UNILEVER NV	—	60	281	33,155	家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	10	19	504	59,412	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	28	43	97	11,484	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	—	5	78	9,225	自動車・自動車部品	
AKZO NOBEL	5	8	57	6,748	素材	
PROSUS NV	—	22	139	16,429	小売	
NN GROUP NV	—	19	47	5,579	保険	
QIAGEN N V	7	14	51	6,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV /WI	—	0.59	46	5,426	ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	103	170	87	10,269	銀行	
小 計	株 数	金 額	452	810	2,167	255,183
銘柄 数 < 比 率 >	17	21	—	< 1.5% >		
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	10	18	36	4,262	公益事業	
Bankinter SA	30	56	20	2,381	銀行	

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		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	158	244	71	8,451	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	11	15	24	2,851	公益事業	
REPSOL SA	26	76	61	7,252	エネルギー	
BANCO SANTANDER S.A	394	674	142	16,834	銀行	
TELEFONICA SA	97	180	78	9,196	電気通信サービス	
ENAGAS SA	9	10	21	2,487	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7	12	26	3,075	資本財	
FERROVIAL SA	16	29	72	8,500	資本財	
MAPFRE S.A.	55	109	19	2,253	保険	
CaixaBank SA	110	219	37	4,357	銀行	
IBERDROLA SA	135	253	230	27,123	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	9	16	84	9,931	ソフトウェア・サービス	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13	16	25	3,029	公益事業	
INDITEX	24	40	105	12,450	小売	
AENA SME SA	1	3	47	5,621	運輸	
CELLNEX TELECOM SAU	—	14	65	7,751	電気通信サービス	
GRIFOLS SA	10	18	55	6,499	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 銘柄 数 < 比 率 >	1,123 18	2,010 19	1,225 —	144,312 < 0.9% >	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	6	10	49	5,798	銀行	
SOLVAY SA	2	3	26	3,177	素材	
UCB SA	4	6	55	6,488	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	2	3	20	2,415	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2	5	41	4,902	各種金融	
AGEAS	5	9	31	3,669	保険	
UMICORE	6	12	45	5,303	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	18	29	127	14,971	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	50 8	81 8	396 —	46,727 < 0.3% >	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	5	12	38	4,482	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	9	21	39	4,687	銀行	
ANDRITZ AG	3	6	20	2,409	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	18 3	40 3	98 —	11,579 < 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	18	23	14	1,668	エネルギー	
SES SA	11	23	13	1,590	メディア・娯楽	
AROUNDTOWN SA	—	93	47	5,615	不動産	
ARCELORMITTAL	21	49	46	5,433	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	51 3	190 4	121 —	14,308 < 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA	15	17	11	1,412	資本財	
UPM-KYMMENE OYJ	14	18	46	5,421	素材	
STORA ENSO OYJ-R SHS	22	22	22	2,696	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	7	15	44	5,251	保険	
FORTUM OYJ	—	21	33	3,914	公益事業	
ELISA OYJ	5	7	43	5,116	電気通信サービス	
NOKIA OYJ	135	245	75	8,913	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OYJ	11	17	51	6,111	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4	7	14	1,670	自動車・自動車部品	
KONE OYJ-B	7	12	65	7,665	資本財	

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	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ORION OYJ	4	6	27	3,230	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 銘柄数<比率>	227 10	391 11	436 —	51,405 <0.3%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC(DUBLIN)	21	33	86	10,164	素材
KINGSPAN GROUP PLC	—	8	35	4,232	資本財
KERRY GROUP PLC-A	4	6	68	8,097	食品・飲料・タバコ
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2	4	38	4,512	消費者サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC	10	—	—	—	運輸
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	38 4	52 4	229 —	27,006 <0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	80	146	54	6,422	公益事業
Galp Energia SGPS SA	17	21	21	2,569	エネルギー
JERONIMO MARTINS	11	14	22	2,610	食品・生活必需品小売り
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	109 3	182 3	98 —	11,601 <0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,285 178	7,711 183	14,027 —	1,651,422 <9.8%>
(イギリス)			千英ポンド		
ASHTREAD GROUP PLC	16	29	56	7,582	資本財
AVIVA PLC	84	132	34	4,605	保険
DIAGEO PLC	56	96	253	34,250	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	5	9	23	3,149	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	70	132	70	9,493	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	56	99	291	39,460	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	73	126	53	7,242	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	21	36	59	8,036	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	471	866	370	50,100	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	106	266	55	7,448	保険
MEGGITT PLC	31	68	18	2,442	資本財
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	90	193	35	4,777	食品・生活必需品小売り
Associated British Foods PLC	11	19	38	5,263	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC	—	15	29	4,049	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	60	108	110	14,906	保険
RIO TINTO PLC	29	50	194	26,353	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	—	45	37	5,066	各種金融
SSE PLC	28	42	52	7,041	公益事業
BP PLC	477	871	279	37,839	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,773	2,885	91	12,400	銀行
TESCO PLC	233	430	101	13,683	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	22	40	61	8,343	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	120	219	344	46,592	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	10	19	17	2,359	資本財
ASTRAZENECA PLC	31	58	448	60,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	188	332	41	5,580	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	5	15	14	1,953	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	60	103	11	1,488	小売
BARCLAYS PLC	439	692	64	8,761	銀行
INTERTEK GROUP PLC	4	9	45	6,166	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	13	15	22	3,097	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	4	5	28	3,832	小売
KINGFISHER PLC	84	110	16	2,222	小売
ITV PLC	150	247	17	2,429	メディア・娯楽

銘柄	株数	当期			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
SAINSBURY (J) PLC	76	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC	70	153	16	2,195	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	8	12	27	3,705	保険	
CENTRICA PLC	174	334	11	1,500	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	104	168	243	32,972	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	91	167	238	32,257	エネルギー	
BUNZL PLC	10	18	32	4,329	資本財	
RENTOKIL INITIAL PLC	—	126	51	6,930	商業・専門サービス	
London Stock Exchange Group PLC	7	15	108	14,702	各種金融	
UNILEVER PLC	25	47	198	26,826	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	17	38	87	11,832	商業・専門サービス	
MONDI PLC	13	21	29	3,929	素材	
SEVERN TRENT PLC	9	15	35	4,855	公益事業	
Whitbread PLC	5	7	21	2,972	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11	18	28	3,915	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	14	25	31	4,193	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	29	49	71	9,706	素材	
3I GROUP PLC	—	56	42	5,717	各種金融	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	16	30	198	26,793	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	43	80	142	19,283	商業・専門サービス	
Fresnillo PLC	13	—	—	—	素材	
GLENCORE PLC	296	477	68	9,240	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	41	—	—	—	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	149	298	34	4,636	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	37	57	36	4,896	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	37	72	41	5,629	メディア・娯楽	
COMPASS GROUP PLC	34	66	83	11,262	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	78	143	128	17,388	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	40	—	—	—	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	34	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	81	131	29	3,939	各種金融	
FERGUSON PLC	6	—	—	—	資本財	
BHP GROUP PLC	55	86	113	15,324	素材	
VODAFONE GROUP PLC	643	1,193	133	18,067	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5	12	41	5,629	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	6	28	3,801	素材	
FERGUSON PLC	—	10	53	7,232	資本財	
M&G PLC	—	144	21	2,853	各種金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	37	43	16	2,186	保険	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	4	33	4,561	資本財	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	42	65	17	2,353	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4	—	—	—	素材	
MELROSE INDUSTRIES PLC	152	327	31	4,264	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	6	7	14	2,016	素材	
小計	株数・金額	7,367	12,937	5,934	802,528	
	銘柄数<比率>	70	71	—	<4.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA	0.16	0.22	49	5,535	商業・専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.1	0.2	39	4,355	食品・飲料・タバコ	
SWISSCOM AG-REG	0.75	1	70	7,865	電気通信サービス	
Lindt & Spruengli AG	—	0.07	55	6,246	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	0.18	0.32	103	11,501	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3	6	201	22,474	保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	52	91	756	84,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
ABB LTD	40	73	128	14,388	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	17	30	967	107,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG(REG)	5	5	23	2,639	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	11	19	74	8,313	素材	
CLARIANT AG-REG	9	14	25	2,894	素材	
NESTLE SA-REGISTERED	72	127	1,319	147,285	食品・飲料・タバコ	
Baloise Holding AG	—	2	40	4,536	保険	
TEMENOS GROUP AG-REG	2	4	54	6,121	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG	1	3	55	6,176	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.35	0.62	46	5,230	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG	71	124	104	11,712	各種金融	
THE SWATCH GROUP AG-B	1	1	39	4,435	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	2	3	161	18,055	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG	1	2	69	7,804	保険	
SWISS PRIME SITE	—	4	44	4,946	不動産	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.56	0.88	67	7,486	各種金融	
Schindler Holding AG	1	1	34	3,820	資本財	
Schindler Holding AG	1	1	33	3,697	資本財	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1	3	44	4,960	運輸	
GEBERIT AG-REG	0.92	1	63	7,078	資本財	
JULIUS BAER GROUP LTD	8	15	53	5,959	各種金融	
SWISS RE AG	6	12	99	11,120	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12	21	121	13,574	耐久消費財・アパレル	
SIKA AG-REG	3	5	94	10,557	素材	
ALCON INC	10	19	99	11,148	ヘルスケア機器・サービス	
UBS GROUP AG	100	159	151	16,919	各種金融	
小 計	株 数	金 額	441	763	5,296	591,220
銘柄 数 < 比 率 >	30	33	—	—	< 3.5% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	37	86	601	6,493	銀行	
Swedbank AB	19	39	440	4,762	銀行	
SWEDISH MATCH AB	5	9	541	5,845	食品・飲料・タバコ	
SECURITAS AB-B SHS	13	13	152	1,646	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	8	16	775	8,373	各種金融	
HENNES & MAURITZ AB-B	19	38	538	5,817	小売	
ERICSSON LM-B SHS	72	140	1,161	12,543	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA COMPANY AB	76	157	561	6,061	電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	12	19	325	3,517	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	7	11	242	2,623	エネルギー	
ALFA LAVAL AB	10	14	277	2,996	資本財	
Millicom International Cellular SA	3	6	192	2,078	電気通信サービス	
Husqvarna AB	18	32	171	1,851	耐久消費財・アパレル	
SKF AB-B SHARES	15	15	217	2,349	資本財	
VOLVO AB-B SHS	30	46	586	6,330	資本財	
SANDVIK AB	26	39	554	5,985	資本財	
Industrivarden AB	7	15	317	3,424	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	6	14	675	7,292	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELE2 AB-B SHS	17	33	470	5,076	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	9	—	—	—	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	15	23	790	8,534	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	12	24	751	8,120	資本財	
BOLIDEN AB	9	—	—	—	素材	
EPIROC AB-A	24	32	332	3,589	資本財	
EPIROC AB-B	18	22	230	2,484	資本財	

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	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	14	23	698	7,548	家庭用品・パーソナル用品	
BOLIDEN AB	—	18	384	4,156	素材	
KINNEVIK AB-B	—	14	282	3,055	各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	34	74	608	6,576	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	17	35	655	7,074	資本財	
NORDEA BANK ABP	61	118	689	7,443	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	626 29	1,139 29	14,227 —	153,654 <0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA	26	—	—	—	銀行	
TELENOR ASA	21	36	585	6,086	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	22	38	516	5,368	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	6	9	346	3,603	素材	
MOWI ASA	—	21	388	4,040	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	59	131	292	3,038	素材	
ORKLA ASA	25	38	353	3,672	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10	15	301	3,133	保険	
ADEVINTA ASA-B	5	—	—	—	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	5	11	224	2,337	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	182 9	303 8	3,010 —	31,279 <0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	3	6	525	8,298	食品・飲料・タバコ	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.23	0.33	217	3,436	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.14	0.2	122	1,934	運輸	
DANSKE BANK A/S	19	31	237	3,754	銀行	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5	9	548	8,652	資本財	
H LUNDBECK A/S	3	9	198	3,136	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV PANALPINA A/S	4	10	664	10,491	運輸	
PANDORA A/S	4	4	106	1,676	耐久消費財・アパレル	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	3	6	350	5,523	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	6	9	302	4,770	素材	
COLOPLAST-B	3	5	603	9,530	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	42	76	3,115	49,157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S	5	8	600	9,480	公益事業	
DEMANT A/S	4	9	152	2,412	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	106 14	188 14	7,747 —	122,255 <0.7%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	70	113	189	13,082	銀行	
AMCOR PLC-CDI	34	—	—	—	素材	
WESTPAC BANKING CORPORATION	82	144	235	16,188	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	—	71	82	5,695	素材	
TELSTRA CORP LTD	145	207	65	4,522	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26	41	39	2,740	食品・飲料・タバコ	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	6	11	91	6,279	各種金融	
BHP GROUP LIMITED	75	122	388	26,755	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12	14	35	2,421	エネルギー	
COMPUTERSHARE LIMITED	20	35	39	2,751	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	11	20	679	46,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	61	140	181	12,532	運輸	
COCHLEAR LIMITED	1	4	81	5,646	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	—	77	40	2,798	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	42	74	469	32,303	銀行	

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
RIO TINTO LIMITED	10	15	140	9,702	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	67	110	67	4,663	保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3	—	—	—	消費者サービス
ORICA LTD	17	31	54	3,757	素材
LENLEASE GROUP	23	28	33	2,305	不動産
SUNCORP GROUP LTD	42	75	70	4,846	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	63	122	202	13,975	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	20	41	120	8,268	素材
INCITEC PIVOT LTD	86	171	38	2,655	素材
AMP LIMITED	114	215	30	2,130	各種金融
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	42	63	57	3,984	保険
SANTOS LTD	57	97	44	3,068	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	15	34	84	5,807	ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED	78	166	49	3,396	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	27	40	151	10,436	小売
ALUMINA LTD	117	292	44	3,078	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	19	33	73	5,080	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	27	51	185	12,805	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	15	24	40	2,770	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	4	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LTD	45	81	89	6,168	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	8	14	148	10,201	各種金融
CROWN RESORTS LIMITED	18	—	—	—	消費者サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	—	45	48	3,361	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT	45	82	47	3,280	運輸
AGL ENERGY LTD	21	30	54	3,752	公益事業
SOUTH32 LTD	155	376	77	5,339	素材
COLES GROUP LTD	35	58	95	6,576	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,778 40	3,387 39	4,674 —	321,966 <1.9%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	22	33	38	2,516	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	—	41	76	5,027	食品・飲料・タバコ
SPARK NEW ZEALAND LTD	85	112	48	3,202	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	40	56	32	2,157	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	67	114	50	3,306	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	215 4	360 5	247 —	16,210 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15	28	223	3,094	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	64	144	247	3,426	銀行
CLP HOLDINGS LIMITED	45	70	569	7,870	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	32	55	1,371	18,970	各種金融
MTR CORPORATION	55	110	473	6,541	運輸
HANG SENG BANK	21	24	333	4,607	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	49	104	334	4,632	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	50	90	468	6,478	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	244	459	663	9,171	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	40	—	—	—	不動産
Galaxy Entertainment Group Limited	70	130	628	8,692	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	110	225	551	7,623	銀行
NWS HOLDINGS LTD	95	195	163	2,262	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45	80	104	1,444	耐久消費財・アパレル
SINO LAND CO	138	298	304	4,212	不動産

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			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	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	45	65	702	9,708	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A	20	45	230	3,192	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	50	85	487	6,735	資本財
AIA GROUP LTD	304	522	3,753	51,906	保険
HKT Trust / HKT Ltd	160	310	370	5,127	電気通信サービス
Sands China Ltd	80	156	471	6,515	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	50	126	275	3,807	不動産
WH Group Limited	310	550	426	5,902	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	73	123	714	9,880	資本財
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	30	55	262	3,632	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	73	118	570	7,892	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,269 26	4,168 25	14,702 -	203,332 <1.2%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	75	136	45	3,486	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	40	70	139	10,544	銀行
CITY DEVELOPMENTS	30	48	38	2,883	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	110	215	33	2,560	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	30	73	45	3,460	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	31	41	84	6,437	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD	30	59	40	3,047	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	90	218	33	2,513	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	217	349	98	7,465	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	79	113	103	7,816	銀行
KEPPEL CORP LTD	56	102	57	4,386	資本財
GENTING SINGAPORE LTD	290	521	38	2,944	消費者サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,078 12	1,945 12	758 -	57,546 <0.3%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM	37	86	175	5,250	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	51	102	189	5,672	銀行
ISRAEL CHEMICALS LTD	35	35	40	1,215	素材
NICE LTD	2	4	254	7,604	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7	18	119	3,580	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	133 5	246 5	780 -	23,323 <0.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	26,463 961	47,300 972	- -	15,681,992 <93.4%>

(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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	%	
AMERICAN TOWER CORP	1	1	506	54,245	0.3	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.301	0.543	90	9,720	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	0.359	0.556	58	6,297	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.309	0.66	57	6,154	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	0.983	1	299	32,089	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.507	1	167	17,950	0.1	
DUKE REALTY CORP	1	2	80	8,587	0.1	
EQUINIX INC	0.199	0.351	241	25,916	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	—	1	73	7,868	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	0.844	1	97	10,489	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.15	0.245	61	6,633	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.41	0.721	68	7,389	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.238	0.411	34	3,726	0.0	
HCP INC	1	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	2	68	7,381	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2	3	44	4,789	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	0.956	1	43	4,633	0.0	
KIMCO REALTY CORP	1	2	25	2,745	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.574	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	3	59	6,396	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.352	0.601	68	7,344	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	1	45	4,896	0.0	
PROLOGIS INC	1	3	280	30,108	0.2	
PUBLIC STORAGE	0.346	0.62	127	13,613	0.1	
REALTY INCOME CORP	0.747	1	83	8,974	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	0.488	0.962	42	4,531	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.309	0.474	143	15,373	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	0.3	0.445	23	2,508	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.763	1	72	7,820	0.0	
SUN COMMUNITIES INC	—	0.592	77	8,256	0.0	
UDR INC	0.883	1	60	6,488	0.0	
VENTAS INC	0.863	2	68	7,343	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	0.572	0.801	35	3,795	0.0	
WP CAREY INC	—	1	75	8,100	0.0	
WELLTOWER INC	0.971	1	102	11,001	0.1	
WEYERHAEUSER CO	1	3	61	6,569	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	23	48	3,449	369,744	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	34	—	<2.2%>	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.776	1	29	2,255	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.776	1	29	2,255	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	

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	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		0.728	1	18	2,168	0.0
GECINA SA		0.166	0.267	32	3,878	0.0
COVIVIO		0.19	0.366	21	2,553	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		0.307	0.682	40	4,714	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	2	113	13,315	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		3	5	21	2,945	0.0
HAMMERSON PLC		4	—	—	—	—
SEGRO PLC		3	6	50	6,800	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		2	4	26	3,641	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	14	15	99	13,387	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		13	22	51	3,517	0.0
GPT GROUP		6	8	35	2,439	0.0
STOCKLAND		8	14	41	2,828	0.0
DEXUS		—	5	54	3,781	0.0
GOODMAN GROUP		4	9	132	9,140	0.1
SCENTRE GROUP		16	21	45	3,108	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	50	82	360	24,814	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		6	7	517	7,157	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6	7	517	7,157	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		12	22	40	3,075	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	12	22	40	3,075	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	107	180	—	433,750	
	銘 柄 数 < 比 率 >	46	50	—	<2.6%>	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

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	株式先物取引	S&P 500 EMIN	百万円	百万円
		DJ EU STX 50	548	—
		FTSE 100 IDX	132	—
国			101	—

(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で邦貨換算したものです。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2019年11月11日）

（計算期間 2018年11月13日～2019年11月11日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
10期(2015年11月10日)	20,086	8.4	934,426	8.6	95.2	2.4	2.4	114,601
11期(2016年11月10日)	17,807	△11.3	829,736	△11.2	93.4	3.8	2.5	77,257
12期(2017年11月10日)	23,462	31.8	1,093,435	31.8	89.0	8.2	2.4	29,547
13期(2018年11月12日)	24,465	4.3	1,147,119	4.9	92.4	5.1	2.3	8,378
14期(2019年11月11日)	26,489	8.3	1,242,639	8.3	95.6	1.7	2.6	14,331

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値（TTM）を用いて計算しているため、基準日前日のMSCIコクサイ指数（米ドルベース）を基準日のTTMで委託会社が円換算したものを使用しています。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2018年11月12日	円 24,465	% -		% -	% 92.4	% 5.1	% 2.3
11月末	24,074	△ 1.6	1,127,410	△ 1.7	94.6	4.3	2.3
12月末	21,574	△11.8	1,009,334	△12.0	93.7	6.4	2.3
2019年1月末	22,967	△ 6.1	1,074,490	△ 6.3	93.6	6.0	2.6
2月末	24,346	△ 0.5	1,141,179	△ 0.5	95.6	3.6	2.5
3月末	24,533	0.3	1,149,448	0.2	96.7	2.4	2.6
4月末	25,639	4.8	1,201,501	4.7	94.3	5.3	2.5
5月末	24,012	△ 1.9	1,125,764	△ 1.9	96.9	2.3	2.7
6月末	24,859	1.6	1,166,662	1.7	97.9	2.1	2.7
7月末	25,548	4.4	1,198,358	4.5	97.5	2.3	2.7
8月末	24,291	△ 0.7	1,139,763	△ 0.6	97.7	2.5	2.9
9月末	25,093	2.6	1,176,491	2.6	97.9	2.3	2.8
10月末	26,085	6.6	1,221,957	6.5	98.2	1.8	2.8
(期 末) 2019年11月11日	26,489	8.3	1,242,639	8.3	95.6	1.7	2.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2018年11月13日～2019年11月11日)

■期中の基準価額等の推移

期首：24,465円

期末：26,489円

騰落率： 8.3%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・FRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和期待
- ・米中貿易協定の部分的合意および進展への期待

マイナス要因

- ・事前予想を下回る経済指標を受けた、世界的な景気減速懸念の高まり
- ・米中貿易摩擦の悪影響による世界経済の減速懸念の広がり

■投資環境

期初、FRB議長が利上げサイクルの早期終了を示唆したことから、外国株式市場は小幅に上昇しましたが、2018年の年末にかけては、中国の大手通信機器会社幹部の逮捕を受けた米中間の対立激化や、事前予想を下回る経済指標が相次いで発表されたことを受けて、下落基調で推移しました。

2019年の年初以降は、米中貿易交渉進展への期待が高まったほか、FRBが年内の利上げを見送る方針を示し、市場参加者の心理が改善したことから、外国株式市場は上昇基調で推移しました。

5月に入ると、米国の早期利下げ観測の後退や、トランプ米大統領による対中関税の引き上げ表明を受けて米中貿易摩擦激化への警戒感が高まったことから、外国株式市場は下落しました。6月以降は、7月末にFRBが2008年12月以来となる利下げを決定するまでは米国の金融緩和期待が相場を下支えしたものの、8月に入ると、中国による人民元安の容認などを受けて、米財務省が中国を「為替操作国」に指定し、米中貿易摩擦が一段と激化したことから下落しました。

9月以降は、米国ISM（供給管理協会）製造業景況感指数が低水準となり、景気減速懸念が強まったことなどが重石となる局面もあったものの、米中貿易協定が農産品や為替など特定分野で部分的に合意したほか、対中制裁関税の引き上げ先送りが発表されたことなどが好感されて、外国株式市場は上昇しました。

以上のような経緯を経て、外国株式市場は前期末対比で上昇しました。



(注) ベンチマークは、期首(2018年11月12日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークに連動する投資成果の達成を目標として運用を行いました。

個別銘柄の選択は、最適化手法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の974銘柄に対して、当期末には1,016銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は8.3%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+8.3%に対して、基準価額の騰落率は+8.3%となり、ベンチマークにほぼ連動しました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・配当課税の影響
- ・売買コストの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、過去1年で0.19%となりました。

※毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。ファンドとベンチマークで外貨建資産を円換算する際の為替レートが異なる点を考慮して、トラッキングエラーを算出しています。

○今後の運用方針

当ファンドの基本方針に基づき、外国株式指数先物も使用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年11月13日～2019年11月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 5	% 0.020	(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 * 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
(株 式)	(4)	(0.016)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.024	(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
(株 式)	(6)	(0.024)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	25	0.104	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(25)	(0.103)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	36	0.148	
期中の平均基準価額は、24,418円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(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を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2018年11月13日～2019年11月11日)

株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
	3,917 (152)	32,401 (632)	138 (139)	532 (1,000)
カナダ	580 (15)	千カナダドル 2,756 (-)	81	千カナダドル 146
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
ドイツ	413 (3)	1,496 (-)	27 (-)	93 (11)
イタリア	670	399	348 (4)	37 (25)
フランス	382 (4)	1,647 (30)	3 (0.01)	11 (5)
オランダ	297 (△ 0.51)	806 (-)	1 (-)	7 (3)
スペイン	565 (391)	522 (8)	382	10
ベルギー	25	172	-	-
オーストリア	14	54	- (-)	- (1)
ルクセンブルク	33	46	-	-
フィンランド	150 (8)	180 (0.55246)	0.92 (-)	0.52019 (0.55246)
アイルランド	27	82	12	12
ポルトガル	37	20	-	-
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	4,369 (86)	2,482 (15)	295 (-)	222 (21)
スイス		千スイスフラン		千スイスフラン
	239 (10)	1,694 (56)	10 (-)	11 (70)
スウェーデン		千スウェーデンクローネ		千スウェーデンクローネ
	320 (11)	4,195 (4)	11 (-)	4 (4)
ノルウェー		千ノルウェークローネ		千ノルウェークローネ
	110 (5)	1,216 (41)	5 (-)	42 (41)
デンマーク		千デンマーククローネ		千デンマーククローネ
	62 (0.74)	2,392 (38)	0.74 (-)	37 (38)
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	1,110 (18)	1,866 (27)	9 (39)	49 (84)
ニュージーランド	172	千ニュージーランドドル 126	-	千ニュージーランドドル -

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	香港	百株 1,634 (29)	千香港ドル 5,399 (-)	百株 430	千香港ドル 319
	シンガポール	494	千シンガポールドル 230	—	千シンガポールドル —
	イスラエル	13	千イスラエルシェケル 60	—	千イスラエルシェケル —

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	AMERICAN TOWER CORP	0.625	124	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.155	30	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	0.11	13	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.448	43	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	0.62	80	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.298	35	—	—
	DUKE REALTY CORP	0.594	18	—	—
	EQUINIX INC	0.14	67	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	0.841	58	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	0.516	40	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.271	75	0.026	7
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.249	26	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.128	17	—	—
	HCP INC	0.463	14	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1	27	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	0.421	14	—	—
	KIMCO REALTY CORP	0.255	4	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.258	13	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.498	52	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.819	44	—	—	
PROLOGIS INC	0.839	61	—	—	
PUBLIC STORAGE	0.183	42	—	—	
REALTY INCOME CORP	0.217	15	—	—	
REGENCY CENTERS CORP	0.403	26	—	—	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.203	43	—	—	

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
SL GREEN REALTY CORP	0.081	6	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.282	47	—	—
UDR INC	0.569	25	—	—
VENTAS INC	0.406	25	—	—
VORNADO REALTY TRUST	0.202	13	—	—
WP CAREY INC	0.771	65	—	—
WELLTOWER INC	0.617	49	—	—
WEYERHAEUSER CO	0.829	20	—	—
小計	14	1,245	0.026	7
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.509	13	—	—
小計	0.509	13	—	—
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	0.425	12	—	—
GECINA SA	0.05	6	—	—
COVIVIO	0.158	14	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.136	20	—	—
小計	0.769	53	—	—
ユーロ計	0.769	53	—	—
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
BRITISH LAND CO PLC	2	12	—	—
HAMMERSON PLC	1	5	4	11
SEGRO PLC	2	14	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	1	9	—	—
小計	6	42	4	11
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
MIRVAC GROUP	3	11	—	—
GPT GROUP	3	21	—	—
STOCKLAND	2	9	—	—
DEXUS	4	60	—	—
GOODMAN GROUP	0.677	10	—	—
SCENTRE GROUP	3	12	—	—
小計	19	126	—	—
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	2	174	—	—
小計	2	174	—	—
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 MALL TRUST	7	18	—	—
小計	7	18	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

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 4,537	百万円 4,735	百万円 -	百万円 -

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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

(2018年11月13日～2019年11月11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	5,440,818千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,104,353千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.53

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2018年11月13日～2019年11月11日)

該当事項はございません。

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

(2019年11月11日現在)

外国株式

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AFLAC INC	14	22	120	13,179	保険	
AGCO CORP	3	—	—	—	資本財	
AT&T INC	141	241	950	103,788	電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	34	59	495	54,124	ヘルスケア機器・サービス	
ABBVIE INC	29	49	425	46,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABIOMED INC	0.92	2	44	4,866	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	14	25	139	15,251	メディア・娯楽	
ACUITY BRANDS INC	1	1	22	2,502	資本財	
ADOBE INC	9	16	477	52,101	ソフトウェア・サービス	
ADVANCE AUTO PARTS	1	2	44	4,824	小売	
ADVANCED MICRO DEVICES	18	37	134	14,677	半導体・半導体製造装置	
AETNA INC	6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1	2	23	2,579	各種金融	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6	11	85	9,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3	6	159	17,462	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES	5	7	60	6,615	ソフトウェア・サービス	
ALBEMARLE CORP	3	4	32	3,547	素材	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4	8	97	10,654	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	2	75	8,199	ヘルスケア機器・サービス	
ALLEGHANY CORP	0.41	0.73	56	6,178	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1	2	22	2,449	ソフトウェア・サービス	
ALLSTATE CORP	6	10	110	12,046	保険	
ALPHABET INC-CL C	6	10	1,374	150,020	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	5	9	1,290	140,889	メディア・娯楽	
ALTRIA GROUP INC	36	61	284	31,060	食品・飲料・タバコ	
AMAZON.COM INC	8	13	2,469	269,611	小売	
AMEREN CORPORATION	5	7	58	6,365	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	9	14	126	13,816	公益事業	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	14	23	280	30,656	各種金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	18	29	167	18,242	保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	—	5	66	7,312	公益事業	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4	7	61	6,698	ヘルスケア機器・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2	4	72	7,926	各種金融	
AMETEK INC	5	6	63	6,955	資本財	
AMGEN INC	12	20	456	49,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPHENOL CORP-CL A	5	10	102	11,210	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANADARKO PETROLEUM CORP	10	—	—	—	エネルギー	
ANALOG DEVICES	7	13	157	17,210	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	1	3	68	7,492	ソフトウェア・サービス	
ANTHEM INC	5	8	238	26,050	ヘルスケア機器・サービス	
APACHE CORP	8	17	42	4,594	エネルギー	
APPLE INC	95	151	3,949	431,149	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	20	30	170	18,636	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	6	11	49	5,453	消費者サービス	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	10	15	68	7,526	食品・飲料・タバコ	
ARISTA NETWORKS INC	1	2	45	4,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

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	千米ドル	千円	
ASSURANT INC	1	3	39	4,273	保険
ATMOS ENERGY CORP	1	5	56	6,162	公益事業
AUTODESK INC	4	7	121	13,240	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	3	4	40	4,437	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	8	14	230	25,206	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	0.52	0.82	95	10,435	小売
AVERY DENNISON CORP	3	3	52	5,697	素材
BB&T CORPORATION	15	23	129	14,093	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	10	26	58	6,395	エネルギー
BALL CORP	8	12	80	8,800	素材
BANK OF AMERICA CORP	189	296	987	107,794	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20	27	136	14,882	各種金融
BAXTER INTL INC	9	16	128	14,072	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	5	9	226	24,717	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	3	7	51	5,632	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24	42	932	101,754	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	4	8	69	7,541	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3	8	64	7,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	4	6	200	21,895	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	2	3	175	19,210	各種金融
H&R BLOCK INC	7	8	21	2,359	消費者サービス
BOEING CO	10	17	626	68,392	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	0.93	1	255	27,898	小売
BORGWARNER INC	6	9	44	4,893	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	27	47	194	21,217	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5	6	26	2,937	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32	54	316	34,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	2	5	60	6,631	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	7	13	428	46,733	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6	9	61	6,745	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B	7	15	60	6,581	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	4	54	5,981	各種金融
CBRE GROUP INC - A	6	12	70	7,723	不動産
CDK GLOBAL INC	3	5	30	3,306	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	3	5	78	8,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	—	8	40	4,438	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	5	39	4,320	運輸
CIGNA CORP	4	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CIGNA CORP	—	13	245	26,830	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	6	11	233	25,504	各種金融
CMS ENERGY CORP	6	11	65	7,177	公益事業
CSX CORP	16	24	180	19,717	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	19	43	316	34,601	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	11	15	28	3,142	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	5	8	37	4,084	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10	15	152	16,594	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	8	11	63	6,982	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	3	7	65	7,173	小売
CARNIVAL CORP	8	15	70	7,642	消費者サービス
CATERPILLAR INC	11	18	280	30,583	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	3	5	66	7,282	素材
CELGENE CORP	14	24	265	29,020	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				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
CENTENE CORP	4	16	90	9,862	ヘルスケア機器・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	13	23	66	7,266	公益事業	
CERNER CORP	6	9	65	7,200	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3	5	263	28,715	メディア・娯楽	
CHEVRONTEXACO CORP	37	62	750	81,950	エネルギー	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	0.68	0.99	72	7,906	消費者サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	8	58	6,425	家庭用品・パーソナル用品	
CIMAREX ENERGY CO	2	5	25	2,794	エネルギー	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3	5	65	7,095	保険	
CISCO SYSTEMS INC	92	138	677	73,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINTAS CORP	2	2	75	8,230	商業・専門サービス	
CITIGROUP INC	50	76	582	63,532	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10	16	62	6,824	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	3	5	55	6,055	ソフトウェア・サービス	
CLOROX COMPANY	2	4	62	6,817	家庭用品・パーソナル用品	
COCA-COLA COMPANY	77	130	683	74,654	食品・飲料・タバコ	
COGNEX CORP	5	7	38	4,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11	17	112	12,296	ソフトウェア・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	16	25	168	18,408	家庭用品・パーソナル用品	
COMCAST CORP-CL A	91	152	687	75,074	メディア・娯楽	
COMERICA INC	3	7	52	5,755	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	10	20	55	6,023	食品・飲料・タバコ	
CONCHO RESOURCES INC	3	7	54	5,908	エネルギー	
CONOCOPHILLIPS	22	35	209	22,880	エネルギー	
CONSOLIDATED EDISON INC	5	10	88	9,626	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3	5	106	11,670	食品・飲料・タバコ	
COOPER COS INC/THE	1	2	62	6,870	ヘルスケア機器・サービス	
COPART INC	3	7	59	6,544	商業・専門サービス	
CORNING INC	15	25	77	8,460	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CORTEVA INC	—	24	65	7,115	素材	
COSTCO WHOLESALE CORP	8	14	437	47,800	食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	0.73	1	71	7,855	商業・専門サービス	
COTY INC-CL A	15	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
CUMMINS INC	2	4	87	9,556	資本財	
DR HORTON INC	6	12	62	6,789	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	3	4	54	5,931	公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	5	13	40	4,386	ソフトウェア・サービス	
DANAHER CORP	12	21	293	32,091	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	2	5	58	6,359	消費者サービス	
DAVITA INC	3	6	42	4,658	ヘルスケア機器・サービス	
DEERE & CO	6	10	182	19,975	資本財	
DENTSPLY SIRONA INC	7	10	59	6,462	ヘルスケア機器・サービス	
DEVON ENERGY CORPORATION	12	18	41	4,531	エネルギー	
THE WALT DISNEY CO	29	59	822	89,801	メディア・娯楽	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7	10	91	10,005	各種金融	
DISCOVERY INC-A	5	11	36	4,038	メディア・娯楽	
DISCOVERY INC-C	4	13	39	4,363	メディア・娯楽	
DISH NETWORK CORPORATION	—	11	41	4,480	メディア・娯楽	
EVEREST RE GROUP LTD	1	1	51	5,619	保険	
Dollar General Corp	5	8	139	15,250	小売	
DOLLAR TREE INC	4	8	95	10,407	小売	
DOMINION ENERGY INC	12	25	205	22,478	公益事業	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
DOMINO'S PIZZA INC	1	1	47	5,208	消費者サービス	
DOVER CORP	3	5	57	6,242	資本財	
DOW INC	—	24	139	15,249	素材	
DOWDUPONT INC	45	—	—	—	素材	
DUKE ENERGY CORP	13	21	197	21,562	公益事業	
DUPONT DE NEMOURS INC	—	24	175	19,147	素材	
EOG RESOURCES INC	10	18	139	15,207	エネルギー	
EQT CORPORATION	6	—	—	—	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7	11	50	5,481	各種金融	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3	6	74	8,163	消費者サービス	
EAST WEST BANCORP INC	—	8	37	4,117	銀行	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4	5	45	4,945	素材	
EBAY INC	18	28	99	10,828	小売	
ECOLAB INC	4	8	157	17,145	素材	
BUNGE LIMITED	4	5	31	3,398	食品・飲料・タバコ	
EDISON INTERNATIONAL	6	12	82	9,024	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	4	7	167	18,276	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	5	9	91	10,019	メディア・娯楽	
EMERSON ELECTRIC CO	12	18	135	14,758	資本財	
ENTERGY CORP	4	6	73	8,039	公益事業	
EQUIFAX INC	2	4	61	6,711	商業・専門サービス	
EVERGY INC	—	8	56	6,147	公益事業	
EVERSOURCE ENERGY	5	8	70	7,697	公益事業	
EXELON CORP	18	30	134	14,680	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	3	5	51	5,629	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4	6	53	5,845	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	82	136	967	105,581	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	4	6	35	3,864	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FACEBOOK INC-A	46	80	1,529	167,010	メディア・娯楽	
FASTENAL CO	6	18	69	7,635	資本財	
FEDEX CORP	5	8	134	14,663	運輸	
F5 NETWORKS INC	1	2	35	3,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	5	20	267	29,202	ソフトウェア・サービス	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7	11	52	5,725	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	14	23	72	7,942	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4	5	61	6,689	銀行	
FISERV INC	7	19	215	23,532	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	9	17	80	8,737	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2	2	86	9,449	ソフトウェア・サービス	
FLUOR CORP	—	13	24	2,702	資本財	
FLOWSERVE CORP	4	7	35	3,839	資本財	
FORD MOTOR CO	76	127	115	12,618	自動車・自動車部品	
FORTINET INC	3	6	62	6,775	ソフトウェア・サービス	
FORTIVE CORP	5	9	67	7,398	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5	7	47	5,216	資本財	
FOX CORP-CLASS A	—	11	39	4,277	メディア・娯楽	
FOX CORP-CLASS B	—	11	38	4,156	メディア・娯楽	
FRANKLIN RESOURCES INC	9	11	32	3,584	各種金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4	6	61	6,765	保険	
GARTNER INC	2	4	64	7,001	ソフトウェア・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	4	7	145	15,879	資本財	

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	期末		
			株数	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENERAL ELECTRIC CO	171	295	340	37,123	資本財
GENERAL MILS INC	11	19	104	11,352	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	25	41	159	17,446	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	3	6	66	7,276	小売
GILEAD SCIENCES INC	25	43	283	30,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	3	10	185	20,295	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	5	53	5,853	保険
GODADDY INC - CLASS A	4	8	60	6,560	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7	10	241	26,328	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9	—	—	—	自動車・自動車部品
WW GRAINGER INC	0.81	1	56	6,171	資本財
HCA HEALTHCARE INC	5	9	127	13,891	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	7	32	3,556	資本財
HP INC	31	47	92	10,048	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	15	25	54	5,949	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	5	7	28	3,091	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	2	—	—	—	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9	8	52	5,728	保険
HASBRO INC	3	5	48	5,245	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE	3	5	21	2,339	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2	3	51	5,646	ソフトウェア・サービス
HESS CORP	6	11	82	8,972	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	30	44	78	8,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6	10	100	11,011	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	4	7	40	4,426	エネルギー
HOME DEPOT INC	22	35	829	90,534	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14	23	428	46,821	資本財
HORMEL FOODS CORP	7	12	53	5,804	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	2	4	146	15,946	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2	3	43	4,780	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	30	44	67	7,347	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	1	48	5,319	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	1	3	72	7,899	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	1	3	80	8,787	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	5	10	186	20,412	資本財
ILLUMINA INC	3	5	151	16,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	4	8	69	7,561	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGREDION INC	—	3	27	3,002	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	90	148	864	94,406	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	10	18	166	18,171	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	17	28	395	43,201	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	4	59	6,538	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	8	12	57	6,265	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	11	20	46	5,032	メディア・娯楽
INTUIT INC	4	8	216	23,579	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	2	3	215	23,489	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	3	6	93	10,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	66	106	1,384	151,132	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3	6	57	6,288	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	10	16	32	3,550	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	52	86	1,154	126,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	—	14	37	4,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	期末		
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KLA CORPORATION	3	5	92	10,078	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO	5	9	58	6,363	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	22	41	79	8,677	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	4	7	78	8,570	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	6	11	151	16,560	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	39	69	139	15,185	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5	7	29	3,197	運輸
KOHL'S CORP	3	6	37	4,128	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	12	26	87	9,524	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	16	26	70	7,698	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	8	15	54	5,901	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	1	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	7	149	16,369	資本財
LAM RESEARCH CORP	3	4	135	14,763	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	7	13	85	9,303	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4	7	141	15,495	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	—	2	34	3,805	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	4	8	44	4,836	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	3	6	60	6,558	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	8	11	65	7,186	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.8	1	42	4,680	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	3	5	59	6,449	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	3	9	44	4,815	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	19	29	332	36,286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	4	9	58	6,426	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	5	8	333	36,389	資本財
LOEWS CORP	6	12	65	7,192	保険
LOWE'S COMPANIES	15	26	297	32,479	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	2	3	79	8,668	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	2	3	53	5,817	銀行
MSCI INC	2	3	80	8,772	各種金融
MANPOWERGROUP	2	2	25	2,809	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	19	43	53	5,881	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	13	23	153	16,772	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	9	15	160	17,570	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	5	10	138	15,107	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	2	58	6,337	素材
MASCO CORP	9	13	61	6,762	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	18	30	827	90,381	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7	11	70	7,709	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2	4	65	7,164	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	15	25	486	53,153	消費者サービス
MCKESSON CORP	4	6	93	10,207	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	0.93	1	85	9,336	小売
MERCK & CO. INC.	52	85	715	78,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	17	24	120	13,179	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	0.51	1	71	7,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	142	239	3,502	382,375	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	9	94	10,344	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	22	39	187	20,440	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	1	2	33	3,669	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	1	2	36	3,933	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			株数	評価		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
MOLSON COORS BREWING CO -B	5	9	48	5,302	食品・飲料・タバコ	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	28	46	239	26,173	食品・飲料・タバコ	
MONSTER BEVERAGE CORP	8	12	73	7,999	食品・飲料・タバコ	
MOODY'S CORP	3	6	135	14,810	各種金融	
MORGAN STANLEY	27	40	199	21,831	各種金融	
MOSAIC CO/THE	9	17	35	3,895	素材	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3	5	93	10,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	10	15	36	3,935	エネルギー	
NETAPP INC	5	10	60	6,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	8	14	434	47,391	メディア・娯楽	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	22	—	—	—	銀行	
NEWELL BRANDS INC	14	19	39	4,300	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	8	25	93	10,210	素材	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	13	23	30	3,376	メディア・娯楽	
NEXTERA ENERGY INC	8	15	343	37,527	公益事業	
NIKE INC -CL B	24	41	372	40,655	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	10	17	46	5,111	公益事業	
NOBLE ENERGY INC	13	21	46	5,083	エネルギー	
NORDSTROM INC	3	6	24	2,656	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5	8	167	18,326	運輸	
NORTHERN TRUST CORP	3	6	71	7,767	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3	5	199	21,784	資本財	
NORTONLIFELOCK INC	—	25	63	6,973	ソフトウェア・サービス	
NUCOR CORP	7	12	71	7,763	素材	
NVIDIA CORP	11	19	409	44,682	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	6	10	46	5,086	公益事業	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1	2	116	12,705	小売	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	14	28	116	12,681	エネルギー	
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	—	2	51	5,574	運輸	
ONEOK INC	7	13	97	10,624	エネルギー	
ORACLE CORPORATION	59	77	437	47,808	ソフトウェア・サービス	
P G & E CORP	10	—	—	—	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9	13	210	22,944	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	4	6	84	9,175	素材	
PPL CORPORATION	13	20	69	7,571	公益事業	
PVH CORP	2	3	37	4,116	耐久消費財・アパレル	
PACCAR INC	6	11	90	9,876	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2	3	43	4,712	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	2	3	84	9,233	ソフトウェア・サービス	
PARKER HANNIFIN CORP	2	4	86	9,496	資本財	
PAYCHEX INC	5	8	74	8,151	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	22	37	384	41,981	ソフトウェア・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	12	23	40	4,439	銀行	
PEPSICO INC	27	45	600	65,497	食品・飲料・タバコ	
PFIZER INC	114	182	676	73,858	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	30	51	428	46,816	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	8	14	174	19,050	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	3	5	43	4,734	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3	5	77	8,458	エネルギー	
POLARIS INC	2	2	29	3,274	耐久消費財・アパレル	
T ROWE PRICE GROUP INC	4	6	76	8,301	各種金融	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5	10	56	6,127	保険	

銘柄	株数	当期			業種等
		株数	期末		
			株数	評価額	
期首(前期末)	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PROCTER & GAMBLE CO	48	82	990	108,098	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	11	19	141	15,480	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8	13	121	13,222	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9	15	97	10,628	公益事業
PULTE HOMES INC	9	12	48	5,268	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	27	40	383	41,909	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	3	5	58	6,341	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC-A	11	24	22	2,462	小売
RALPH LAUREN CORP	1	2	28	3,067	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	5	52	5,779	各種金融
RAYTHEON COMPANY	5	9	204	22,359	資本財
RED HAT INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1	3	103	11,342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	22	42	72	7,866	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	5	5	51	5,588	商業・専門サービス
RESMED INC	3	5	75	8,196	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	4	4	24	2,669	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	2	3	62	6,793	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	2	—	—	—	資本財
ROLLINS INC	3	7	27	2,989	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	2	3	127	13,926	資本財
ROSS STORES INC	6	11	129	14,122	小売
S&P GLOBAL INC	4	8	211	23,047	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	4	5	33	3,701	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3	10	61	6,667	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	1	2	59	6,459	銀行
SALESFORCE.COM INC	14	28	453	49,489	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	5	—	—	—	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	24	44	160	17,474	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	23	40	178	19,477	各種金融
SEALED AIR CORP	5	6	26	2,839	素材
SEATTLE GENETICS INC	3	5	61	6,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	4	8	123	13,450	公益事業
SERVICENOW INC	3	6	170	18,577	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	2	165	18,022	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4	7	71	7,762	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP	—	6	34	3,820	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	2	4	48	5,336	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	—	2	35	3,863	資本財
SOUTHERN CO	19	33	207	22,649	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	4	6	38	4,210	運輸
SPLUNK INC	2	5	74	8,175	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	5	12	80	8,746	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	3	5	82	9,011	資本財
STARBUCKS CORP	26	41	336	36,712	消費者サービス
STATE STREET CORP	7	12	88	9,703	各種金融
STERICYCLE INC	3	—	—	—	商業・専門サービス
STRYKER CORP	6	11	226	24,730	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	9	15	107	11,717	銀行
SYMANTEC CORP	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	3	5	72	7,910	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	14	20	75	8,189	各種金融

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
SYSCO CORP	9	16	129	14,095	食品・生活必需品小売り	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7	13	56	6,155	各種金融	
TJX COMPANIES INC	23	38	229	25,047	小売	
T-MOBILE US INC	6	12	99	10,823	電気通信サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	4	56	6,217	メディア・娯楽	
TAPESTRY INC	7	13	37	4,060	耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	9	17	191	20,861	小売	
TELEFLEX INC	0.7	2	69	7,627	ヘルスケア機器・サービス	
TESLA INC	2	4	155	16,929	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS	18	31	384	41,929	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	4	10	50	5,459	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8	13	404	44,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	11	18	321	35,080	資本財	
TIFFANY & CO	3	4	61	6,708	小売	
TOLL BROTHERS INC	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	2	—	—	—	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3	5	50	5,516	小売	
TRANSDIGM GROUP INC	1	1	103	11,281	資本財	
TRANSUNION	4	8	65	7,128	商業・専門サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	5	8	108	11,872	保険	
TRIMBLE INC	6	12	50	5,521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRIPADVISOR INC-W/I	3	7	25	2,752	メディア・娯楽	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	19	—	—	—	メディア・娯楽	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10	—	—	—	メディア・娯楽	
TWITTER INC	13	29	84	9,256	メディア・娯楽	
TYSON FOODS INC-CL A	5	10	84	9,200	食品・飲料・タバコ	
US BANCORP	29	47	282	30,803	銀行	
ULTA BEAUTY INC	1	2	56	6,138	小売	
UNION PACIFIC CORP	15	23	406	44,347	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	13	22	283	30,990	運輸	
UNITED RENTALS INC	2	3	54	5,917	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	14	27	408	44,546	資本財	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	18	31	805	87,883	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2	3	51	5,669	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	6	10	30	3,359	保険	
VF CORP	6	11	96	10,540	耐久消費財・アパレル	
VAIL RESORTS INC	1	1	44	4,859	消費者サービス	
VALERO ENERGY CORP	8	14	144	15,799	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2	3	47	5,188	ヘルスケア機器・サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3	4	70	7,674	ヘルスケア機器・サービス	
VERISIGN INC	2	4	79	8,687	ソフトウェア・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	80	134	799	87,325	電気通信サービス	
VERISK ANALYTICS INC	2	4	63	6,926	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5	9	189	20,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC CL B	10	18	41	4,502	メディア・娯楽	
VISA INC-CLASS A SHARES	34	57	1,021	111,533	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	2	3	62	6,806	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	5	7	44	4,907	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	3	4	65	7,163	素材	
WABCO HOLDINGS INC	2	2	29	3,248	資本財	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		千円	
			株 数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
WEC ENERGY GROUP INC	6	11	103	11,342	公益事業	
WABTEC CORP/DE	2	7	58	6,343	資本財	
WALMART INC	28	46	555	60,692	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	16	25	149	16,302	食品・生活必需品小売り	
WASTE CONNECTIONS INC	4	8	77	8,417	商業・専門サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	7	12	140	15,356	商業・専門サービス	
WATERS CORP	1	2	61	6,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WELLS FARGO & COMPANY	90	139	755	82,512	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	7	11	59	6,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	13	19	53	5,859	ソフトウェア・サービス	
WESTROCK CO	7	10	42	4,668	素材	
WHIRLPOOL CORP	1	2	44	4,814	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	23	44	97	10,687	エネルギー	
WORKDAY INC-CLASS A	3	6	101	11,045	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY INC-CLASS A	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
XCEL ENERGY INC	9	18	112	12,283	公益事業	
XILINX INC	4	9	89	9,757	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	7	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	4	7	59	6,491	資本財	
XEROX HOLDINGS CORP	—	9	34	3,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUM! BRANDS INC	6	10	103	11,346	消費者サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	2	51	5,570	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4	7	105	11,537	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	10	17	202	22,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	11	19	33	3,695	各種金融	
CHUBB LTD	8	15	228	24,957	保険	
LyondellBasell Industries NV	6	8	78	8,600	素材	
GARMIN LTD	3	6	58	6,395	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	12	20	384	41,995	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	6	10	121	13,314	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	8	10	59	6,500	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	4	7	145	15,865	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	6	10	96	10,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND PLC	4	7	102	11,234	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
APTIV PLC	5	8	82	8,999	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	8	13	125	13,660	資本財	
IHS MARKIT LTD	6	15	104	11,448	商業・専門サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2	4	84	9,274	保険	
TECHNIPFMC PLC	10	21	45	4,931	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5	8	45	4,926	資本財	
PERRIGO CO PLC	3	6	31	3,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMCOR PLC	—	55	53	5,894	素材	
CAPRI HOLDINGS LTD	—	7	27	2,954	耐久消費財・アパレル	
PENTAIR PLC	5	7	32	3,522	資本財	
MEDTRONIC PLC	26	43	466	50,939	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	12	24	43	4,738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11	18	37	4,142	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18	29	123	13,478	資本財	
ALLERGAN PLC	6	11	207	22,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6	10	54	5,968	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC	10	18	368	40,175	素材	

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		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4	7	32	3,549	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,784	9,576	86,097	9,398,445	
	銘柄 数 < 比 率 >	485	488	—	<65.6%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	15	—	—	—	エネルギー	
AGNICO EAGLE MINES LTD	—	10	79	6,596	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	8	30	121	10,056	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	5	8	51	4,282	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	11	19	193	15,934	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	21	36	282	23,325	銀行	
BARRICK GOLD CORP	22	60	131	10,865	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	16	32	238	19,721	各種金融	
CAE INC	10	14	50	4,137	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4	8	47	3,892	素材	
CGI INC	—	8	88	7,323	ソフトウェア・サービス	
CAMECO CORP	13	22	27	2,302	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7	14	164	13,549	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	13	21	272	22,525	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	21	40	150	12,437	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2	4	154	12,762	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2	2	42	3,536	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6	9	35	2,896	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	22	51	62	5,141	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.49	0.75	95	7,903	ソフトウェア・サービス	
DOLLARAMA INC	7	13	62	5,150	小売	
ENCANA CORP	29	59	37	3,127	エネルギー	
ENBRIDGE INC	32	69	342	28,266	エネルギー	
FINNING INTERNATIONAL INC	7	—	—	—	資本財	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11	15	32	2,713	不動産	
FORTIS INC	9	17	93	7,756	公益事業	
FRANCO-NEVADA CORP	4	6	80	6,619	素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7	13	48	3,993	耐久消費財・アパレル	
GOLDCORP INC	23	—	—	—	素材	
GREAT-WEST LIFECO INC	9	16	53	4,402	保険	
CGI GROUP INC	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	15	28	29	2,455	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	—	17	41	3,404	公益事業	
IGM FINANCIAL INC	4	8	34	2,879	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	7	10	37	3,088	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	3	5	81	6,691	保険	
INTER PIPELINE LTD	12	22	49	4,084	エネルギー	
KEYERA CORP	7	13	43	3,558	エネルギー	
LOBLAW COMPANIES LTD	5	8	61	5,051	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	7	9	69	5,704	自動車・自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	35	71	186	15,423	保険	
METRO INC	7	11	65	5,416	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	7	13	95	7,901	銀行	
NUTRIEN LTD	11	20	136	11,235	素材	
ONEX CORPORATION	3	—	—	—	各種金融	
OPEN TEXT CORP	7	12	68	5,647	ソフトウェア・サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	9	20	94	7,808	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	12	17	55	4,566	保険	

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		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
POWER FINANCIAL CORP	8	14	45	3,784	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7	14	19	1,579	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	4	10	88	7,342	消費者サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	6	11	70	5,823	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	26	44	487	40,205	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	5	—	—	—	資本財	
SAPUTO INC	6	9	38	3,202	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13	22	61	5,057	メディア・娯楽	
SHOPIFY INC - CLASS A	—	3	152	12,574	ソフトウェア・サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	10	16	102	8,452	保険	
SUNCOR ENERGY INC	30	49	210	17,344	エネルギー	
TC ENERGY CORP	—	31	209	17,255	エネルギー	
TELUS CORP	3	8	39	3,292	電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	5	—	—	—	各種金融	
THOMSON REUTERS CORP	—	9	84	6,970	商業・専門サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	33	56	435	35,968	銀行	
TRANSCANADA CORP	16	—	—	—	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	6	—	—	—	エネルギー	
WESTON (GEORGE) LTD	2	4	45	3,755	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13	20	71	5,907	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	715	1,229	6,357	524,658	
	銘柄 数 < 比 率 >	62	59	—	< 3.7% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	3	5	162	19,526	耐久消費財・アパレル	
Fresenius SE & CO KG	8	12	61	7,356	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3	8	26	3,196	電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	—	4	19	2,363	素材	
HANNOVER RUECK SE	1	2	47	5,678	保険	
GEA GROUP AG	6	8	23	2,852	資本財	
CONTINENTAL AG	2	3	50	6,099	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG	18	29	97	11,722	運輸	
AXEL SPRINGER SE	1	—	—	—	メディア・娯楽	
MERCK KGAA	3	5	60	7,219	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	14	19	52	6,274	公益事業	
SAP SE	19	32	394	47,489	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	43	64	57	6,923	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	2	4	44	5,316	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA AG	0.33	4	33	4,002	耐久消費財・アパレル	
BAYER AG	18	30	218	26,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	3	3	36	4,389	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	17	27	197	23,736	素材	
BEIERSDORF AG	2	4	46	5,622	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	—	5	38	4,665	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	5	9	61	7,419	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE	8	13	289	34,788	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	7	16	29	3,547	運輸	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2	4	104	12,554	保険	
VOLKSWAGEN AG	1	2	37	4,523	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG PFD	3	5	93	11,229	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	18	29	155	18,710	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG	14	24	276	33,212	資本財	
DEUTSCHE BANK AG -REG	42	82	57	6,869	各種金融	

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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7	9	74	8,942	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	62	97	150	18,067	電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	23	45	85	10,339	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	3	6	87	10,485	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	—	6	43	5,269	自動車・自動車部品	
WIRECARD AG	2	4	54	6,544	ソフトウェア・サービス	
LANXESS	2	5	36	4,368	素材	
MTU AERO ENGINES AG	1	2	58	7,073	資本財	
SYMRISE AG	3	5	50	6,093	素材	
BRENTAG AG	4	6	32	3,927	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	5	9	24	2,985	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	35	93	26	3,146	電気通信サービス	
HUGO BOSS AG-ORD	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	27	60	33	4,063	銀行	
VONOVIA SE	9	18	87	10,507	不動産	
PROSIEBENSATI MEDIA SE	8	—	—	—	メディア・娯楽	
METRO AG	8	12	18	2,188	食品・生活必需品小売り	
COVESTRO AG	3	6	28	3,419	素材	
UNIPER SE	—	11	32	3,883	公益事業	
DELIVERY HERO SE	—	7	31	3,746	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額	490	879	3,730	448,612	
	銘柄 数 < 比 率 >	44	46	—	< 3.1% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	28	34	66	8,023	保険	
INTESA SANPAOLO	328	566	132	15,957	銀行	
MEDIOBANCA SPA	26	36	37	4,517	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ENEL SPA	175	293	201	24,211	公益事業	
ENI SPA	54	79	113	13,603	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RNC	244	—	—	—	電気通信サービス	
ATLANTIA S. P. A	13	24	54	6,599	運輸	
TERNA SPA	43	68	40	4,918	公益事業	
RECORDATI SPA	—	7	28	3,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONCLER SPA	5	9	37	4,453	耐久消費財・アパレル	
FINECOBANK SPA	—	36	40	4,854	銀行	
UNICREDIT SPA	45	81	102	12,306	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	—	33	35	4,308	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	38	31	3,794	食品・飲料・タバコ	
PIRELLI & C SPA	19	—	—	—	自動車・自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	991	1,309	922	110,920	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	13	—	< 0.8% >	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	7	10	39	4,750	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13	23	52	6,368	公益事業	
L'OREAL	4	7	201	24,217	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5	9	369	44,390	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	2	4	41	4,952	資本財	
CAPGEMINI	3	5	55	6,698	ソフトウェア・サービス	
MICHELIN (CGDE)-B	3	4	53	6,438	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	3	6	114	13,748	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	4	7	36	4,390	自動車・自動車部品	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	10	16	145	17,531	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末) 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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VIVENDI SA	22	33	83	10,076	メディア・娯楽	
ORANGE	35	56	80	9,650	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	0.56	0.79	51	6,161	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	3	4	62	7,575	ソフトウェア・サービス	
KERING	1	2	134	16,120	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	7	12	22	2,710	保険	
CARREFOUR SA	—	22	35	4,267	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	—	3	27	3,343	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	21	36	306	36,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	5	10	39	4,799	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE-A	14	23	66	8,015	銀行	
TELEPERFORMANCE	1	2	53	6,444	商業・専門サービス	
SODEXO	2	3	38	4,679	消費者サービス	
AXA	34	56	144	17,335	保険	
PEUGEOT SA	13	23	57	6,874	自動車・自動車部品	
ESSILORLUXOTTICA	3	9	129	15,557	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	26	49	60	7,321	銀行	
BNP PARIBAS	21	33	169	20,415	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10	15	58	7,017	資本財	
Wendel	1	2	25	3,009	各種金融	
Iliad SA	1	1	13	1,653	電気通信サービス	
IMERYS SA	1	—	—	—	素材	
SAFRAN SA	6	11	165	19,875	資本財	
ENGIE	32	58	83	10,014	公益事業	
ALSTOM	5	9	35	4,213	資本財	
Eutelsat Communications	8	11	18	2,217	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	18	30	28	3,390	公益事業	
Legrand SA	6	7	49	5,952	資本財	
Eiffage SA	—	4	41	4,951	資本財	
TOTAL SA	45	75	370	44,576	エネルギー	
Aeroports de Paris	—	1	25	3,023	運輸	
Natixis	29	57	23	2,803	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2	3	17	2,048	メディア・娯楽	
SCOR SE	5	7	27	3,343	保険	
VINCI S. A.	9	16	162	19,557	資本財	
DANONE	11	19	141	17,026	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	8	14	168	20,270	素材	
Bureau Veritas SA	8	12	28	3,431	商業・専門サービス	
GETLINK SE	15	22	33	3,995	運輸	
SUEZ	13	21	28	3,427	公益事業	
EDENRED	—	10	48	5,881	商業・専門サービス	
VALEO SA	8	10	38	4,572	自動車・自動車部品	
WORLDDLINE SA	—	5	29	3,558	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	527	911	4,337	521,558	
	銘柄数<比率>	47	52	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	11	19	261	31,433	資本財	
RANDSTAD NV	3	6	32	3,878	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	4	—	—	—	素材	
WOLTERS KLUWER	6	7	47	5,683	商業・専門サービス	
Koninklijke Vopak NV	2	5	27	3,304	エネルギー	
AEGON NV	48	99	41	5,049	保険	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONIKLIJKE KPN NV	97	177	49	5,952	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	17	30	65	7,850	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	17	32	130	15,653	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	4	8	80	9,684	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	3	5	46	5,576	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	4	6	72	8,759	素材	
UNILEVER NV-CVA	29	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
UNILEVER NV	—	46	253	30,461	家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	7	14	347	41,738	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	23	40	98	11,798	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	—	6	59	7,111	素材	
PROSUS NV	—	16	101	12,153	小売	
QIAGEN N V	6	14	40	4,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV /WI	—	0.59	37	4,508	ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	79	129	139	16,731	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	372	668	1,930	232,171	
銘柄 数 < 比 率 >		17	19	—	< 1.6% >	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	10	14	35	4,243	公益事業	
Bankinter SA	—	37	23	2,855	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	139	199	98	11,900	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10	15	36	4,385	公益事業	
REPSOL SA	24	37	56	6,818	エネルギー	
BANCO SANTANDER S. A	332	510	192	23,097	銀行	
TELEFONICA SA	91	138	94	11,392	電気通信サービス	
ENAGAS SA	7	10	24	2,945	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7	10	37	4,473	資本財	
FERROVIAL SA	13	22	58	7,067	資本財	
MAPPFRE S. A.	42	67	17	2,090	保険	
CaixaBank SA	88	149	41	5,017	銀行	
IBERDROLA SA	110	181	162	19,552	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	8	14	102	12,313	ソフトウェア・サービス	
FERROVIAL SA - RTS	13	—	—	—	資本財	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12	16	29	3,507	公益事業	
FERROVIAL SA-RTS	—	22	0.93416	112	資本財	
INDITEX	19	36	100	12,068	小売	
AENA SME SA	—	2	47	5,680	運輸	
CELLNEX TELECOM SAU	—	12	47	5,723	電気通信サービス	
GRIFOLS SA	8	14	40	4,919	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	940	1,515	1,248	150,164	
銘柄 数 < 比 率 >		17	20	—	< 1.0% >	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	6	6	44	5,298	銀行	
SOLVAY SA	—	2	27	3,321	素材	
UCB SA	3	5	41	4,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	2	3	18	2,171	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2	4	41	4,946	各種金融	
AGEAS	5	8	43	5,226	保険	
UMICORE	5	7	31	3,769	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15	25	182	21,913	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	39	65	429	51,622	
銘柄 数 < 比 率 >		7	8	—	< 0.4% >	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株		千ユーロ	千円	
OMV AG	4	6		37	4,498	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	7	14		47	5,690	銀行
ANDRITZ AG	—	5		22	2,751	資本財
小計	株数・金額	11	26	107	12,939	
	銘柄数<比率>	2	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	14	23		23	2,880	エネルギー
SES SA	10	17		29	3,500	メディア・娯楽
ARCELMITTAL	15	32		49	5,990	素材
小計	株数・金額	40	73	102	12,372	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA	13	17		16	1,998	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	11	16		51	6,226	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	15	22		28	3,398	素材
SAMPO OYJ-A SHS	7	11		42	5,059	保険
FORTUM OYJ	—	17		36	4,360	公益事業
ELISA OYJ	4	6		31	3,775	電気通信サービス
NOKIA OYJ	100	195		62	7,573	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	3	15		48	5,841	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	4	7		20	2,405	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	5	9		52	6,365	資本財
ORION OYJ	—	6		25	3,080	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	166	324	416	50,085	
	銘柄数<比率>	9	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC(DUBLIN)	18	29		97	11,748	素材
KERRY GROUP PLC-A	3	5		68	8,192	食品・飲料・タバコ
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2	4		41	5,033	消費者サービス
小計	株数・金額	24	39	207	24,974	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	80	111		40	4,927	公益事業
Galp Energia SGPS SA	13	17		25	3,124	エネルギー
JERONIMO MARTINS	11	14		21	2,628	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	105	142	88	10,680	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	3,710	5,956	13,522	1,626,104	
	銘柄数<比率>	164	181	—	<11.3%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ASHTREAD GROUP PLC	13	21		50	6,987	資本財
BHP GROUP PLC	43	—		—	—	素材
AVIVA PLC	71	108		46	6,505	保険
DIAGEO PLC	45	76		236	32,976	食品・飲料・タバコ
SCHROEDERS PLC	4	7		23	3,342	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	56	103		60	8,413	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	44	76		221	30,890	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	59	95		69	9,638	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	18	30		54	7,590	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	381	647		385	53,866	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	106	203		54	7,667	保険
MEGGITT PLC	31	47		30	4,223	資本財

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	73	118	23	3,287	食品・生活必需品小売り	
Associated British Foods PLC	9	13	31	4,445	食品・飲料・タバコ	
PERSIMMON PLC	—	13	32	4,544	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL PLC	46	84	115	16,154	保険	
RIO TINTO PLC	24	40	168	23,565	素材	
TRAVIS PERKINS PLC	15	—	—	—	資本財	
SSE PLC	22	36	45	6,390	公益事業	
BP PLC	375	656	333	46,613	エネルギー	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,383	2,385	134	18,747	銀行	
TESCO PLC	178	330	78	10,970	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	18	30	50	7,115	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE PLC	96	166	288	40,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE	10	16	25	3,508	資本財	
ASTRAZENECA PLC	24	44	321	44,917	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	159	273	51	7,137	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	5	7	24	3,390	消費者サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	60	103	19	2,678	小売	
BARCLAYS PLC	339	577	96	13,411	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	4	5	31	4,369	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	9	15	32	4,549	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	4	5	34	4,774	小売	
KINGFISHER PLC	68	84	18	2,576	小売	
ITV PLC	109	180	24	3,390	メディア・娯楽	
SAINSBURY (J) PLC	55	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
RANDGOLD RESOURCES LTD	2	—	—	—	素材	
G4S PLC	58	84	17	2,417	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	6	10	21	3,018	保険	
CENTRICA PLC	174	273	19	2,787	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	85	137	320	44,817	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	73	125	292	40,879	エネルギー	
BUNZL PLC	10	15	33	4,611	資本財	
RENTOKIL INITIAL PLC	—	86	37	5,265	商業・専門サービス	
London Stock Exchange Group PLC	6	11	79	11,097	各種金融	
UNILEVER PLC	22	35	163	22,850	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	17	27	66	9,237	商業・専門サービス	
MONDI PLC	—	18	31	4,396	素材	
SEVERN TRENT PLC	7	12	27	3,773	公益事業	
Whitbread PLC	5	6	28	4,006	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	9	12	22	3,157	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	14	19	33	4,618	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	23	42	86	12,117	素材	
3I GROUP PLC	—	42	47	6,683	各種金融	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12	23	138	19,345	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	34	60	111	15,568	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	9	—	—	—	素材	
GLENCORE PLC	234	405	103	14,421	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	31	—	—	—	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	123	220	46	6,545	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	33	42	30	4,307	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	29	44	44	6,256	メディア・娯楽	
COMPASS GROUP PLC	28	53	107	15,022	消費者サービス	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5	—	—	—	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	61	103	91	12,827	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	40	—	—	—	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	34	—	—	—	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	71	110	34	4,774	各種金融	
FERGUSON PLC	5	—	—	—	資本財	
BHP GROUP PLC	—	74	128	17,970	素材	
VODAFONE GROUP PLC	503	907	147	20,563	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	8	42	5,946	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	6	28	4,005	素材	
FERGUSON PLC	—	7	50	7,108	資本財	
M&G PLC	—	144	31	4,400	各種金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	32	43	23	3,330	保険	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	42	65	17	2,508	保険	
MELROSE INDUSTRIES PLC	114	227	51	7,166	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	6	7	24	3,353	素材	
小計	株数・金額	5,963	10,124	5,800	810,094	
	銘柄数<比率>	71	69	—	<5.7%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA	0.13	0.16	40	4,425	商業・専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.15	30	3,373	食品・飲料・タバコ	
SWISSCOM AG-REG	0.65	1	57	6,236	電気通信サービス	
Lindt & Spruengli AG	—	0.06	44	4,844	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	0.18	0.25	71	7,833	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2	4	175	19,209	保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	43	70	614	67,179	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	36	57	123	13,497	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	13	22	675	73,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG(REG)	—	5	36	3,939	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	10	14	77	8,478	素材	
CLARIANT AG-REG	—	14	28	3,152	素材	
NESTLE SA-REGISTERED	60	99	1,032	112,916	食品・飲料・タバコ	
Baloise Holding AG	—	2	44	4,844	保険	
TEMENOS GROUP AG-REG	—	3	45	4,924	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG	1	2	55	6,020	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	0.47	41	4,564	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG	56	95	124	13,593	各種金融	
THE SWATCH GROUP AG-B	0.92	1	40	4,401	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG	1	2	98	10,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG	0.88	1	63	6,933	保険	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	0.82	63	6,943	各種金融	
Schindler Holding AG	1	1	38	4,196	資本財	
Schindler Holding AG	—	1	32	3,547	資本財	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1	2	37	4,126	運輸	
GEBERIT AG-REG	0.92	1	56	6,166	資本財	
JULIUS BAER GROUP LTD	6	10	50	5,535	各種金融	
SWISS RE AG	6	9	101	11,060	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	9	16	126	13,839	耐久消費財・アパレル	
SIKA AG-REG	3	4	70	7,716	素材	
ALCON INC	—	12	72	7,937	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
UBS GROUP AG	81	121	149	16,358		各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	342	581	4,318	472,497	
	銘柄 数 < 比 率 >	22	32	—	< 3.3% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローネ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	25	61	584	6,573		銀行
Swedbank AB	16	34	483	5,443		銀行
SWEDISH MATCH AB	3	7	317	3,567		食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	13	13	216	2,433		商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	8	11	572	6,444		各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B	19	26	512	5,770		小売
ERICSSON LM-B SHS	54	97	853	9,601		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA COMPANY AB	76	101	430	4,847		電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	12	15	345	3,883		資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	5	11	354	3,992		エネルギー
ALFA LAVAL AB	7	10	242	2,726		資本財
Millicom International Cellular SA	3	3	165	1,862		電気通信サービス
Husqvarna AB	18	24	189	2,129		耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	11	15	285	3,209		資本財
VOLVO AB-B SHS	27	33	511	5,751		資本財
SANDVIK AB	21	30	552	6,219		資本財
Industrivarden AB	7	10	221	2,491		各種金融
HEXAGON AB-B SHS	5	8	461	5,192		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	14	26	369	4,157		電気通信サービス
KINNEVIK AB-B	7	14	380	4,284		各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	8	15	546	6,150		資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	10	18	565	6,365		資本財
BOLIDEN AB	7	—	—	—		素材
EPIROC AB-A	16	24	269	3,030		資本財
EPIROC AB-B	18	22	240	2,702		資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	13	19	579	6,521		家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB	—	16	439	4,942		素材
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	24	60	582	6,547		銀行
ASSA ABLOY AB-B	15	28	634	7,134		資本財
NORDEA BANK ABP	54	87	638	7,180		銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	532	853	12,547	141,156	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	29	—	< 1.0% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA	17	32	541	6,459		銀行
TELENOR ASA	19	30	502	5,999		電気通信サービス
EQUINOR ASA	22	26	478	5,712		エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	5	6	233	2,789		素材
NORSK HYDRO ASA	40	89	316	3,779		素材
ORKLA ASA	25	32	284	3,394		食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	—	15	268	3,201		保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	8	215	2,566		メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	131	242	2,841	33,903	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	8	—	< 0.2% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	3	4	391	6,291		食品・飲料・タバコ
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.23	0.27	245	3,954		運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.04	0.2	170	2,746		運輸
DANSKE BANK A/S	15	27	261	4,207		銀行

銘柄	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	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		3	6	420	6,761	資本財
H LUNDBECK A/S		2	5	126	2,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A/S		3	7	527	8,487	運輸
PANDORA A/S		2	4	133	2,154	耐久消費財・アパレル
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		2	4	254	4,102	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		5	7	249	4,016	素材
COLOPLAST-B		2	5	414	6,667	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B		33	58	2,276	36,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S		3	7	459	7,390	公益事業
DEMANT A/S		4	7	130	2,098	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	84	146	6,062	97,541	
(オーストラリア)		14	14	—	<0.7%>	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD		51	87	千豪ドル 230	17,265	銀行
AMCOR PLC-CDI		31	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION		61	107	295	22,119	銀行
TELSTRA CORP LTD		110	179	63	4,718	電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED		26	35	36	2,749	食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE		5	9	75	5,630	各種金融
BHP GROUP LIMITED		63	102	381	28,569	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		8	12	33	2,520	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED		13	27	45	3,385	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED		8	15	409	30,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP		42	97	142	10,691	運輸
COCHLEAR LIMITED		1	2	52	3,903	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED		—	68	56	4,198	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		31	56	444	33,248	銀行
RIO TINTO LIMITED		8	13	131	9,854	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		67	88	69	5,220	保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		—	5	21	1,589	消費者サービス
ORICA LTD		14	20	49	3,735	素材
LENLEASE GROUP		20	28	55	4,117	不動産
SUNCORP GROUP LTD		31	55	74	5,549	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		48	91	259	19,403	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		20	29	88	6,594	素材
INCITEC PIVOT LTD		56	86	31	2,346	素材
AMP LIMITED		94	154	29	2,243	各種金融
QBE INSURANCE GROUP LIMITED		31	55	71	5,383	保険
SANTOS LTD		40	83	67	5,066	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD		12	24	71	5,363	ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED		62	118	56	4,236	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED		20	33	136	10,225	小売
ALUMINA LTD		117	189	45	3,425	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		14	25	85	6,365	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		23	38	144	10,786	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD		—	18	42	3,192	商業・専門サービス
BRAMBLES LTD		38	52	63	4,738	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD		6	11	156	11,696	各種金融
CROWN RESORTS LIMITED		13	33	41	3,132	消費者サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		—	31	55	4,144	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT		37	63	55	4,154	運輸
AGL ENERGY LTD		13	25	50	3,769	公益事業

銘柄	株数	期首(前期末) 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	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
SOUTH32 LTD	117	234	64	4,812	素材	
COLES GROUP LTD	—	40	61	4,575	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	1,372	2,453	4,348	325,346	
	銘柄数<比率>	36	40	—	<0.3%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	27	37	2,560	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	—	29	36	2,541	食品・飲料・タバコ	
SPARK NEW ZEALAND LTD	68	85	38	2,640	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	35	40	38	2,657	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	—	93	43	2,997	公益事業	
小計	株数・金額	103	276	193	13,397	
	銘柄数<比率>	2	5	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15	18	186	2,599	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	46	116	221	3,089	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	35	50	418	5,837	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24	40	1,016	14,163	各種金融	
LI & FUNG LTD	360	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MTR CORPORATION	45	80	360	5,023	運輸	
HANG SENG BANK	16	24	408	5,687	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	49	84	331	4,626	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	40	50	280	3,913	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	184	309	476	6,647	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	30	—	—	—	不動産	
Galaxy Entertainment Group Limited	60	100	552	7,701	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	100	155	437	6,093	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	95	145	175	2,449	資本財	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45	60	136	1,898	耐久消費財・アパレル	
SINO LAND CO	118	218	264	3,689	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	40	60	724	10,095	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	20	30	229	3,205	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	—	65	407	5,676	資本財	
ATA GROUP LTD	242	408	3,361	46,865	保険	
HKT Trust / HKT Ltd	—	230	281	3,917	電気通信サービス	
Sands China Ltd	64	112	454	6,338	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	50	88	220	3,072	不動産	
WH Group Limited	—	375	327	4,563	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	58	93	700	9,771	資本財	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	25	45	255	3,556	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	58	98	544	7,589	不動産	
小計	株数・金額	1,820	3,054	12,774	178,076	
	銘柄数<比率>	24	25	—	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	65	113	46	3,736	資本財	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	33	55	146	11,744	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	20	39	42	3,405	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	110	138	32	2,646	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	30	43	40	3,216	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	24	31	83	6,704	銀行	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	30	49	38	3,126	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	70	165	38	3,098	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	137	217	72	5,833	電気通信サービス	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	65	79	87	7,056	銀行	
KEPPEL CORP LTD	56	84	58	4,664	資本財	
GENTING SINGAPORE LTD	220	341	32	2,572	消費者サービス	
小計	株数・金額	860	1,354	720	57,805	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.4%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
BANK HAPOALIM BM	30	37	106	3,326	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	51	51	133	4,157	銀行	
ISRAEL CHEMICALS LTD	35	35	57	1,803	素材	
NICE LTD	2	2	142	4,435	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	—	7	60	1,894	銀行	
小計	株数・金額	119	133	500	15,617	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	21,542	35,982	—	13,694,645	
	銘柄数<比率>	931	967	—	<95.6%>	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	%	
AMERICAN TOWER CORP	0.865	1	306	33,484	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.257	0.412	86	9,437	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	0.31	0.42	58	6,342	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	0.448	49	5,385	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	0.796	1	185	20,219	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.407	0.705	82	8,970	0.1	
DUKE REALTY CORP	1	1	55	6,018	0.0	
EQUINIX INC	0.157	0.297	157	17,192	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	—	0.841	56	6,134	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	0.704	1	102	11,184	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	0.245	77	8,422	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.342	0.591	62	6,857	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.212	0.34	44	4,879	0.0	
HCP INC	1	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	1	54	5,979	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	1	2	46	5,111	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	0.806	1	39	4,358	0.0	
KIMCO REALTY CORP	1	1	39	4,276	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.511	0.769	45	4,927	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	—	0.498	66	7,283	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	0.819	45	4,934	0.0	
PROLOGIS INC	1	2	179	19,569	0.1	
PUBLIC STORAGE	0.28	0.463	97	10,681	0.1	
REALTY INCOME CORP	0.692	0.909	69	7,572	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	0.429	0.832	53	5,872	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.227	0.43	98	10,723	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	0.265	0.346	29	3,248	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.612	0.894	138	15,076	0.1	
UDR INC	0.693	1	59	6,525	0.0	
VENTAS INC	0.692	1	65	7,136	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	0.422	0.624	41	4,479	0.0	
WP CAREY INC	—	0.771	65	7,108	0.0	
WELLTOWER INC	0.719	1	110	12,087	0.1	
WEYERHAEUSER CO	1	2	70	7,662	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	18	32	2,740	299,147	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	33	—	< 2.1% >	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.776	1	33	2,799	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.776	1	33	2,799	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	0.619	1	34	4,150	0.0	

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		
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		0.14	0.19	28	3,459	0.0
COVIVIO		0.157	0.315	31	3,821	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		0.251	0.387	55	6,654	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	1	150	18,086	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		2	4	27	3,846	0.0
HAMMERSON PLC		2	—	—	—	—
SEGRO PLC		3	5	42	5,901	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		2	3	28	3,988	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	10	13	98	13,736	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		12	16	51	3,863	0.0
GPT GROUP		4	8	50	3,782	0.0
STOCKLAND		7	10	49	3,737	0.0
DEXUS		—	4	54	4,086	0.0
GOODMAN GROUP		4	5	78	5,892	0.0
SCENTRE GROUP		14	17	68	5,144	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	44	63	354	26,506	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 0.2% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		4	6	553	7,710	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4	6	553	7,710	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		10	17	43	3,476	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	10	17	43	3,476	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	89	136	—	371,463	
	銘 柄 数 < 比 率 >	43	49	—	< 2.6% >	

(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で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

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	S&P 500 EMIN	百万円 151	百万円 —
		DJ EU STX 50	53	—
		FTSE 100 IDX	41	—

(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で邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	13,694,645	95.3
投資証券	371,463	2.6
コール・ローン等、その他	299,949	2.1
投資信託財産総額	14,366,057	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産 (14,310,779千円) の投資信託財産総額 (14,366,057千円) 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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは 1米ドル=109.16円、1カナダドル=82.52円、1ユーロ=120.25円、1英ポンド=139.65円、1スイスフラン=109.40円、1スウェーデンクローネ=11.25円、1ノルウェークローネ=11.93円、1デンマーククローネ=16.09円、1豪ドル=74.82円、1ニュージーランドドル=69.19円、1香港ドル=13.94円、1シンガポールドル=80.25円、1イスラエルシェケル=31.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	14,366,035,765	
コール・ローン等	157,361,513	
株式(評価額)	13,694,645,944	
投資証券(評価額)	371,463,072	
未収入金	16,927,394	
未収配当金	14,873,701	
差入委託証拠金	110,764,141	
(B) 負債	34,938,585	
未払解約金	34,938,461	
未払利息	124	
(C) 純資産総額(A-B)	14,331,097,180	
元本	5,410,289,257	
次期繰越損益金	8,920,807,923	
(D) 受益権総口数	5,410,289,257口	
1万口当たり基準価額(C/D)	26,489円	

(注) 当親ファンドの期首元本額は3,424,850,935円、期中追加設定元本額は2,935,401,287円、期中一部解約元本額は949,962,965円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国株式インデックス	4,760,668,283円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	390,842,991円
TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	84,180,608円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	57,500,278円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	48,019,881円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	18,337,503円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	16,104,188円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	15,396,861円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	12,395,514円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	4,200,972円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	2,125,042円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	137,310円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	133,291円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	125,269円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	121,266円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2018年11月13日～2019年11月11日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	250,729,076	
受取配当金	235,097,234	
受取利息	2,145,330	
その他収益金	13,521,010	
支払利息	△ 34,498	
(B) 有価証券売買損益	826,337,595	
売買益	1,508,832,008	
売買損	△ 682,494,413	
(C) 先物取引等取引損益	37,917,698	
取引益	86,721,054	
取引損	△ 48,803,356	
(D) 保管費用等	△ 10,821,513	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,104,162,856	
(F) 前期繰越損益金	4,954,052,717	
(G) 追加信託差損益金	4,242,250,618	
(H) 解約差損益金	△1,379,658,268	
(I) 計(E+F+G+H)	8,920,807,923	
次期繰越損益金(I)	8,920,807,923	

(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です。

(注) (H)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。