

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                                                                                                                                                       | ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>・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                                                                                                                                                        | ・株式への投資割合には、制限を設けません。<br>・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   | 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。<br>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。<br>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。 |                                                                |

# 東京海上セレクション・外国株式インデックス

## 第12期 運用報告書（全体版）

（決算日 2022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12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<br>(分配落) | 価 額        |            |            | ベンチマーク    |            | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投 資 信 託<br>証券組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-----------------|--------------|------------|------------|------------|-----------|------------|-------------|-------------|-------------------|--------------|
|                 |              | 税 込<br>分 配 | み 金<br>期 騰 | 中 率<br>落 率 | 期 騰       | 中 率<br>落 率 |             |             |                   |              |
| 8期(2018年4月16日)  | 円            |            | 円          | %          |           | %          | %           | %           | %                 | 百万円          |
|                 | 22,884       | 0          | 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          | 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       |
| 11期(2021年4月15日) | 34,680       | 0          | 0          | 50.3       | 1,652,996 | 51.4       | 94.8        | 3.3         | 2.2               | 36,390       |
| 12期(2022年4月15日) | 42,067       | 0          | 0          | 21.3       | 2,009,637 | 21.6       | 94.8        | 3.0         | 2.4               | 31,029       |

(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    | 価 額   |           | ベンチマーク | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投 資 信 託<br>証券組入比率 |
|------------|--------|-------|-----------|--------|-------------|-------------|-------------------|
|            |        | 騰 落 率 | 騰 落 率     |        |             |             |                   |
| (期 首)      | 円      | %     | %         | %      | %           | %           | %                 |
| 2021年4月15日 | 34,680 | —     | 1,652,996 | —      | 94.8        | 3.3         | 2.2               |
| 4月末        | 35,408 | 2.1   | 1,687,948 | 2.1    | 95.2        | 5.1         | 2.2               |
| 5月末        | 35,937 | 3.6   | 1,713,776 | 3.7    | 94.2        | 6.2         | 2.2               |
| 6月末        | 36,810 | 6.1   | 1,757,208 | 6.3    | 96.7        | 3.6         | 2.2               |
| 7月末        | 37,355 | 7.7   | 1,782,622 | 7.8    | 94.9        | 5.4         | 2.2               |
| 8月末        | 38,262 | 10.3  | 1,826,694 | 10.5   | 94.6        | 3.2         | 2.2               |
| 9月末        | 37,373 | 7.8   | 1,784,540 | 8.0    | 97.8        | 2.7         | 2.3               |
| 10月末       | 40,086 | 15.6  | 1,915,338 | 15.9   | 97.5        | 2.5         | 2.3               |
| 11月末       | 39,922 | 15.1  | 1,907,178 | 15.4   | 93.9        | 6.1         | 2.2               |
| 12月末       | 41,586 | 19.9  | 1,986,097 | 20.2   | 94.6        | 6.3         | 2.3               |
| 2022年1月末   | 38,711 | 11.6  | 1,847,458 | 11.8   | 98.2        | 2.1         | 2.3               |
| 2月末        | 38,435 | 10.8  | 1,836,612 | 11.1   | 94.8        | 5.2         | 2.3               |
| 3月末        | 42,499 | 22.5  | 2,031,374 | 22.9   | 94.0        | 6.2         | 2.3               |
| (期 末)      |        |       |           |        |             |             |                   |
| 2022年4月15日 | 42,067 | 21.3  | 2,009,637 | 21.6   | 94.8        | 3.0         | 2.4               |

(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。

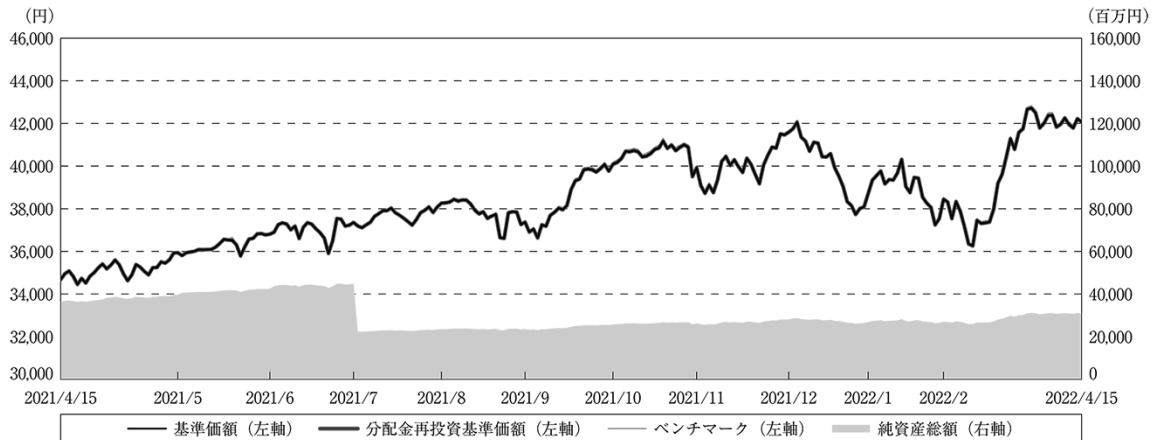
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(2021年4月16日～2022年4月15日)

## ■期中の基準価額等の推移



期 首：34,680円

期 末：42,067円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：21.3% (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(2021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

- ・米国のインフラ投資計画への期待
- ・良好な企業決算

## マイナス要因

- ・インフレ懸念を背景とした米国債利回りの上昇
- ・ロシアのウクライナ侵攻を発端とした地政学的リスクの高まり

## ■投資環境

当期の外国株式市場は上昇しました。

期初、バイデン米政権によるインフラ投資計画の発表やFRB（米連邦準備制度理事会）高官によるインフレは一時的との発言を受けて米国債利回りが低下したことなどが好感され、外国株式市場は上昇しました。その後、インフレ懸念の高まりからFRBによる早期の金融引き締め観測が台頭し、外国株式市場は下落しましたが、良好な2021年7-9月期企業決算や経済指標の改善などをを受けて、2021年末にかけて上昇基調となりました。

2022年1月以降は、FRBによる積極的な金融引き締め姿勢が確認されたことや、ロシア軍がウクライナ国境付近に部隊を展開し投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、外国株式市場は下落しましたが、期末にかけては停戦交渉進展への期待などから、値を戻す展開となりました。

## ■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、21.3%上昇しました。

### <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しました。

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1,028銘柄に対して、当期末には1,048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21.6%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ■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+21.3%となり、ベンチマークの騰落率+21.6%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<sup>(※)</sup>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

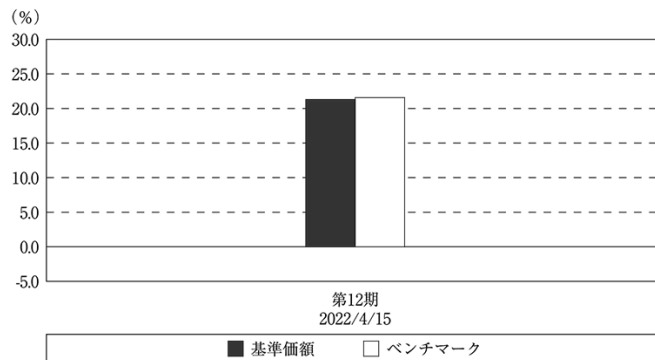
- ・特にありません

### 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、運用の効率性などを勘案して、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12期                      |
|-----------|---------------------------|
|           | 2021年4月16日～<br>2022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 | 32,067                    |

(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

(2021年4月16日～2022年4月15日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                              |
|-----------------------|---------|------------|--------------------------------------------------------|
|                       | 金 額     | 比 率        |                                                        |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>85 | %<br>0.220 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                               |
| ( 投 信 会 社 )           | ( 38 )  | (0.099)    | *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                          |
| ( 販 売 会 社 )           | ( 38 )  | (0.099)    | *購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの<br>管理および事務手続き等の対価   |
| ( 受 託 会 社 )           | ( 8 )   | (0.022)    | *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     | 6       | 0.017      | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数                      |
| ( 株 式 )               | ( 5 )   | (0.014)    | *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                      |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 )   | (0.000)    |                                                        |
| ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )   | ( 1 )   | (0.003)    |                                                        |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 6       | 0.017      | (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                      |
| ( 株 式 )               | ( 6 )   | (0.017)    | *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                       |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 )   | (0.000)    |                                                        |
| (d) そ の 他 費 用         | 16      | 0.041      | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                          |
| ( 保 管 費 用 )           | ( 14 )  | (0.036)    | *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<br>の送金・資産の移転等に要する費用 |
| ( 監 査 費 用 )           | ( 1 )   | (0.002)    | *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 )             | ( 1 )   | (0.003)    | *その他は、信託事務等に要する諸費用                                     |
| 合 計                   | 113     | 0.295      |                                                        |
| 期中の平均基準価額は、38,532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。

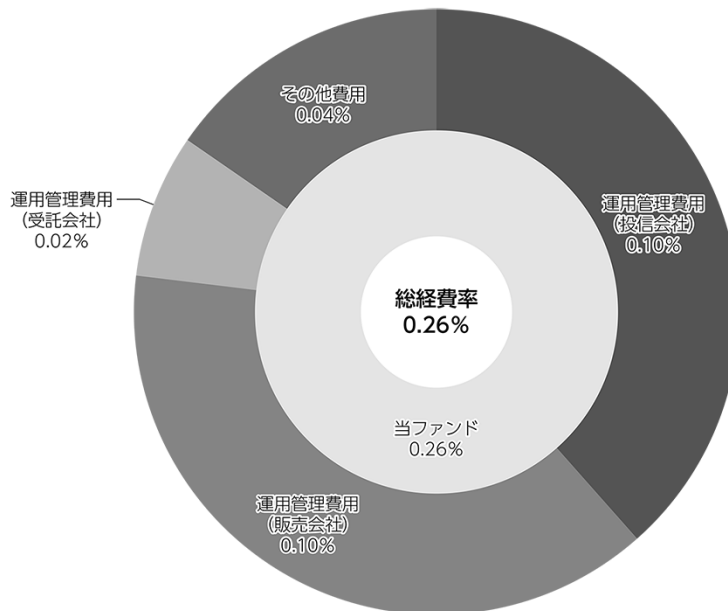
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.26%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

(2021年4月16日～2022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 |   | 4,122,172 | 15,845,690 | 7,218,534 | 27,443,370 |

## ○株式売買比率

(2021年4月16日～2022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       | 27,623,683千円         |  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 54,717,965千円         |  |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.50                 |  |

(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

(2021年4月16日～2022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

(2022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 |   | 10,371,168 | 7,274,805 | 31,029,229 |



## ○投資信託財産の構成

(2022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マザーファンド | 31,029,229 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他         | 54,200     | 0.2   |
| 投資信託財産総額             | 31,083,429 | 100.0 |

(注) TMA外国株式インデック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(78,781,866千円)の投資信託財産総額(79,218,060千円)に対する比率は99.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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=126.37円、1カナダドル=100.13円、1ユーロ=136.53円、1英ポンド=164.99円、1スイスフラン=134.07円、1スウェーデンクローナ=13.25円、1ノルウェークローネ=14.37円、1デンマーククローネ=18.36円、1豪ドル=93.51円、1ニュージーランドドル=85.59円、1香港ドル=16.11円、1シンガポールドル=93.17円、1イスラエルシェケル=39.2401円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月15日現在)

| 項 目                       | 当 期 末          |
|---------------------------|----------------|
|                           | 円              |
| (A) 資産                    | 31,083,429,529 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 31,029,229,234 |
| 未収入金                      | 54,200,295     |
| (B) 負債                    | 54,200,295     |
| 未払解約金                     | 23,898,772     |
| 未払信託報酬                    | 29,973,377     |
| その他未払費用                   | 328,146        |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 31,029,229,234 |
| 元本                        | 7,376,090,613  |
| 次期繰越損益金                   | 23,653,138,621 |
| (D) 受益権総口数                | 7,376,090,613口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 42.067円        |

(注) 当ファンドの期首元本額は10,493,211,970円、期中追加設定元本額は4,174,656,470円、期中一部解約元本額は7,291,777,827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 (2021年4月16日～2022年4月15日)

| 項 目            | 当 期               |
|----------------|-------------------|
|                | 円                 |
| (A) 有価証券売買損益   | 4,359,472,464     |
| 売買益            | 6,029,558,757     |
| 売買損            | △ 1,670,086,293   |
| (B) 信託報酬等      | △ 67,756,389      |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 4,291,716,075     |
| (D) 前期繰越損益金    | 3,809,002,667     |
| (E) 追加信託差損益金   | 15,552,419,879    |
| (配当等相当額)       | ( 12,535,150,911) |
| (売買損益相当額)      | ( 3,017,268,968)  |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 23,653,138,621    |
| (G) 収益分配金      | 0                 |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 23,653,138,621    |
| 追加信託差損益金       | 15,552,419,879    |
| (配当等相当額)       | ( 12,554,681,723) |
| (売買損益相当額)      | ( 2,997,738,156)  |
| 分配準備積立金        | 8,100,718,742     |

(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)     | 453,432,424円    |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 3,838,283,651円  |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 15,552,419,879円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 3,809,002,667円  |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)  | 23,653,138,621円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 32.067円         |
| g. 分配金              | 0円              |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 0円              |

## TMA外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2021年11月10日）

（計算期間 2020年11月11日～2021年11月10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 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------------|---------|
|                  |         | 期 騰 落 中 率 | 期 騰 落 中 率 |           |           |                 |         |
|                  | 円       | %         |           | %         | %         | %               | 百万円     |
| 12期(2017年11月10日) | 23,462  | 31.8      | 1,093,435 | 31.8      | 89.0      | 8.2             | 29,547  |
| 13期(2018年11月12日) | 24,465  | 4.3       | 1,147,119 | 4.9       | 92.4      | 5.1             | 8,378   |
| 14期(2019年11月11日) | 26,489  | 8.3       | 1,242,639 | 8.3       | 95.6      | 1.7             | 14,331  |
| 15期(2020年11月10日) | 28,804  | 8.7       | 1,357,341 | 9.2       | 94.8      | 2.8             | 27,743  |
| 16期(2021年11月10日) | 40,956  | 42.2      | 1,931,538 | 42.3      | 95.3      | 2.5             | 61,829  |

（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 証 組 入 比 率 |
|----------------------|---------|-------|-------------|-------|-----------|-----------|-------------------|
|                      |         | 騰 落 率 |             | 騰 落 率 |           |           |                   |
| (期 首)<br>2020年11月10日 | 円       | %     |             | %     | %         | %         | %                 |
|                      | 28,804  | —     | 1,357,341   | —     | 94.8      | 2.8       | 2.2               |
| 11月末                 | 29,499  | 2.4   | 1,390,283   | 2.4   | 94.7      | 5.7       | 2.2               |
| 12月末                 | 30,343  | 5.3   | 1,430,471   | 5.4   | 94.8      | 6.8       | 2.1               |
| 2021年1月末             | 30,973  | 7.5   | 1,461,431   | 7.7   | 98.3      | 2.3       | 2.2               |
| 2月末                  | 32,040  | 11.2  | 1,513,956   | 11.5  | 98.1      | 2.4       | 2.2               |
| 3月末                  | 34,208  | 18.8  | 1,611,610   | 18.7  | 98.0      | 2.8       | 2.2               |
| 4月末                  | 35,828  | 24.4  | 1,687,948   | 24.4  | 95.2      | 5.1       | 2.2               |
| 5月末                  | 36,370  | 26.3  | 1,713,776   | 26.3  | 94.2      | 6.2       | 2.2               |
| 6月末                  | 37,260  | 29.4  | 1,757,208   | 29.5  | 96.6      | 3.6       | 2.2               |
| 7月末                  | 37,818  | 31.3  | 1,782,622   | 31.3  | 94.9      | 5.4       | 2.2               |
| 8月末                  | 38,743  | 34.5  | 1,826,694   | 34.6  | 94.5      | 3.2       | 2.2               |
| 9月末                  | 37,851  | 31.4  | 1,784,540   | 31.5  | 97.6      | 2.7       | 2.3               |
| 10月末                 | 40,605  | 41.0  | 1,915,338   | 41.1  | 97.5      | 2.5       | 2.3               |
| (期 末)<br>2021年11月10日 | 40,956  | 42.2  | 1,931,538   | 42.3  | 95.3      | 2.5       | 2.2               |

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○運用経過

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## ■期中の基準価額等の推移

期 首：28,804円

期 末：40,956円

騰落率： 42.2%

## ◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新型コロナウイルスワクチンの治験において有効性が確認されたこと
- ・米国の追加経済対策やインフラ投資計画への期待
- ・良好な2021年7～9月期企業決算

マイナス要因

- ・インフレ懸念を背景とした米国債利回りの上昇
- ・中国の大手不動産開発会社の債務超過や米国の債務上限問題に対する懸念

## ■投資環境

外国株式市場は前期末対比で上昇しました。

期初から2021年2月にかけては、新型コロナウイルスワクチンの治験で有効性が確認されたことや、米国における追加経済対策の成立などが相場を下支えし、外国株式市場は上昇基調で推移しました。

3月以降は、インフレ懸念を背景とした米国債利回りの上昇が相場の重石となる局面があったものの、バイデン米政権によるインフラ投資計画の発表やFRB（米連邦準備制度理事会）高官によるインフレは一時的との発言を受けた米国債利回りの低下などが好感され、外国株式市場は上昇基調が継続しました。

9月に入ると、中国の大手不動産開発会社の債務超過や米国の債務上限問題に対する懸念から外国株式市場が下落する局面はありましたが、期末にかけて良好な7～9月期企業決算や経済指標の改善を受けて、再び上昇基調に転じました。



(注) ベンチマークは、期首（2020年11月10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

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1,027銘柄に対して、当期末には1,062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42.2%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、基準価額の騰落率は+42.2%となり、ベンチマークの騰落率+42.3%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

- ・ 配当課税や売買コストの影響

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<sup>(※)</sup>は、過去1年で0.17%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

(2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                                                                   |
|-----------------------|--------|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                                                             |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>6 | %<br>0.017 | (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<br>* 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)                 | (5)    | (0.014)    |                                                                                                             |
| (新株予約権証券)             | (0)    | (0.000)    |                                                                                                             |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                                             |
| (先物・オプション)            | (1)    | (0.003)    |                                                                                                             |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 6      | 0.018      | (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<br>* 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)    | (0.018)    |                                                                                                             |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                                                             |
| (c) そ の 他 費 用         | 16     | 0.045      | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>* 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<br>* その他は、信託事務等に要する諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (14)   | (0.041)    |                                                                                                             |
| (そ の 他)               | (2)    | (0.004)    |                                                                                                             |
| 合 計                   | 28     | 0.080      |                                                                                                             |
| 期中の平均基準価額は、35,128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

(2020年11月11日～2021年11月10日)

## 株式

|     |         | 買 付                    |                                 | 売 付                |                              |
|-----|---------|------------------------|---------------------------------|--------------------|------------------------------|
|     |         | 株 数                    | 金 額                             | 株 数                | 金 額                          |
| 外 国 | アメリカ    | 百株<br>10,935<br>(△ 80) | 千米ドル<br>129,951<br>( 560)       | 百株<br>320<br>( 27) | 千米ドル<br>1,717<br>( 823)      |
|     | カナダ     | 1,267<br>( 42)         | 千カナダドル<br>7,739<br>( 17)        | 71<br>( -)         | 千カナダドル<br>157<br>( 22)       |
|     | ユーロ     |                        | 千ユーロ                            |                    | 千ユーロ                         |
|     | ドイツ     | 1,093<br>( 12)         | 4,502<br>( 11)                  | 65<br>( -)         | 169<br>( 41)                 |
|     | イタリア    | 1,263                  | 784                             | -                  | -                            |
|     | フランス    | 913<br>( 88)           | 5,135<br>(△ 72)                 | 228<br>( -)        | 144<br>( 106)                |
|     | オランダ    | 706<br>( 51)           | 2,979<br>(△ 249)                | -<br>( -)          | -<br>( 9)                    |
|     | スペイン    | 1,715<br>( 2,555)      | 1,391<br>( 50)                  | 2,729<br>( -)      | 106<br>( 25)                 |
|     | ベルギー    | 60                     | 355                             | -                  | -                            |
|     | オーストリア  | 17                     | 59                              | 6                  | 23                           |
|     | ルクセンブルク | 179                    | 134                             | 65                 | 42                           |
|     | フィンランド  | 403                    | 632                             | -                  | -                            |
|     | アイルランド  | 57                     | 407                             | -                  | -                            |
|     | ポルトガル   | 183                    | 155                             | -                  | -                            |
|     | その他     | -<br>( 82)             | -<br>( 432)                     | -<br>( 82)         | -<br>( 432)                  |
|     | イギリス    | 10,254<br>(△ 56)       | 千英ポンド<br>5,905<br>( 502)        | 536<br>( -)        | 千英ポンド<br>199<br>( 30)        |
|     | スイス     | 591<br>( -)            | 千スイスフラン<br>4,853<br>( 0.00003)  | -<br>( -)          | 千スイスフラン<br>-<br>( 24)        |
|     | スウェーデン  | 1,020<br>( 583)        | 千スウェーデンクローナ<br>18,751<br>( 459) | 145<br>( -)        | 千スウェーデンクローナ<br>447<br>( 459) |
|     | ノルウェー   | 190                    | 千ノルウェークローネ<br>2,826             | -                  | 千ノルウェークローネ<br>-              |
|     | デンマーク   | 188<br>( 63)           | 千デンマーククローネ<br>9,215<br>( -)     | 19                 | 千デンマーククローネ<br>402            |

|        |          | 買 付                   |                            | 売 付               |                           |
|--------|----------|-----------------------|----------------------------|-------------------|---------------------------|
|        |          | 株 数                   | 金 額                        | 株 数               | 金 額                       |
| 外<br>国 | オーストラリア  | 百株<br>3,073<br>( 130) | 千豪ドル<br>5,963<br>( 53)     | 百株<br>955<br>( ー) | 千豪ドル<br>430<br>( 53)      |
|        | ニュージーランド | 645                   | 千ニュージーランドドル<br>464         | ー                 | 千ニュージーランドドル<br>ー          |
|        | 香港       | 3,603<br>( 42)        | 千香港ドル<br>13,350<br>( ー)    | 267               | 千香港ドル<br>822              |
|        | シンガポール   | 2,024<br>( 831)       | 千シンガポールドル<br>828<br>( 185) | 215<br>( 831)     | 千シンガポールドル<br>91<br>( 185) |
|        | イスラエル    | 150                   | 千イスラエルシェケル<br>660          | ー                 | 千イスラエルシェケル<br>ー           |

(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。

### 新株予約権証券

|        |     | 買 付                |                      | 売 付         |                   |
|--------|-----|--------------------|----------------------|-------------|-------------------|
|        |     | 証 券 数              | 金 額                  | 証 券 数       | 金 額               |
| 外<br>国 | スイス | 証券<br>ー<br>(5,554) | 千スイスフラン<br>ー<br>( 1) | 証券<br>5,554 | 千スイスフラン<br>0.9439 |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( )内は割当、権利行使および権利行使期間満了による増減分です。



## 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   |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC   | 0.519 | 95     | —     | —      |
|     | AMERICAN TOWER CORP                   | 1     | 417    | —     | —      |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC             | 0.455 | 90     | —     | —      |
|     | BOSTON PROPERTIES INC                 | 0.777 | 81     | —     | —      |
|     | CAMDEN PROPERTY TRUST                 | 0.204 | 27     | —     | —      |
|     | CROWN CASTLE INTL CORP                | 1     | 289    | —     | —      |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC              | 1     | 187    | —     | —      |
|     | DUKE REALTY CORP                      | 0.976 | 40     | —     | —      |
|     | EQUINIX INC                           | 0.352 | 272    | —     | —      |
|     | EQUITY RESIDENTIAL                    | 1     | 75     | —     | —      |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 0.187 | 51     | —     | —      |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC               | 0.295 | 42     | —     | —      |
|     | FEDERAL REALTY INVS TRUST             | —     | —      | 0.502 | 43     |
|     | HEALTHPEAK PROPERTIES INC             | 1     | 50     | —     | —      |
|     | HOST HOTELS & RESORTS INC             | 5     | 82     | —     | —      |
|     | INVITATION HOMES INC                  | 5     | 201    | —     | —      |
|     | IRON MOUNTAIN INC                     | 0.497 | 14     | 2     | 88     |
|     | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC          | 3     | 77     | —     | —      |
|     | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 0.135 | 19     | —     | —      |
|     | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC        | —     | —      | 1     | 55     |
|     | PROLOGIS INC                          | 2     | 319    | —     | —      |
|     | PUBLIC STORAGE                        | 0.445 | 132    | —     | —      |
|     | REALTY INCOME CORP                    | 1     | 94     | —     | —      |
|     | REGENCY CENTERS CORP                  | 0.768 | 37     | —     | —      |
|     | SBA COMMUNICATIONS CORP               | 0.358 | 116    | —     | —      |
|     | SIMON PROPERTY GROUP INC              | 1     | 173    | —     | —      |
|     | SUN COMMUNITIES INC                   | 0.428 | 71     | —     | —      |
|     | UDR INC                               | 1     | 52     | —     | —      |
|     | VENTAS INC                            | 1     | 87     | —     | —      |
|     | VICI PROPERTIES INC                   | 8     | 246    | —     | —      |
|     | VORNADO REALTY TRUST                  | 1     | 84     | —     | —      |
|     | WP CAREY INC                          | 0.501 | 37     | —     | —      |
|     | WELLTOWER INC                         | 1     | 138    | —     | —      |
|     | WEYERHAEUSER CO                       | 2     | 75     | —     | —      |
|     | 小 計                                   | 51    | 3,785  | 4     | 187    |
|     | カナダ                                   |       | 千カナダドル |       | 千カナダドル |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 2     | 39     | —     | —      |
|     | 小 計                                   | 2     | 39     | —     | —      |
|     | ユーロ                                   |       | 千ユーロ   |       | 千ユーロ   |
|     | フランス                                  |       |        |       |        |
|     | KLEPIERRE                             | 2     | 53     | —     | —      |
|     |                                       |       |        | ( — ) | ( 3 )  |

| 銘 柄 |                                        | 買 付   |           | 売 付   |           |
|-----|----------------------------------------|-------|-----------|-------|-----------|
|     |                                        | 口 数   | 金 額       | 口 数   | 金 額       |
| 外 国 | ユーロ                                    | 千口    | 千ユーロ      | 千口    | 千ユーロ      |
|     | フランス                                   |       |           |       |           |
|     | COVIVIO                                | 0.528 | 38        | —     | —         |
|     | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 0.424 | 28        | —     | —         |
|     | 小 計                                    | 3     | 120       | —     | —         |
|     |                                        |       |           | ( — ) | ( 3 )     |
|     | ユ ー ロ 計                                | 3     | 120       | —     | —         |
|     |                                        |       |           | ( — ) | ( 3 )     |
|     | イギリス                                   |       | 千英ポンド     |       | 千英ポンド     |
|     | BRITISH LAND CO PLC                    | 9     | 48        | —     | —         |
|     | SEGRO PLC                              | 1     | 14        | —     | —         |
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 5     | 41        | —     | —         |
|     | 小 計                                    | 16    | 104       | —     | —         |
|     | オーストラリア                                |       | 千豪ドル      |       | 千豪ドル      |
|     | MIRVAC GROUP                           | 10    | 27        | —     | —         |
|     | GPT GROUP                              | 3     | 13        | —     | —         |
|     | STOCKLAND                              | 4     | 20        | —     | —         |
|     | GOODMAN GROUP                          | 5     | 104       | —     | —         |
|     | SCENTRE GROUP                          | 15    | 44        | —     | —         |
|     | 小 計                                    | 39    | 209       | —     | —         |
|     | 香港                                     |       | 千香港ドル     |       | 千香港ドル     |
|     | LINK REIT                              | 2     | 197       | —     | —         |
|     | 小 計                                    | 2     | 197       | —     | —         |
|     | 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 INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 40    | 83        | —     | —         |
|     | 小 計                                    | 40    | 83        | —     | —         |

(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。

(注) ( )内は分割・償還による増減分です。

### 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<br>16,709 | 百万円<br>16,385 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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

(2020年11月11日～2021年11月10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       | 20,126,443千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 41,213,029千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.48         |

(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

(2020年11月11日～2021年11月10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

(2021年11月10日現在)

## 外国株式

| 銘<br><br>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      |                        |
| AFLAC INC                    | 30      | 46    | 261   | 29,459  | 保険                     |
| AES CORPORATION              | —       | 78    | 187   | 21,143  | 公益事業                   |
| AT&T INC                     | 405     | 660   | 1,632 | 184,281 | 電気通信サービス               |
| ABBOTT LABORATORIES          | 105     | 164   | 2,077 | 234,480 | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                   | 104     | 164   | 1,905 | 215,039 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABIOMED INC                  | 3       | 5     | 202   | 22,883  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 47      | 74    | 497   | 56,145  | メディア・娯楽                |
| ADOBE INC                    | 28      | 44    | 3,002 | 338,915 | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 4       | 7     | 184   | 20,850  | 小売                     |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 71      | 115   | 1,727 | 194,928 | 半導体・半導体製造装置            |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 18      | 27    | 433   | 48,932  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 12      | 19    | 626   | 70,662  | 素材                     |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 11      | 18    | 204   | 23,084  | ソフトウェア・サービス            |
| ALBEMARLE CORP               | 7       | 13    | 370   | 41,802  | 素材                     |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 14      | —     | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 4       | 7     | 547   | 61,789  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLEGHANY CORP               | 0.84    | 1     | 86    | 9,763   | 保険                     |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 19      | 23    | 129   | 14,613  | 公益事業                   |
| ALLSTATE CORP                | 13      | 21    | 250   | 28,249  | 保険                     |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 9       | 14    | 266   | 30,056  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘<br>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                 |                        |
| ALPHABET INC-CL C            |         | 17    | 26     | 8,047     | 908,238            | メディア・娯楽                |
| ALPHABET INC-CL A            |         | 17    | 27     | 8,220     | 927,743            | メディア・娯楽                |
| ALTRIA GROUP INC             |         | 105   | 167    | 750       | 84,661             | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC               |         | 24    | 41     | 14,952    | 1,687,507          | 小売                     |
| AMEREN CORPORATION           |         | 14    | 21     | 181       | 20,505             | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      |         | 26    | 38     | 317       | 35,828             | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY     |         | 38    | 64     | 1,167     | 131,720            | 各種金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC |         | 7     | 10     | 150       | 17,008             | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP |         | 51    | 84     | 499       | 56,335             | 保険                     |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  |         | 10    | 18     | 307       | 34,648             | 公益事業                   |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       |         | 11    | 18     | 228       | 25,776             | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |         | 7     | 9      | 299       | 33,755             | 各種金融                   |
| AMETEK INC                   |         | 10    | 15     | 216       | 24,473             | 資本財                    |
| AMGEN INC                    |         | 34    | 52     | 1,108     | 125,130            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A           |         | 15    | 45     | 374       | 42,247             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ANALOG DEVICES               |         | 21    | 49     | 910       | 102,725            | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                    |         | 5     | 9      | 403       | 45,497             | ソフトウェア・サービス            |
| ANTHEM INC                   |         | 14    | 22     | 965       | 108,931            | ヘルスケア機器・サービス           |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC |         | 16    | 26     | 200       | 22,635             | 各種金融                   |
| APPLE INC                    | 1,016   | 1,530 | 23,085 | 2,605,434 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |                        |
| APPLIED MATERIALS INC        |         | 53    | 84     | 1,325     | 149,595            | 半導体・半導体製造装置            |
| ARAMARK                      |         | 23    | 40     | 157       | 17,751             | 消費者サービス                |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |         | 28    | 46     | 301       | 34,030             | 食品・飲料・タバコ              |
| ARISTA NETWORKS INC          |         | 3     | 6      | 335       | 37,840             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ASSURANT INC                 |         | 5     | 6      | 104       | 11,841             | 保険                     |
| ATMOS ENERGY CORP            |         | 8     | 12     | 113       | 12,792             | 公益事業                   |
| AUTODESK INC                 |         | 13    | 22     | 741       | 83,683             | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOLIV INC                  |         | 6     | 10     | 103       | 11,721             | 自動車・自動車部品              |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    |         | 24    | 37     | 860       | 97,158             | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOZONE INC                 |         | 1     | 2      | 378       | 42,759             | 小売                     |
| AVANTOR INC                  |         | —     | 67     | 262       | 29,570             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVERY DENNISON CORP          |         | 5     | 8      | 181       | 20,507             | 素材                     |
| BAKER HUGHES COMPANY         |         | 48    | 89     | 225       | 25,395             | エネルギー                  |
| BALL CORP                    |         | 19    | 30     | 275       | 31,142             | 素材                     |
| BANK OF AMERICA CORP         |         | 452   | 714    | 3,347     | 377,821            | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |         | 43    | 74     | 434       | 49,016             | 各種金融                   |
| BAXTER INTL INC              |         | 28    | 44     | 342       | 38,663             | ヘルスケア機器・サービス           |
| BECTON DICKINSON & CO        |         | 17    | 26     | 653       | 73,726             | ヘルスケア機器・サービス           |
| WR BERKLEY CORP              |         | 10    | 12     | 100       | 11,316             | 保険                     |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |         | 79    | 119    | 3,410     | 384,868            | 各種金融                   |
| BEST BUY COMPANY INC         |         | 14    | 24     | 319       | 36,023             | 小売                     |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       |         | —     | 2      | 186       | 21,068             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  |         | 15    | 25     | 207       | 23,388             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC                   |         | 9     | 15     | 409       | 46,261             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP              |         | —     | 4      | 245       | 27,655             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACK KNIGHT INC             |         | —     | 22     | 173       | 19,558             | ソフトウェア・サービス            |
| BLACKROCK INC                |         | 8     | 13     | 1,286     | 145,221            | 各種金融                   |
| BLACKSTONE INC               |         | 39    | 66     | 969       | 109,455            | 各種金融                   |

| 銘<br>柄                         | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |         | 業 種 等                  |
|--------------------------------|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                                |         | 株 数   | 株 数   | 評 価 額   |                        |
|                                |         |       |       | 外貨建金額   |                        |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| BOEING CO                      | 32      | 54    | 1,198 | 135,306 | 資本財                    |
| BOOKING HOLDINGS INC           | 2       | 4     | 1,075 | 121,343 | 消費者サービス                |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS   | —       | 18    | 158   | 17,840  | 商業・専門サービス              |
| BORGWARNER INC                 | 19      | 26    | 124   | 14,090  | 自動車・自動車部品              |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 83      | 134   | 575   | 64,992  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO        | 135     | 213   | 1,267 | 143,104 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 8       | 10    | 189   | 21,377  | ソフトウェア・サービス            |
| BROADCOM INC                   | 24      | 37    | 2,083 | 235,193 | 半導体・半導体製造装置            |
| BROWN & BROWN INC              | —       | 35    | 220   | 24,889  | 保険                     |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B      | 18      | 26    | 195   | 22,067  | 食品・飲料・タバコ              |
| BURLINGTON STORES INC          | —       | 8     | 261   | 29,551  | 小売                     |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC        | 8       | 12    | 165   | 18,719  | 各種金融                   |
| CBRE GROUP INC - A             | 22      | 33    | 357   | 40,371  | 不動産                    |
| CDK GLOBAL INC                 | 11      | —     | —     | —       | ソフトウェア・サービス            |
| CDW CORP/DE                    | 9       | 13    | 243   | 27,439  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC     | 17      | 23    | 147   | 16,631  | 素材                     |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 9       | 10    | 97    | 11,011  | 運輸                     |
| CIGNA CORP                     | 22      | 31    | 683   | 77,105  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CME GROUP INC                  | 20      | 33    | 741   | 83,706  | 各種金融                   |
| CMS ENERGY CORP                | 16      | 24    | 147   | 16,636  | 公益事業                   |
| CSX CORP                       | 40      | 191   | 679   | 76,635  | 運輸                     |
| CVS HEALTH CORPORATION         | 75      | 116   | 1,082 | 122,182 | ヘルスケア機器・サービス           |
| CABOT OIL & GAS CORP           | 24      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 18      | 29    | 542   | 61,211  | ソフトウェア・サービス            |
| CAMPBELL SOUP CO               | 13      | 21    | 88    | 10,002  | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP     | 28      | 45    | 702   | 79,231  | 各種金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC            | 21      | 33    | 165   | 18,624  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARMAX INC                     | 12      | 20    | 314   | 35,442  | 小売                     |
| CARLYLE GROUP INC/THE          | —       | 25    | 148   | 16,773  | 各種金融                   |
| CARRIER GLOBAL CORP            | 53      | 79    | 434   | 48,998  | 資本財                    |
| CATALENT INC                   | —       | 21    | 263   | 29,776  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC                | 31      | 51    | 1,078 | 121,758 | 資本財                    |
| CELANESE CORP-SERIES A         | 8       | 10    | 181   | 20,470  | 素材                     |
| CENTENE CORP                   | 36      | 59    | 448   | 50,622  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 38      | 65    | 173   | 19,628  | 公益事業                   |
| CERNER CORP                    | 14      | 17    | 129   | 14,588  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHARLES RIVER LABORATORIES     | —       | 6     | 241   | 27,307  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A   | 9       | 11    | 830   | 93,673  | メディア・娯楽                |
| CHEVRONTXACO CORP              | 110     | 171   | 1,991 | 224,733 | エネルギー                  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A    | 1       | 3     | 544   | 61,448  | 消費者サービス                |
| CHURCH & DWIGHT CO INC         | 16      | 24    | 224   | 25,287  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP      | 10      | 15    | 189   | 21,425  | 保険                     |
| CISCO SYSTEMS INC              | 237     | 373   | 2,143 | 241,940 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CINTAS CORP                    | 5       | 7     | 333   | 37,676  | 商業・専門サービス              |
| CITIGROUP INC                  | 119     | 190   | 1,294 | 146,085 | 銀行                     |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP       | 34      | 42    | 203   | 22,947  | 銀行                     |
| CITRIX SYSTEMS INC             | 8       | 15    | 138   | 15,662  | ソフトウェア・サービス            |
| CLOROX COMPANY                 | 8       | 14    | 246   | 27,808  | 家庭用品・パーソナル用品           |

| 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   |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | —       | 18    | 368   | 41,564  | ソフトウェア・サービス            |
| COCA-COLA COMPANY            | 233     | 362   | 2,045 | 230,829 | 食品・飲料・タバコ              |
| COGNEX CORP                  | 11      | 19    | 163   | 18,441  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 31      | 46    | 373   | 42,169  | ソフトウェア・サービス            |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 43      | 64    | 499   | 56,428  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| COMCAST CORP-CL A            | 265     | 419   | 2,253 | 254,356 | メディア・娯楽                |
| COMERICA INC                 | 15      | —     | —     | —       | 銀行                     |
| CONAGRA BRANDS INC           | 29      | 49    | 162   | 18,292  | 食品・飲料・タバコ              |
| CONCHO RESOURCES INC         | 14      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| CONOCOPHILLIPS               | 60      | 130   | 987   | 111,480 | エネルギー                  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 18      | 29    | 229   | 25,956  | 公益事業                   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 9       | 15    | 337   | 38,046  | 食品・飲料・タバコ              |
| COOPER COS INC/THE           | 3       | 4     | 180   | 20,407  | ヘルスケア機器・サービス           |
| COPART INC                   | 12      | 21    | 339   | 38,318  | 商業・専門サービス              |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 8       | 10    | 126   | 14,293  | ソフトウェア・サービス            |
| CORNING INC                  | 43      | 71    | 275   | 31,040  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CORTEVA INC                  | 43      | 65    | 312   | 35,280  | 素材                     |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 25      | 39    | 2,031 | 229,307 | 食品・生活必需品小売り            |
| COSTAR GROUP INC             | 2       | 40    | 335   | 37,901  | 商業・専門サービス              |
| COUPA SOFTWARE INC           | 5       | 9     | 234   | 26,494  | ソフトウェア・サービス            |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A   | 10      | 19    | 583   | 65,812  | ソフトウェア・サービス            |
| CROWN HOLDINGS INC           | —       | 13    | 139   | 15,740  | 素材                     |
| CUMMINS INC                  | 7       | 11    | 271   | 30,656  | 資本財                    |
| DR HORTON INC                | 22      | 33    | 326   | 36,881  | 耐久消費財・アパレル             |
| DTE ENERGY COMPANY           | 10      | 17    | 196   | 22,155  | 公益事業                   |
| DANAHER CORP                 | 38      | 60    | 1,818 | 205,199 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 11      | 17    | 264   | 29,890  | 消費者サービス                |
| DAVITA INC                   | 6       | 9     | 97    | 11,054  | ヘルスケア機器・サービス           |
| DEERE & CO                   | 17      | 28    | 1,010 | 114,004 | 資本財                    |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | —       | 28    | 158   | 17,860  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 18      | 24    | 139   | 15,729  | ヘルスケア機器・サービス           |
| DEVON ENERGY CORPORATION     | —       | 70    | 307   | 34,752  | エネルギー                  |
| DEXCOM INC                   | 6       | 10    | 647   | 73,047  | ヘルスケア機器・サービス           |
| THE WALT DISNEY CO           | 107     | 170   | 2,991 | 337,590 | メディア・娯楽                |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 23      | 32    | 375   | 42,383  | 各種金融                   |
| DISCOVERY INC-A              | 14      | 41    | 109   | 12,379  | メディア・娯楽                |
| DISCOVERY INC-C              | 30      | 30    | 77    | 8,732   | メディア・娯楽                |
| DISH NETWORK CORPORATION     | 20      | 26    | 95    | 10,820  | メディア・娯楽                |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 3       | 3     | 108   | 12,268  | 保険                     |
| DOCUSIGN INC                 | 11      | 20    | 562   | 63,508  | ソフトウェア・サービス            |
| Dollar General Corp          | 15      | 22    | 491   | 55,513  | 小売                     |
| DOLLAR TREE INC              | 14      | 25    | 285   | 32,201  | 小売                     |
| DOMINION ENERGY INC          | 48      | 73    | 545   | 61,613  | 公益事業                   |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 2       | 4     | 213   | 24,135  | 消費者サービス                |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 45      | —     | —     | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| DOVER CORP                   | 9       | 12    | 213   | 24,050  | 資本財                    |
| DOW INC                      | 45      | 69    | 407   | 45,974  | 素材                     |
| DUKE ENERGY CORP             | 41      | 64    | 656   | 74,048  | 公益事業                   |

| 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             |
| (アメリカ)                                 |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                    |
| DUPONT DE NEMOURS INC                  |   | 45      | 53    | 432   | 48,810  | 素材                 |
| DYNATRACE INC                          |   | —       | 26    | 199   | 22,536  | ソフトウェア・サービス        |
| EOG RESOURCES INC                      |   | 33      | 60    | 586   | 66,153  | エネルギー              |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             |   | 4       | 6     | 97    | 11,055  | 保険                 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 |   | —       | 34    | 142   | 16,124  | 保険                 |
| EAST WEST BANCORP INC                  |   | 8       | —     | —     | —       | 銀行                 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               |   | 10      | 14    | 159   | 17,978  | 素材                 |
| EBAY INC                               |   | 43      | 63    | 473   | 53,388  | 小売                 |
| ECOLAB INC                             |   | 13      | 20    | 471   | 53,198  | 素材                 |
| BUNGE LIMITED                          |   | 12      | 16    | 150   | 16,993  | 食品・飲料・タバコ          |
| EDISON INTERNATIONAL                   |   | 22      | 39    | 256   | 28,966  | 公益事業               |
| Edwards Lifesciences Corp              |   | 36      | 58    | 704   | 79,484  | ヘルスケア機器・サービス       |
| ELECTRONIC ARTS INC                    |   | 17      | 26    | 375   | 42,376  | メディア・娯楽            |
| EMERSON ELECTRIC CO                    |   | 30      | 48    | 476   | 53,753  | 資本財                |
| ENPHASE ENERGY INC                     |   | —       | 12    | 287   | 32,421  | 半導体・半導体製造装置        |
| ENTERGY CORP                           |   | 12      | 21    | 219   | 24,758  | 公益事業               |
| EPAM SYSTEMS INC                       |   | 4       | 6     | 451   | 50,904  | ソフトウェア・サービス        |
| EQUIFAX INC                            |   | 7       | 12    | 363   | 40,970  | 商業・専門サービス          |
| EQUITABLE HOLDINGS INC                 |   | 35      | 54    | 189   | 21,382  | 各種金融               |
| ESSENTIAL UTILITIES INC                |   | 19      | 33    | 159   | 17,997  | 公益事業               |
| ETSY INC                               |   | —       | 14    | 377   | 42,651  | 小売                 |
| EVERGY INC                             |   | 18      | 27    | 178   | 20,103  | 公益事業               |
| EVERSOURCE ENERGY                      |   | 19      | 32    | 273   | 30,881  | 公益事業               |
| EXELON CORP                            |   | 51      | 75    | 408   | 46,089  | 公益事業               |
| EXPEDIA GROUP INC                      |   | 10      | 17    | 328   | 37,067  | 消費者サービス            |
| EXPEDITORS INTL WASH INC               |   | 10      | 12    | 154   | 17,463  | 運輸                 |
| EXXON MOBIL CORPORATION                |   | 236     | 389   | 2,581 | 291,382 | エネルギー              |
| FLIR SYSTEMS INC                       |   | 9       | —     | —     | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FMC CORP                               |   | —       | 13    | 139   | 15,697  | 素材                 |
| META PLATFORMS INC-A                   |   | 142     | 221   | 7,444 | 840,153 | メディア・娯楽            |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC           |   | 2       | 2     | 126   | 14,237  | 各種金融               |
| FAIR ISAAC CORP                        |   | —       | 4     | 166   | 18,773  | ソフトウェア・サービス        |
| FASTENAL CO                            |   | 31      | 39    | 235   | 26,533  | 資本財                |
| FEDEX CORP                             |   | 15      | 23    | 586   | 66,223  | 運輸                 |
| F5 NETWORKS INC                        |   | 4       | 6     | 135   | 15,299  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES |   | 37      | 62    | 725   | 81,879  | ソフトウェア・サービス        |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL            |   | 17      | 26    | 134   | 15,215  | 保険                 |
| FIFTH THIRD BANCORP                    |   | 50      | 74    | 326   | 36,872  | 銀行                 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA                 |   | 9       | 14    | 323   | 36,460  | 銀行                 |
| FISERV INC                             |   | 34      | 61    | 614   | 69,347  | ソフトウェア・サービス        |
| FIRSTENERGY CORP                       |   | 42      | 56    | 217   | 24,569  | 公益事業               |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC              |   | 4       | 7     | 190   | 21,541  | ソフトウェア・サービス        |
| FORD MOTOR CO                          |   | 231     | 383   | 771   | 87,044  | 自動車・自動車部品          |
| FORTINET INC                           |   | 9       | 15    | 523   | 59,092  | ソフトウェア・サービス        |
| FORTIVE CORP                           |   | 17      | 26    | 209   | 23,658  | 資本財                |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI           |   | 11      | 16    | 167   | 18,915  | 資本財                |
| FOX CORP-CLASS A                       |   | 26      | 32    | 132   | 14,933  | メディア・娯楽            |
| FOX CORP-CLASS B                       |   | 15      | 31    | 120   | 13,572  | メディア・娯楽            |

| 銘柄                            | 株数  | 期首(前期末) | 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      |                        |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 17  | 36      | 129   | 14,670  | 各種金融                   |
| FREEPORT-MCMORAN INC          | 105 | 153     | 600   | 67,777  | 素材                     |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 11  | 18      | 300   | 33,951  | 保険                     |
| GARTNER INC                   | 7   | 9       | 330   | 37,302  | ソフトウェア・サービス            |
| GENERAC HOLDINGS INC          | —   | 7       | 321   | 36,333  | 資本財                    |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 12  | 20      | 417   | 47,076  | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO           | 523 | —       | —     | —       | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO           | —   | 104     | 1,166 | 131,605 | 資本財                    |
| GENERAL MILS INC              | 34  | 51      | 322   | 36,381  | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL MOTORS CO             | 76  | 122     | 715   | 80,766  | 自動車・自動車部品              |
| GENUINE PARTS CO              | 10  | 15      | 207   | 23,431  | 小売                     |
| GILEAD SCIENCES INC           | 74  | 113     | 751   | 84,869  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC           | 18  | 31      | 421   | 47,608  | ソフトウェア・サービス            |
| GLOBE LIFE INC                | 6   | 8       | 76    | 8,608   | 保険                     |
| GODADDY INC - CLASS A         | 14  | 25      | 184   | 20,872  | ソフトウェア・サービス            |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 18  | 30      | 1,235 | 139,485 | 各種金融                   |
| WW GRAINGER INC               | 2   | 3       | 154   | 17,412  | 資本財                    |
| HCA HEALTHCARE INC            | 16  | 24      | 607   | 68,615  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC        | 12  | —       | —     | —       | 資本財                    |
| HP INC                        | 83  | 119     | 379   | 42,815  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HALLIBURTON CO                | 60  | 81      | 205   | 23,201  | エネルギー                  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   | 22  | 32      | 232   | 26,284  | 保険                     |
| HASBRO INC                    | 9   | 15      | 149   | 16,882  | 耐久消費財・アパレル             |
| HEICO CORP                    | —   | 12      | 166   | 18,826  | 資本財                    |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 5   | 6       | 107   | 12,079  | ソフトウェア・サービス            |
| HERSHEY CO/THE                | 7   | 11      | 195   | 22,110  | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                     | 20  | 33      | 287   | 32,404  | エネルギー                  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 82  | 148     | 230   | 25,964  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 18  | 30      | 454   | 51,270  | 消費者サービス                |
| HOME DEPOT INC                | 62  | 97      | 3,596 | 405,849 | 小売                     |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   | 39  | 61      | 1,395 | 157,513 | 資本財                    |
| HORMEL FOODS CORP             | 19  | 28      | 121   | 13,721  | 食品・飲料・タバコ              |
| HOWMET AEROSPACE INC          | —   | 51      | 171   | 19,315  | 資本財                    |
| HUMANA INC                    | 8   | 11      | 508   | 57,338  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   | 5   | 8       | 169   | 19,086  | 運輸                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 91  | 172     | 273   | 30,842  | 銀行                     |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE  | 2   | 3       | 68    | 7,692   | 資本財                    |
| IAC/INTERACTIVECORP           | 7   | —       | —     | —       | メディア・娯楽                |
| IAC/INTERACTIVECORP           | —   | 12      | 171   | 19,325  | メディア・娯楽                |
| IDEX CORP                     | 5   | 7       | 181   | 20,496  | 資本財                    |
| IDEX LABORATORIES INC         | 5   | 8       | 508   | 57,382  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC       | 16  | 25      | 603   | 68,083  | 資本財                    |
| ILLUMINA INC                  | 9   | 14      | 578   | 65,234  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP                   | 13  | 27      | 180   | 20,415  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGERSOLL-RAND INC            | 24  | 50      | 301   | 34,066  | 資本財                    |
| INGREDION INC                 | 5   | —       | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| INTEL CORP                    | 246 | 370     | 1,895 | 213,969 | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 31  | 48      | 660   | 74,585  | 各種金融                   |



| 銘柄                           | 株数  | 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           |                        |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 50  | 81      |     | 986   | 111,308      | ソフトウェア・サービス            |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 5   | 24      |     | 378   | 42,718       | 素材                     |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 21  | 32      |     | 161   | 18,186       | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC    | 37  | 52      |     | 190   | 21,478       | メディア・娯楽                |
| INTUIT INC                   | 15  | 26      |     | 1,608 | 181,540      | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 7   | 34      |     | 1,253 | 141,500      | ヘルスケア機器・サービス           |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 12  | 18      |     | 471   | 53,170       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 175 | 276     |     | 4,644 | 524,138      | 銀行                     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 8   | 15      |     | 223   | 25,263       | 商業・専門サービス              |
| JOHNSON & JOHNSON            | 153 | 236     |     | 3,851 | 434,660      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 19  | 27      |     | 86    | 9,751        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KLA CORPORATION              | 9   | 15      |     | 627   | 70,847       | 半導体・半導体製造装置            |
| KKR & CO INC                 | —   | 55      |     | 440   | 49,737       | 各種金融                   |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 6   | 10      |     | 324   | 36,655       | 運輸                     |
| KELLOGG CO                   | 13  | 26      |     | 164   | 18,511       | 食品・飲料・タバコ              |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 32  | 86      |     | 308   | 34,784       | 食品・飲料・タバコ              |
| KEYCORP                      | 77  | 88      |     | 209   | 23,593       | 銀行                     |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 11  | 16      |     | 312   | 35,281       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 19  | 26      |     | 350   | 39,571       | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KINDER MORGAN INC            | 101 | 165     |     | 278   | 31,441       | エネルギー                  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 10  | 18      |     | 112   | 12,712       | 運輸                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 37  | 64      |     | 242   | 27,340       | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                    | 45  | 70      |     | 295   | 33,329       | 食品・生活必需品小売り            |
| KYNDRYL HOLDINGS INC-W/I     | —   | 16      |     | 33    | 3,836        | ソフトウェア・サービス            |
| LKQ CORP                     | 23  | 34      |     | 199   | 22,552       | 小売                     |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 12  | 19      |     | 446   | 50,419       | 資本財                    |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 6   | 8       |     | 234   | 26,467       | ヘルスケア機器・サービス           |
| LAM RESEARCH CORP            | 9   | 13      |     | 820   | 92,578       | 半導体・半導体製造装置            |
| LAMB WESTON HOLDING INC      | 11  | 22      |     | 134   | 15,231       | 食品・飲料・タバコ              |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 23  | 50      |     | 206   | 23,311       | 消費者サービス                |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 13  | 21      |     | 751   | 84,764       | 家庭用品・パーソナル用品           |
| LEAR CORP                    | 4   | 7       |     | 131   | 14,883       | 自動車・自動車部品              |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 10  | 15      |     | 142   | 16,116       | 商業・専門サービス              |
| LENNAR CORP-CL A             | 19  | 29      |     | 316   | 35,710       | 耐久消費財・アパレル             |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 2   | 3       |     | 93    | 10,516       | 資本財                    |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 8   | 18      |     | 309   | 34,971       | メディア・娯楽                |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 18  | 26      |     | 144   | 16,314       | メディア・娯楽                |
| ELI LILLY & CO               | 52  | 76      |     | 1,995 | 225,246      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 17  | 25      |     | 185   | 20,936       | 保険                     |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 14  | 20      |     | 700   | 79,079       | 資本財                    |
| LOEWS CORP                   | 17  | 27      |     | 160   | 18,129       | 保険                     |
| LOWE'S COMPANIES             | 45  | 66      |     | 1,564 | 176,557      | 小売                     |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 7   | 12      |     | 576   | 65,118       | 耐久消費財・アパレル             |
| M & T BANK CORP              | 6   | 8       |     | 137   | 15,564       | 銀行                     |
| MSCI INC                     | 5   | 7       |     | 515   | 58,205       | 各種金融                   |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 42  | 63      |     | 426   | 48,147       | エネルギー                  |
| MARKEL CORP                  | —   | 1       |     | 143   | 16,193       | 保険                     |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 2   | 4       |     | 165   | 18,659       | 各種金融                   |

| 銘<br>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        |                        |
| MARSH & MCLENNAN COS             | 28      | 44    | 739    | 83,497    | 保険                     |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A      | 20      | 30    | 495    | 55,917    | 消費者サービス                |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS        | 4       | 6     | 256    | 29,002    | 素材                     |
| MARVELL TECHNOLOGY INC           | —       | 85    | 626    | 70,729    | 半導体・半導体製造装置            |
| MASCO CORP                       | 17      | 20    | 135    | 15,257    | 資本財                    |
| MASIMO CORP                      | 4       | 6     | 195    | 22,086    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MASTERCARD INC-CLASS A           | 52      | 82    | 2,829  | 319,307   | ソフトウェア・サービス            |
| MATCH GROUP INC                  | 16      | 28    | 435    | 49,202    | メディア・娯楽                |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS        | 15      | —     | —      | —         | 半導体・半導体製造装置            |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS      | 7       | 24    | 195    | 22,089    | 食品・飲料・タバコ              |
| MCDONALD'S CORP                  | 44      | 71    | 1,798  | 203,020   | 消費者サービス                |
| MCKESSON CORP                    | 9       | 14    | 317    | 35,790    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCADOLIBRE INC                 | 2       | 4     | 784    | 88,581    | 小売                     |
| MERCK & CO. INC.                 | 148     | 232   | 1,921  | 216,832   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METLIFE INC                      | 40      | 62    | 394    | 44,467    | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 1       | 2     | 316    | 35,683    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICROSOFT CORP                   | 423     | 658   | 22,114 | 2,495,889 | ソフトウェア・サービス            |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC         | 16      | 56    | 466    | 52,612    | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY INC            | 66      | 108   | 823    | 92,946    | 半導体・半導体製造装置            |
| MODERNA INC                      | 19      | 33    | 791    | 89,307    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC            | 4       | 6     | 107    | 12,101    | 耐久消費財・アパレル             |
| MOLINA HEALTHCARE INC            | —       | 6     | 195    | 22,023    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B  | 12      | 27    | 125    | 14,129    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC       | 78      | 116   | 726    | 82,002    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC     | —       | 5     | 297    | 33,605    | 半導体・半導体製造装置            |
| MONSTER BEVERAGE CORP            | 21      | 29    | 275    | 31,057    | 食品・飲料・タバコ              |
| MOODY'S CORP                     | 10      | 14    | 560    | 63,313    | 各種金融                   |
| MORGAN STANLEY                   | 83      | 128   | 1,282  | 144,717   | 各種金融                   |
| MOSAIC CO/THE                    | 41      | 43    | 163    | 18,491    | 素材                     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC           | 9       | 14    | 353    | 39,889    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NRG ENERGY INC                   | 16      | 29    | 101    | 11,466    | 公益事業                   |
| NVR INC                          | 0.26    | 0.37  | 192    | 21,715    | 耐久消費財・アパレル             |
| NASDAQ INC                       | 8       | 10    | 213    | 24,053    | 各種金融                   |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC       | 33      | —     | —      | —         | エネルギー                  |
| NETAPP INC                       | 12      | 22    | 208    | 23,508    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NETFLIX INC                      | 26      | 41    | 2,695  | 304,209   | メディア・娯楽                |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC       | 7       | 15    | 144    | 16,293    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD       | —       | 26    | 154    | 17,403    | 資本財                    |
| NEWELL BRANDS INC                | 31      | 39    | 97     | 10,985    | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWMONT CORPORATION              | 52      | 67    | 385    | 43,488    | 素材                     |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I           | 38      | 61    | 146    | 16,577    | メディア・娯楽                |
| NEXTERA ENERGY INC               | 116     | 180   | 1,536  | 173,455   | 公益事業                   |
| NIKE INC -CL B                   | 73      | 115   | 2,014  | 227,384   | 耐久消費財・アパレル             |
| NISOURCE INC                     | 32      | 45    | 113    | 12,853    | 公益事業                   |
| NORDSON CORP                     | 4       | 5     | 132    | 14,897    | 資本財                    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP            | 14      | 22    | 635    | 71,691    | 運輸                     |
| NORTHERN TRUST CORP              | 13      | 20    | 247    | 27,939    | 各種金融                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP            | 8       | 12    | 469    | 52,987    | 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      |                        |
| NORTONLIFELOCK INC            | 39      | 60    | 152   | 17,218       | ソフトウェア・サービス            |
| NUCOR CORP                    | 23      | 29    | 339   | 38,292       | 素材                     |
| NVIDIA CORP                   | 36      | 231   | 7,094 | 800,666      | 半導体・半導体製造装置            |
| OGE ENERGY CORP               | 17      | —     | —     | —            | 公益事業                   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC       | 4       | 6     | 394   | 44,515       | 小売                     |
| OKTA INC                      | 8       | 14    | 384   | 43,388       | ソフトウェア・サービス            |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | 6       | 8     | 297   | 33,603       | 運輸                     |
| OMNICOM GROUP                 | —       | 21    | 148   | 16,724       | メディア・娯楽                |
| ONEOK INC                     | 29      | 46    | 298   | 33,668       | エネルギー                  |
| ORACLE CORPORATION            | 119     | 172   | 1,626 | 183,617      | ソフトウェア・サービス            |
| OTIS WORLDWIDE CORP           | 22      | 34    | 289   | 32,622       | 資本財                    |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  | 22      | 36    | 765   | 86,432       | 銀行                     |
| PPG INDUSTRIES INC            | 12      | 19    | 315   | 35,640       | 素材                     |
| PPL CORPORATION               | 43      | 77    | 221   | 25,010       | 公益事業                   |
| PTC INC                       | —       | 15    | 188   | 21,323       | ソフトウェア・サービス            |
| PACCAR INC                    | 19      | 32    | 282   | 31,858       | 資本財                    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     | 6       | 7     | 106   | 12,024       | 素材                     |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 6       | 10    | 534   | 60,306       | ソフトウェア・サービス            |
| PARKER HANNIFIN CORP          | 7       | 11    | 387   | 43,704       | 資本財                    |
| PAYCHEX INC                   | 15      | 24    | 295   | 33,363       | ソフトウェア・サービス            |
| PAYCOM SOFTWARE INC           | 3       | 6     | 306   | 34,640       | ソフトウェア・サービス            |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 67      | 105   | 2,163 | 244,170      | ソフトウェア・サービス            |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A     | —       | 31    | 156   | 17,674       | 耐久消費財・アパレル             |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL     | 29      | —     | —     | —            | 銀行                     |
| PEPSICO INC                   | 78      | 122   | 1,996 | 225,338      | 食品・飲料・タバコ              |
| PERKINELMER INC               | 9       | 12    | 226   | 25,570       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PFIZER INC                    | 325     | 515   | 2,435 | 274,926      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 89      | 137   | 1,284 | 144,968      | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILLIPS 66                   | 22      | 44    | 356   | 40,199       | エネルギー                  |
| PINNACLE WEST CAPITAL         | 8       | 14    | 90    | 10,247       | 公益事業                   |
| PINTEREST INC- CLASS A        | —       | 65    | 305   | 34,456       | メディア・娯楽                |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 11      | 24    | 454   | 51,251       | エネルギー                  |
| POOL CORP                     | —       | 4     | 229   | 25,898       | 小売                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 12      | 18    | 397   | 44,896       | 各種金融                   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 21      | 32    | 224   | 25,317       | 保険                     |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 144     | 219   | 3,188 | 359,859      | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PROGRESSIVE CORP              | 33      | 50    | 484   | 54,713       | 保険                     |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 19      | 39    | 429   | 48,429       | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP  | 28      | 35    | 220   | 24,855       | 公益事業                   |
| PULTE HOMES INC               | 19      | 29    | 151   | 17,042       | 耐久消費財・アパレル             |
| QORVO INC                     | —       | 11    | 180   | 20,335       | 半導体・半導体製造装置            |
| QUALCOMM INC                  | 66      | 98    | 1,646 | 185,792      | 半導体・半導体製造装置            |
| QUEST DIAGNOSTICS             | 8       | 11    | 165   | 18,706       | ヘルスケア機器・サービス           |
| RPM INTERNATIONAL INC         | 9       | 10    | 94    | 10,652       | 素材                     |
| RALPH LAUREN CORP             | 3       | —     | —     | —            | 耐久消費財・アパレル             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 8       | 20    | 204   | 23,079       | 各種金融                   |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP    | 88      | 145   | 1,325 | 149,590      | 資本財                    |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc | 6       | 10    | 645   | 72,895       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄                            | 株数 | 期末      |       |         | 業種等                    |
|-------------------------------|----|---------|-------|---------|------------------------|
|                               |    | 期首(前期末) | 当     | 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      |                        |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 74 | 92      | 224   | 25,341  | 銀行                     |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 4  | —       | —     | —       | 保険                     |
| REPUBLIC SERVICES INC         | 9  | 16      | 217   | 24,552  | 商業・専門サービス              |
| RESMED INC                    | 8  | 14      | 379   | 42,847  | ヘルスケア機器・サービス           |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | 5  | 9       | 232   | 26,263  | ソフトウェア・サービス            |
| ROBERT HALF INTL INC          | 7  | 13      | 153   | 17,376  | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 6  | 9       | 307   | 34,736  | 資本財                    |
| ROKU INC                      | —  | 12      | 358   | 40,478  | メディア・娯楽                |
| ROLLINS INC                   | 12 | 28      | 101   | 11,414  | 商業・専門サービス              |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 6  | 9       | 488   | 55,120  | 資本財                    |
| ROSS STORES INC               | 21 | 38      | 459   | 51,877  | 小売                     |
| S&P GLOBAL INC                | 14 | 21      | 975   | 110,065 | 各種金融                   |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 7  | 7       | 48    | 5,470   | 各種金融                   |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS    | 19 | 27      | 216   | 24,431  | ソフトウェア・サービス            |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 3  | 5       | 444   | 50,141  | 銀行                     |
| SALESFORCE.COM INC            | 54 | 91      | 2,835 | 319,967 | ソフトウェア・サービス            |
| SCHLUMBERGER LTD              | 84 | 147     | 502   | 56,743  | エネルギー                  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         | 92 | 141     | 1,140 | 128,747 | 各種金融                   |
| SEAGEN INC                    | 8  | 16      | 308   | 34,820  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEALED AIR CORP               | 14 | 15      | 101   | 11,435  | 素材                     |
| SEMPRA ENERGY                 | 16 | 27      | 344   | 38,870  | 公益事業                   |
| SERVICENOW INC                | 11 | 19      | 1,325 | 149,636 | ソフトウェア・サービス            |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE       | 4  | 22      | 722   | 81,556  | 素材                     |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 10 | 14      | 245   | 27,753  | 半導体・半導体製造装置            |
| SMITH (A. O.) CORP            | 9  | 12      | 97    | 10,988  | 資本財                    |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM     | 8  | 10      | 135   | 15,338  | 食品・飲料・タバコ              |
| SNAP-ON INC                   | 3  | 5       | 119   | 13,433  | 資本財                    |
| SNAP INC - A                  | 61 | 100     | 550   | 62,129  | メディア・娯楽                |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A         | —  | 19      | 745   | 84,093  | ソフトウェア・サービス            |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC    | —  | 6       | 239   | 27,027  | 半導体・半導体製造装置            |
| SOUTHERN CO                   | 59 | 85      | 541   | 61,115  | 公益事業                   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO         | 15 | 28      | 147   | 16,628  | 運輸                     |
| SPLUNK INC                    | 10 | 19      | 336   | 37,945  | ソフトウェア・サービス            |
| SQUARE INC - A                | 23 | 38      | 893   | 100,849 | ソフトウェア・サービス            |
| STANLEY BLACK & DECKER INC    | 9  | 15      | 293   | 33,081  | 資本財                    |
| STARBUCKS CORP                | 68 | 114     | 1,305 | 147,342 | 消費者サービス                |
| STATE STREET CORP             | 20 | 34      | 330   | 37,293  | 各種金融                   |
| STEEL DYNAMICS INC            | —  | 25      | 168   | 19,013  | 素材                     |
| STRYKER CORP                  | 19 | 30      | 836   | 94,409  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYNOPSYS INC                  | 10 | 16      | 564   | 63,752  | ソフトウェア・サービス            |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 43 | 60      | 298   | 33,707  | 各種金融                   |
| SYSCO CORP                    | 30 | 50      | 401   | 45,304  | 食品・生活必需品小売り            |
| TJX COMPANIES INC             | 70 | 118     | 828   | 93,535  | 小売                     |
| T-MOBILE US INC               | 34 | 62      | 747   | 84,316  | 電気通信サービス               |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 7  | 13      | 243   | 27,429  | メディア・娯楽                |
| TARGET CORP                   | 29 | 45      | 1,173 | 132,439 | 小売                     |
| TELADOC HEALTH INC            | —  | 17      | 256   | 28,949  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     | 3  | 5       | 219   | 24,821  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末)<br>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      |                        |
| TELEFLEX INC                  | 3              | 5     | 187   | 21,210  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TERADYNE INC                  | —              | 17    | 255   | 28,819  | 半導体・半導体製造装置            |
| TESLA INC                     | 44             | 75    | 7,756 | 875,351 | 自動車・自動車部品              |
| TEXAS INSTRUMENTS             | 52             | 80    | 1,544 | 174,284 | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXTRON INC                   | 15             | 27    | 207   | 23,384  | 資本財                    |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A   | 3              | 49    | 476   | 53,768  | ソフトウェア・サービス            |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  | 23             | 36    | 2,270 | 256,213 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3M CO                         | 32             | 50    | 909   | 102,651 | 資本財                    |
| TIFFANY & CO                  | 6              | —     | —     | —       | 小売                     |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY        | 9              | 13    | 291   | 32,902  | 小売                     |
| TRANSDIGM GROUP INC           | 3              | 5     | 378   | 42,751  | 資本財                    |
| TRANSUNION                    | 13             | 19    | 226   | 25,561  | 商業・専門サービス              |
| TRAVELERS COS INC/THE         | 13             | 18    | 291   | 32,845  | 保険                     |
| TRIMBLE INC                   | 20             | 28    | 255   | 28,793  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRUIST FINANCIAL CORP         | 78             | 129   | 838   | 94,641  | 銀行                     |
| TWILIO INC - A                | 8              | 16    | 526   | 59,417  | ソフトウェア・サービス            |
| TWITTER INC                   | 52             | 85    | 456   | 51,569  | メディア・娯楽                |
| TYLER TECHNOLOGIES INC        | —              | 5     | 275   | 31,061  | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A          | 18             | 28    | 230   | 25,963  | 食品・飲料・タバコ              |
| UGI CORP                      | —              | 20    | 93    | 10,535  | 公益事業                   |
| US BANCORP                    | 77             | 140   | 843   | 95,231  | 銀行                     |
| UBER TECHNOLOGIES INC         | 61             | 126   | 575   | 64,963  | 運輸                     |
| ULTA BEAUTY INC               | 3              | 6     | 249   | 28,137  | 小売                     |
| UNION PACIFIC CORP            | 39             | 59    | 1,426 | 161,046 | 運輸                     |
| UNITED PARCEL SERVICE CL B    | 41             | 65    | 1,385 | 156,323 | 運輸                     |
| UNITED RENTALS INC            | 6              | 8     | 330   | 37,291  | 資本財                    |
| UNITEDHEALTH GROUP INC        | 55             | 84    | 3,942 | 444,931 | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 5              | 6     | 83    | 9,407   | ヘルスケア機器・サービス           |
| VF CORP                       | 18             | 34    | 262   | 29,637  | 耐久消費財・アパレル             |
| VAIL RESORTS INC              | 2              | 5     | 200   | 22,677  | 消費者サービス                |
| VALERO ENERGY CORP            | 25             | 44    | 344   | 38,875  | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC    | 6              | —     | —     | —       | ヘルスケア機器・サービス           |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     | 9              | 14    | 477   | 53,899  | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                  | 6              | 11    | 263   | 29,683  | ソフトウェア・サービス            |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 235            | 365   | 1,910 | 215,627 | 電気通信サービス               |
| VERISK ANALYTICS INC          | 8              | 12    | 276   | 31,196  | 商業・専門サービス              |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    | 16             | 26    | 511   | 57,733  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VIACOMCBS INC-CLASS B         | 45             | 73    | 260   | 29,456  | メディア・娯楽                |
| VIATRIS INC                   | —              | 134   | 196   | 22,149  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VISA INC-CLASS A SHARES       | 97             | 154   | 3,302 | 372,735 | ソフトウェア・サービス            |
| VMWARE INC-CLASS A            | 6              | 22    | 284   | 32,104  | ソフトウェア・サービス            |
| VOYA FINANCIAL INC            | 12             | 12    | 82    | 9,317   | 各種金融                   |
| VULCAN MATERIALS CO           | 7              | 12    | 264   | 29,889  | 素材                     |
| WEC ENERGY GROUP INC          | 18             | 29    | 263   | 29,742  | 公益事業                   |
| WABTEC CORP/DE                | 13             | 23    | 228   | 25,740  | 資本財                    |
| WALMART INC                   | 82             | 136   | 2,051 | 231,484 | 食品・生活必需品小売り            |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  | 39             | 71    | 349   | 39,454  | 食品・生活必需品小売り            |
| WASTE CONNECTIONS INC         | 15             | 18    | 246   | 27,874  | 商業・専門サービス              |

| 銘<br>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         |                        |       |
| WASTE MANAGEMENT INC                |               | 21      | 34     | 544     | 61,414     | 商業・専門サービス              |       |
| WATERS CORP                         |               | 4       | 5      | 198     | 22,406     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| WELLS FARGO & COMPANY               |               | 222     | 387    | 1,932   | 218,089    | 銀行                     |       |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC    |               | 5       | 8      | 346     | 39,118     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| WESTERN DIGITAL CORP                |               | 20      | 34     | 192     | 21,673     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| WESTERN UNION CO                    |               | 27      | 43     | 78      | 8,894      | ソフトウェア・サービス            |       |
| WESTROCK CO                         |               | 19      | 31     | 151     | 17,137     | 素材                     |       |
| WHIRLPOOL CORP                      |               | 4       | 6      | 139     | 15,717     | 耐久消費財・アパレル             |       |
| WILLIAMS COS INC                    |               | 77      | 105    | 299     | 33,821     | エネルギー                  |       |
| WORKDAY INC-CLASS A                 |               | 11      | 19     | 584     | 65,979     | ソフトウェア・サービス            |       |
| XCEL ENERGY INC                     |               | 29      | 45     | 287     | 32,415     | 公益事業                   |       |
| XILINX INC                          |               | 14      | 24     | 500     | 56,475     | 半導体・半導体製造装置            |       |
| XYLEM INC                           |               | 11      | 17     | 228     | 25,841     | 資本財                    |       |
| YUM! BRANDS INC                     |               | 16      | 28     | 357     | 40,318     | 消費者サービス                |       |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A        |               | 3       | 5      | 308     | 34,826     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC          |               | 12      | 19     | 267     | 30,195     | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| ZOETIS INC                          |               | 29      | 44     | 969     | 109,432    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A         |               | 9       | 22     | 571     | 64,508     | ソフトウェア・サービス            |       |
| INVESCO LTD                         |               | 35      | 52     | 136     | 15,396     | 各種金融                   |       |
| CHUBB LTD                           |               | 25      | 37     | 733     | 82,797     | 保険                     |       |
| LyondellBasell Industries NV        |               | 16      | 26     | 248     | 27,998     | 素材                     |       |
| GARMIN LTD                          |               | 9       | 11     | 172     | 19,515     | 耐久消費財・アパレル             |       |
| ACCENTURE PLC-CL A                  |               | 36      | 57     | 2,102   | 237,306    | ソフトウェア・サービス            |       |
| NXP SEMICONDUCTORS NV               |               | 18      | 26     | 589     | 66,585     | 半導体・半導体製造装置            |       |
| SEAGATE TECHNOLOGY                  |               | 13      | —      | —       | —          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| TE CONNECTIVITY LTD                 |               | 18      | 28     | 451     | 50,950     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| APTIV PLC                           |               | 17      | 28     | 484     | 54,735     | 自動車・自動車部品              |       |
| EATON CORP PLC                      |               | 22      | 33     | 586     | 66,213     | 資本財                    |       |
| IHS MARKIT LTD                      |               | 23      | 36     | 463     | 52,265     | 商業・専門サービス              |       |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC            |               | 7       | 11     | 279     | 31,528     | 保険                     |       |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING        |               | 15      | 19     | 116     | 13,157     | 資本財                    |       |
| ALLEGION PLC                        |               | —       | 8      | 106     | 12,005     | 資本財                    |       |
| STERIS PLC                          |               | 6       | 10     | 241     | 27,213     | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| PERRIGO CO PLC                      |               | 11      | —      | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| AMCOR PLC                           |               | 104     | 148    | 183     | 20,696     | 素材                     |       |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC              |               | 13      | 22     | 419     | 47,382     | 資本財                    |       |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS         |               | —       | 22     | 221     | 25,000     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |       |
| AON PLC                             |               | 13      | 20     | 612     | 69,072     | 保険                     |       |
| PENTAIR PLC                         |               | 12      | 14     | 111     | 12,539     | 資本財                    |       |
| MEDTRONIC PLC                       |               | 77      | 120    | 1,474   | 166,461    | ヘルスケア機器・サービス           |       |
| MYLAN NV                            |               | 34      | —      | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |       |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL      |               | 42      | 59     | 457     | 51,595     | 資本財                    |       |
| COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC |               | 15      | 25     | 149     | 16,817     | 食品・飲料・タバコ              |       |
| LINDE PLC                           |               | 30      | 47     | 1,623   | 183,172    | 素材                     |       |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A          |               | 11      | 18     | 160     | 18,145     | 保険                     |       |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 17,628  | 28,135 | 381,613 | 43,068,869 |                        |       |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 495     | 522    | —       | <69.7%>    |                        |       |

| 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      |
| (カナダ)                        |   | 百株      | 百株    | 千カナダドル | 千円      |             |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       |   | 18      | 30    | 207    | 18,835  | 素材          |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  |   | —       | 100   | 177    | 16,117  | 公益事業        |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC |   | 52      | 80    | 402    | 36,533  | 食品・生活必需品小売り |
| BCE INC                      |   | 15      | 19    | 123    | 11,161  | 電気通信サービス    |
| BANK OF MONTREAL             |   | 35      | 59    | 825    | 74,913  | 銀行          |
| BANK OF NOVA SCOTIA          |   | 62      | 100   | 833    | 75,601  | 銀行          |
| BARRICK GOLD CORP            |   | 117     | 169   | 414    | 37,591  | 素材          |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A |   | 84      | 129   | 986    | 89,473  | 各種金融        |
| CAE INC                      |   | 27      | 46    | 196    | 17,800  | 資本財         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    |   | 13      | 17    | 120    | 10,966  | 素材          |
| CGI INC                      |   | 13      | 18    | 211    | 19,184  | ソフトウェア・サービス |
| CAMECO CORP                  |   | 35      | 63    | 218    | 19,812  | エネルギー       |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  |   | 23      | 38    | 564    | 51,225  | 銀行          |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     |   | 39      | 67    | 1,111  | 100,844 | 運輸          |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   |   | 75      | 122   | 663    | 60,176  | エネルギー       |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD |   | 7       | 62    | 606    | 55,050  | 運輸          |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A     |   | 5       | 8     | 151    | 13,775  | 小売          |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     |   | 17      | 34    | 122    | 11,075  | 公益事業        |
| CENOVUS ENERGY INC           |   | 113     | 186   | 304    | 27,650  | エネルギー       |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   |   | 1       | 2     | 485    | 44,077  | ソフトウェア・サービス |
| DOLLARAMA INC                |   | 21      | 31    | 182    | 16,509  | 小売          |
| EMERA INC                    |   | 22      | 27    | 159    | 14,503  | 公益事業        |
| ENBRIDGE INC                 |   | 117     | 187   | 988    | 89,620  | エネルギー       |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  |   | 2       | 2     | 130    | 11,844  | 保険          |
| FORTIS INC                   |   | 30      | 42    | 241    | 21,931  | 公益事業        |
| FRANCO-NEVADA CORP           |   | 13      | 19    | 344    | 31,280  | 素材          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        |   | 17      | 32    | 167    | 15,205  | 耐久消費財・アパレル  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        |   | 25      | 28    | 108    | 9,814   | 保険          |
| HYDRO ONE LTD                |   | 34      | 40    | 122    | 11,114  | 公益事業        |
| IGM FINANCIAL INC            |   | 14      | 20    | 105    | 9,545   | 各種金融        |
| IMPERIAL OIL LTD             |   | 27      | 46    | 203    | 18,423  | エネルギー       |
| INTACT FINANCIAL CORP        |   | 10      | 17    | 294    | 26,740  | 保険          |
| INTER PIPELINE LTD           |   | 52      | —     | —      | —       | エネルギー       |
| KEYERA CORP                  |   | 27      | 46    | 143    | 13,025  | エネルギー       |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD       |   | 22      | 35    | 195    | 17,720  | 素材          |
| LOBLAW COMPANIES LTD         |   | 15      | 15    | 154    | 14,056  | 食品・生活必需品小売り |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |   | 19      | 30    | 320    | 29,110  | 自動車・自動車部品   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |   | 104     | 170   | 423    | 38,375  | 保険          |
| METRO INC                    |   | 22      | 22    | 149    | 13,543  | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA      |   | 21      | 34    | 360    | 32,652  | 銀行          |
| NUTRIEN LTD                  |   | 34      | 58    | 498    | 45,212  | 素材          |
| OPEN TEXT CORP               |   | 25      | 35    | 231    | 21,030  | ソフトウェア・サービス |
| PEMBINA PIPELINE CORP        |   | 44      | 63    | 272    | 24,756  | エネルギー       |
| POWER CORP OF CANADA         |   | 47      | 61    | 264    | 23,993  | 保険          |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     |   | 23      | 38    | 274    | 24,928  | 消費者サービス     |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B  |   | 28      | 41    | 254    | 23,105  | 電気通信サービス    |
| ROYAL BANK OF CANADA         |   | 78      | 123   | 1,636  | 148,404 | 銀行          |
| SAPUTO INC                   |   | 19      | 49    | 154    | 14,047  | 食品・飲料・タバコ   |

| 銘柄                             |               | 期首(前期末) | 当 期 末 |        | 業 種 等     |                        |
|--------------------------------|---------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                                |               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                        |
|                                |               |         |       | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額                 |
| (カナダ)                          |               | 百株      | 百株    | 千カナダドル | 千円        |                        |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B      |               | 45      | 58    | 214    | 19,476    | メディア・娯楽                |
| SHOPIFY INC - CLASS A          |               | 6       | 10    | 2,105  | 190,978   | ソフトウェア・サービス            |
| SUN LIFE FINANCIAL INC         |               | 29      | 40    | 291    | 26,424    | 保険                     |
| SUNCOR ENERGY INC              |               | 98      | 165   | 540    | 49,034    | エネルギー                  |
| TC ENERGY CORP                 |               | 54      | 88    | 554    | 50,250    | エネルギー                  |
| TELUS CORP                     |               | 16      | 16    | 46     | 4,241     | 電気通信サービス               |
| THOMSON REUTERS CORP           |               | 13      | 18    | 284    | 25,788    | 商業・専門サービス              |
| TORONTO-DOMINION BANK          |               | 98      | 159   | 1,463  | 132,769   | 銀行                     |
| WSP GLOBAL INC                 |               | —       | 16    | 277    | 25,147    | 資本財                    |
| WESTON (GEORGE) LTD            |               | 5       | 11    | 159    | 14,470    | 食品・生活必需品小売り            |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP   |               | 33      | 56    | 297    | 26,977    | 素材                     |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額     | 2,086   | 3,324 | 23,350 | 2,117,923 |                        |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 57      | 58    | —      | <3.4%>    |                        |
| (ユーロ…ドイツ)                      |               |         |       | 千ユーロ   |           |                        |
| ADIDAS AG                      |               | 10      | 17    | 513    | 67,230    | 耐久消費財・アパレル             |
| Fresenius SE & CO KG           |               | 23      | 37    | 140    | 18,342    | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE   |               | 12      | 23    | 82     | 10,750    | 電気通信サービス               |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF        |               | 6       | —     | —      | —         | 素材                     |
| HANNOVER RUECK SE              |               | 4       | 4     | 74     | 9,697     | 保険                     |
| GEA GROUP AG                   |               | 14      | 26    | 116    | 15,282    | 資本財                    |
| CONTINENTAL AG                 |               | 7       | 9     | 99     | 12,988    | 自動車・自動車部品              |
| DEUTSCHE POST AG               |               | 54      | 83    | 469    | 61,389    | 運輸                     |
| MERCK KGAA                     |               | 8       | 12    | 255    | 33,367    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RWE AG                         |               | 37      | 70    | 227    | 29,726    | 公益事業                   |
| SAP SE                         |               | 61      | 95    | 1,221  | 159,873   | ソフトウェア・サービス            |
| E.ON SE                        |               | 120     | 213   | 234    | 30,732    | 公益事業                   |
| HENKEL AG & CO KGAA            |               | 9       | 10    | 75     | 9,868     | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PUMA AG                        |               | 7       | 9     | 110    | 14,427    | 耐久消費財・アパレル             |
| BAYER AG                       |               | 58      | 94    | 478    | 62,538    | 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   |               | 6       | 10    | 80     | 10,534    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BASF SE                        |               | 47      | 74    | 458    | 59,953    | 素材                     |
| BEIERSDORF AG                  |               | 7       | 8     | 75     | 9,875     | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HEIDELBERGCEMENT AG            |               | 10      | 13    | 84     | 11,110    | 素材                     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co |               | 12      | 17    | 100    | 13,135    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLIANZ SE                     |               | 22      | 34    | 704    | 92,187    | 保険                     |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG     |               | 7       | 11    | 291    | 38,141    | 保険                     |
| VOLKSWAGEN AG                  |               | 3       | 4     | 142    | 18,619    | 自動車・自動車部品              |
| VOLKSWAGEN AG PFD              |               | 8       | 15    | 282    | 37,005    | 自動車・自動車部品              |
| DAIMLER AG                     |               | 51      | 76    | 671    | 87,894    | 自動車・自動車部品              |
| SIEMENS AG                     |               | 43      | 73    | 1,070  | 139,990   | 資本財                    |
| DEUTSCHE BANK AG -REG          |               | 139     | 211   | 232    | 30,353    | 各種金融                   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG    |               | 17      | 30    | 277    | 36,247    | 自動車・自動車部品              |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        |               | 169     | 293   | 485    | 63,466    | 電気通信サービス               |
| SARTORIUS AG-VORZUG            |               | 2       | 3     | 196    | 25,678    | ヘルスケア機器・サービス           |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG       |               | 78      | 130   | 546    | 71,435    | 半導体・半導体製造装置            |
| DEUTSCHE BOERSE AG             |               | 10      | 15    | 225    | 29,485    | 各種金融                   |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE   |               | 11      | 16    | 142    | 18,677    | 自動車・自動車部品              |
| LANXESS                        |               | 7       | 15    | 86     | 11,266    | 素材                     |



| 銘柄                                  | 株数      | 期首(前期末) | 当期    |         | 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      |                        |
| MTU AERO ENGINES AG                 | 4       | 6       | 137   | 17,988  | 資本財                    |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR               | 19      | —       | —     | —       | 不動産                    |
| SYMRISE AG                          | 8       | 10      | 131   | 17,233  | 素材                     |
| BRENTAG SE                          | 10      | 14      | 112   | 14,726  | 資本財                    |
| EVONIK INDUSTRIES AG                | 11      | 11      | 33    | 4,337   | 素材                     |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI        | 117     | 262     | 64    | 8,405   | 電気通信サービス               |
| COMMERZBANK AG                      | 93      | 181     | 121   | 15,930  | 銀行                     |
| LEG IMMOBILIEN SE                   | 5       | 6       | 80    | 10,563  | 不動産                    |
| VONOVIA SE                          | 29      | 49      | 260   | 34,067  | 不動産                    |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG             | —       | 29      | 176   | 23,057  | ヘルスケア機器・サービス           |
| METRO AG                            | 22      | —       | —     | —       | 食品・生活必需品小売り            |
| TEAMVIEWER AG                       | 13      | 59      | 86    | 11,278  | ソフトウェア・サービス            |
| SIEMENS ENERGY AG                   | 33      | 57      | 140   | 18,404  | 資本財                    |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF              | —       | 9       | 38    | 5,060   | 素材                     |
| ZALANDO SE                          | 12      | 28      | 215   | 28,131  | 小売                     |
| SCOUT24 SE                          | 9       | 18      | 115   | 15,143  | メディア・娯楽                |
| COVESTRO AG                         | 13      | 15      | 88    | 11,528  | 素材                     |
| UNIPER SE                           | 15      | 22      | 86    | 11,275  | 公益事業                   |
| DELIVERY HERO SE                    | 10      | 20      | 223   | 29,262  | 小売                     |
| 小計                                  | 株数・金額   | 1,529   | 2,569 | 12,364  | 1,617,670              |
|                                     | 銘柄数<比率> | 51      | 50    | —       | <2.6%>                 |
| (ユーロ…イタリア)                          |         |         |       |         |                        |
| ASSICURAZIONI GENERALI              | 68      | 68      | 130   | 17,058  | 保険                     |
| INTESA SANPAOLO                     | 957     | 1,488   | 367   | 48,126  | 銀行                     |
| MEDIOBANCA SPA                      | 80      | 80      | 86    | 11,319  | 銀行                     |
| ENEL SPA                            | 491     | 765     | 542   | 71,003  | 公益事業                   |
| ENI SPA                             | 158     | 180     | 227   | 29,737  | エネルギー                  |
| SNAM SPA                            | —       | 250     | 125   | 16,392  | 公益事業                   |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA  | 128     | 151     | 100   | 13,187  | 公益事業                   |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA         | 11      | 21      | 117   | 15,422  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| Prysmian SpA                        | —       | 32      | 108   | 14,159  | 資本財                    |
| MONCLER SPA                         | 15      | 22      | 148   | 19,382  | 耐久消費財・アパレル             |
| FINECOBANK SPA                      | 54      | 71      | 121   | 15,945  | 銀行                     |
| UNICREDIT SPA                       | 163     | 234     | 266   | 34,906  | 銀行                     |
| POSTE ITALIANE SPA                  | 68      | 95      | 118   | 15,537  | 保険                     |
| 小計                                  | 株数・金額   | 2,198   | 3,462 | 2,462   | 322,180                |
|                                     | 銘柄数<比率> | 11      | 13    | —       | <0.5%>                 |
| (ユーロ…フランス)                          |         |         |       |         |                        |
| BOUYGUES                            | 15      | 22      | 74    | 9,764   | 資本財                    |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 37      | 73      | 218   | 28,633  | 公益事業                   |
| L' OREAL                            | 13      | 21      | 892   | 116,823 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 16      | 25      | 1,805 | 236,244 | 耐久消費財・アパレル             |
| THALES SA                           | 7       | 9       | 81    | 10,718  | 資本財                    |
| CAPGEMINI                           | 10      | 17      | 361   | 47,306  | ソフトウェア・サービス            |
| PUBLICIS GROUPE                     | —       | 20      | 118   | 15,537  | メディア・娯楽                |
| MICHELIN (CGDE)-B                   | 7       | 10      | 144   | 18,865  | 自動車・自動車部品              |
| PERNOD-RICARD                       | 10      | 16      | 329   | 43,136  | 食品・飲料・タバコ              |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 30      | 47      | 725   | 94,907  | 資本財                    |

| 銘<br>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        |                        |
| VIVENDI SA                |               | 43      | 52    | 57     | 7,560     | メディア・娯楽                |
| ORANGE                    |               | 92      | 125   | 120    | 15,810    | 電気通信サービス               |
| HERMES INTERNATIONAL      |               | 1       | 2     | 386    | 50,507    | 耐久消費財・アパレル             |
| DASSAULT SYSTEMES SA      |               | 8       | —     | —      | —         | ソフトウェア・サービス            |
| KERING                    |               | 4       | 7     | 489    | 64,054    | 耐久消費財・アパレル             |
| CNP ASSURANCES            |               | 25      | 42    | 93     | 12,185    | 保険                     |
| CARREFOUR SA              |               | 39      | 52    | 82     | 10,817    | 食品・生活必需品小売り            |
| ATOS SE                   |               | 7       | 21    | 93     | 12,268    | ソフトウェア・サービス            |
| SANOFI                    |               | 66      | 96    | 856    | 112,044   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCOR SA                  |               | 19      | —     | —      | —         | 消費者サービス                |
| SOCIETE GENERALE-A        |               | 63      | 86    | 255    | 33,420    | 銀行                     |
| EUROFINS SCIENTIFIC       |               | 1       | —     | —      | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEPERFORMANCE           |               | 3       | 5     | 201    | 26,339    | 商業・専門サービス              |
| SODEXO                    |               | 8       | 16    | 135    | 17,765    | 消費者サービス                |
| AXA SA                    |               | 89      | 151   | 384    | 50,282    | 保険                     |
| PEUGEOT SA                |               | 38      | —     | —      | —         | 自動車・自動車部品              |
| ESSILORLUXOTTICA          |               | 16      | 27    | 498    | 65,246    | 耐久消費財・アパレル             |
| CREDIT AGRICOLE SA        |               | 81      | 124   | 162    | 21,303    | 銀行                     |
| BNP PARIBAS               |               | 62      | 103   | 608    | 79,661    | 銀行                     |
| ORPEA                     |               | 5       | 9     | 87     | 11,468    | ヘルスケア機器・サービス           |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN |               | 30      | 45    | 273    | 35,724    | 資本財                    |
| Wendel                    |               | 3       | 5     | 64     | 8,499     | 各種金融                   |
| SAFRAN SA                 |               | 19      | 34    | 411    | 53,859    | 資本財                    |
| ENGIE                     |               | 106     | 163   | 208    | 27,224    | 公益事業                   |
| ALSTOM                    |               | 15      | 47    | 150    | 19,665    | 資本財                    |
| ELECTRICITE DE FRANCE     |               | 45      | 90    | 117    | 15,344    | 公益事業                   |
| Legrand SA                |               | 13      | 17    | 168    | 22,016    | 資本財                    |
| Eiffage SA                |               | 6       | 8     | 78     | 10,284    | 資本財                    |
| TOTALENERGIES SE          |               | 139     | 214   | 934    | 122,223   | エネルギー                  |
| Aeroports de Paris        |               | 2       | 8     | 100    | 13,125    | 運輸                     |
| Natixis                   |               | 92      | —     | —      | —         | 各種金融                   |
| UBISOFT ENTERTAINMENT     |               | 7       | 20    | 94     | 12,365    | メディア・娯楽                |
| SCOR SE                   |               | 12      | 30    | 86     | 11,319    | 保険                     |
| VINCI S.A.                |               | 27      | 48    | 459    | 60,171    | 資本財                    |
| DANONE                    |               | 30      | 54    | 311    | 40,812    | 食品・飲料・タバコ              |
| AIR LIQUIDE               |               | 25      | 39    | 588    | 77,053    | 素材                     |
| Bureau Veritas SA         |               | 23      | 23    | 68     | 8,901     | 商業・専門サービス              |
| GETLINK SE                |               | 40      | 65    | 91     | 11,935    | 運輸                     |
| SUEZ                      |               | 36      | 42    | 83     | 10,913    | 公益事業                   |
| EDENRED                   |               | 19      | 25    | 113    | 14,846    | ソフトウェア・サービス            |
| VALEO SA                  |               | 19      | 38    | 106    | 13,897    | 自動車・自動車部品              |
| DASSAULT SYSTEMES SE      |               | —       | 74    | 406    | 53,238    | ソフトウェア・サービス            |
| EUROFINS SCIENTIFIC       |               | —       | 16    | 169    | 22,155    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WORLDLINE SA              |               | 16      | 31    | 157    | 20,587    | ソフトウェア・サービス            |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH  |               | 2       | 3     | 172    | 22,533    | 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     | 1,566   | 2,340 | 14,686 | 1,921,378 |                        |
|                           | 銘 柄 数 < 比 率 > | 52      | 50    | —      | < 3.1% >  |                        |

| 銘<br>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…オランダ)                    |               | 百株      | 百株    | 千ユーロ  | 千円        |                        |
| AIRBUS SE                     |               | 36      | 56    | 655   | 85,708    | 資本財                    |
| ASM INTERNATIONAL NV          |               | —       | 6     | 256   | 33,532    | 半導体・半導体製造装置            |
| RANDSTAD NV                   |               | 11      | 13    | 83    | 10,900    | 商業・専門サービス              |
| WOLTERS KLUWER                |               | 12      | 17    | 166   | 21,830    | 商業・専門サービス              |
| Koninklijke Vopak NV          |               | 5       | 5     | 19    | 2,485     | エネルギー                  |
| AEGON NV                      |               | 152     | 232   | 99    | 13,005    | 保険                     |
| KONIKLIJKE KPN NV             |               | 285     | 359   | 94    | 12,299    | 電気通信サービス               |
| STMICROELECTRONICS NV         |               | 41      | 63    | 280   | 36,702    | 半導体・半導体製造装置            |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        |               | 53      | 79    | 330   | 43,185    | ヘルスケア機器・サービス           |
| HEINEKEN NV                   |               | 12      | 22    | 212   | 27,759    | 食品・飲料・タバコ              |
| HEINEKEN HOLDING NV           |               | 7       | 10    | 86    | 11,307    | 食品・飲料・タバコ              |
| KONINKLIJKE DSM NV            |               | 9       | 13    | 249   | 32,597    | 素材                     |
| UNILEVER NV                   |               | 82      | —     | —     | —         | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ASML HOLDING NV               |               | 25      | 39    | 2,882 | 377,073   | 半導体・半導体製造装置            |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV |               | 61      | 73    | 209   | 27,460    | 食品・生活必需品小売り            |
| FERRARI NV                    |               | 6       | 11    | 258   | 33,761    | 自動車・自動車部品              |
| CNH INDUSTRIAL NV             |               | 91      | 130   | 196   | 25,671    | 資本財                    |
| AKZO NOBEL                    |               | 10      | 13    | 134   | 17,633    | 素材                     |
| PROSUS NV                     |               | 30      | 93    | 681   | 89,100    | 小売                     |
| STELLANTIS NV                 |               | —       | 190   | 332   | 43,548    | 自動車・自動車部品              |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV      |               | 67      | 83    | 106   | 13,974    | 食品・飲料・タバコ              |
| NN GROUP NV                   |               | 24      | 26    | 122   | 16,024    | 保険                     |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV      |               | —       | 79    | 211   | 27,624    | メディア・娯楽                |
| EXOR NV                       |               | —       | 10    | 83    | 10,955    | 各種金融                   |
| QIAGEN N V                    |               | 18      | 24    | 111   | 14,652    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADYEN NV /WI                  |               | 1       | 2     | 531   | 69,552    | ソフトウェア・サービス            |
| ING GROEP NV-CVA              |               | 247     | 396   | 521   | 68,243    | 銀行                     |
| 小 計                           | 株 数 ・ 金 額     | 1,297   | 2,055 | 8,916 | 1,166,595 |                        |
|                               | 銘 柄 数 < 比 率 > | 23      | 26    | —     | <1.9%>    |                        |
| (ユーロ…スペイン)                    |               |         |       |       |           |                        |
| ENDESA SA                     |               | 23      | 37    | 72    | 9,514     | 公益事業                   |
| Bankinter SA                  |               | 80      | —     | —     | —         | 銀行                     |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA  |               | 360     | 603   | 360   | 47,196    | 銀行                     |
| NATURGY ENERGY GROUP SA       |               | 19      | 30    | 70    | 9,249     | 公益事業                   |
| REPSOL SA                     |               | 97      | 128   | 138   | 18,134    | エネルギー                  |
| BANCO SANTANDER S.A           |               | 873     | 1,547 | 494   | 64,632    | 銀行                     |
| TELEFONICA SA                 |               | 259     | 468   | 179   | 23,419    | 電気通信サービス               |
| ENAGAS SA                     |               | 13      | 48    | 95    | 12,441    | 公益事業                   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV   |               | 22      | 44    | 103   | 13,530    | 資本財                    |
| FERROVIAL SA                  |               | 37      | 53    | 144   | 18,898    | 資本財                    |
| MAPFRE S.A.                   |               | 109     | —     | —     | —         | 保険                     |
| CaixaBank SA                  |               | 253     | 385   | 95    | 12,528    | 銀行                     |
| IBERDROLA SA                  |               | 324     | 529   | 535   | 70,031    | 公益事業                   |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS     |               | 27      | 47    | 302   | 39,534    | ソフトウェア・サービス            |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA  |               | 25      | 25    | 45    | 5,916     | 公益事業                   |
| FERROVIAL SA-RTS              |               | —       | 53    | 1     | 218       | 資本財                    |
| FERROVIAL SA-RTS              |               | 37      | —     | —     | —         | 資本財                    |
| INDITEX                       |               | 54      | 101   | 323   | 42,376    | 小売                     |

| 銘<br>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…スペイン)                  |              | 百株      | 百株    | 千ユーロ  | 千円      |                        |
| AENA SME SA                 |              | 4       | 7     | 117   | 15,423  | 運輸                     |
| CELLNEX TELECOM SAU         |              | 24      | 58    | 312   | 40,916  | 電気通信サービス               |
| GRIFOLS SA                  |              | 24      | 43    | 79    | 10,431  | 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    | 2,673   | 4,215 | 3,473 | 454,397 |                        |
|                             | 銘柄 数 < 比 率 > | 20      | 18    | —     | <0.7%>  |                        |
| (ユーロ…ベルギー)                  |              |         |       |       |         |                        |
| KBC GROEP NV                |              | 18      | 29    | 247   | 32,428  | 銀行                     |
| SOLVAY SA                   |              | 6       | 8     | 93    | 12,194  | 素材                     |
| UCB SA                      |              | 10      | 14    | 157   | 20,572  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COLRUYT SA                  |              | 6       | 6     | 28    | 3,740   | 食品・生活必需品小売り            |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA |              | 8       | 8     | 93    | 12,167  | 各種金融                   |
| AGEAS                       |              | 13      | 21    | 89    | 11,748  | 保険                     |
| UMICORE                     |              | 15      | 22    | 112   | 14,777  | 素材                     |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  |              | 46      | 73    | 383   | 50,145  | 食品・飲料・タバコ              |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額    | 125     | 186   | 1,205 | 157,775 |                        |
|                             | 銘柄 数 < 比 率 > | 8       | 8     | —     | <0.3%>  |                        |
| (ユーロ…オーストリア)                |              |         |       |       |         |                        |
| OMV AG                      |              | 21      | 24    | 128   | 16,829  | エネルギー                  |
| ERSTE GROUP BANK AG         |              | 25      | 40    | 165   | 21,677  | 銀行                     |
| ANDRITZ AG                  |              | 6       | —     | —     | —       | 資本財                    |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額    | 53      | 64    | 294   | 38,507  |                        |
|                             | 銘柄 数 < 比 率 > | 3       | 2     | —     | <0.1%>  |                        |
| (ユーロ…ルクセンブルク)               |              |         |       |       |         |                        |
| TENARIS SA                  |              | 42      | 95    | 104   | 13,610  | エネルギー                  |
| SES SA                      |              | 42      | —     | —     | —       | メディア・娯楽                |
| AROUNDTOWN SA               |              | 93      | 191   | 118   | 15,550  | 不動産                    |
| ARCELORMITTAL               |              | 61      | 67    | 188   | 24,654  | 素材                     |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額    | 240     | 354   | 411   | 53,814  |                        |
|                             | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 3     | —     | <0.1%>  |                        |
| (ユーロ…フィンランド)                |              |         |       |       |         |                        |
| KESKO OYJ-B SHS             |              | —       | 41    | 120   | 15,720  | 食品・生活必需品小売り            |
| WARTSILA                    |              | 32      | 84    | 106   | 13,887  | 資本財                    |
| UPM-KYMMENE OYJ             |              | 26      | 40    | 125   | 16,442  | 素材                     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        |              | 41      | 46    | 66    | 8,713   | 素材                     |
| SAMPO OYJ-A SHS             |              | 24      | 42    | 189   | 24,768  | 保険                     |
| FORTUM OYJ                  |              | 28      | 52    | 135   | 17,779  | 公益事業                   |
| ELISA OYJ                   |              | 10      | 12    | 64    | 8,459   | 電気通信サービス               |
| NOKIA OYJ                   |              | 318     | 535   | 270   | 35,352  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NESTE OYJ                   |              | 25      | 37    | 183   | 24,044  | エネルギー                  |
| KONE OYJ-B                  |              | 18      | 27    | 162   | 21,308  | 資本財                    |
| ORION OYJ                   |              | 10      | 19    | 75    | 9,860   | 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    | 536     | 939   | 1,500 | 196,338 |                        |
|                             | 銘柄 数 < 比 率 > | 10      | 11    | —     | <0.3%>  |                        |
| (ユーロ…アイルランド)                |              |         |       |       |         |                        |
| CRH PLC(DUBLIN)             |              | 39      | 56    | 248   | 32,459  | 素材                     |
| KINGSPAN GROUP PLC          |              | 11      | 13    | 139   | 18,292  | 資本財                    |
| KERRY GROUP PLC-A           |              | 8       | 12    | 145   | 18,999  | 食品・飲料・タバコ              |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     |              | —       | 25    | 113   | 14,911  | 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    |                        |
| (ユーロ…アイルランド)                 |               | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC    |               | 10      | 18     | 275    | 36,052    | 消費者サービス                |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 69      | 127    | 922    | 120,715   |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 5      | —      | <0.2%>    |                        |
| (ユーロ…ポルトガル)                  |               |         |        |        |           |                        |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA      |               | 218     | 307    | 145    | 19,097    | 公益事業                   |
| Galp Energia SGPS SA         |               | 26      | 89     | 79     | 10,373    | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS             |               | 18      | 50     | 105    | 13,770    | 食品・生活必需品小売り            |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 264     | 447    | 330    | 43,241    |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3      | —      | <0.1%>    |                        |
| ユ ー ロ 計                      | 株 数 ・ 金 額     | 10,556  | 16,764 | 46,568 | 6,092,615 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 189     | 189    | —      | <9.9%>    |                        |
| (イギリス)                       |               |         |        | 千英ポンド  |           |                        |
| ASHTED GROUP PLC             |               | 31      | 46     | 289    | 44,231    | 資本財                    |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |               | —       | 90     | 58     | 8,948     | 耐久消費財・アパレル             |
| AVIVA PLC                    |               | 229     | 324    | 128    | 19,631    | 保険                     |
| DIAGEO PLC                   |               | 130     | 199    | 747    | 114,314   | 食品・飲料・タバコ              |
| SCHRODERS PLC                |               | 12      | 22     | 82     | 12,684    | 各種金融                   |
| DCC PLC                      |               | —       | 17     | 102    | 15,712    | 資本財                    |
| BAE SYSTEMS PLC              |               | 179     | 230    | 130    | 19,996    | 資本財                    |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |               | 132     | 192    | 489    | 74,941    | 食品・飲料・タバコ              |
| HALMA PLC                    |               | 29      | 35     | 106    | 16,220    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| STANDARD CHARTERED PLC       |               | 171     | 249    | 111    | 17,115    | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          |               | 57      | 77     | 118    | 18,151    | 食品・飲料・タバコ              |
| HSBC HOLDINGS PLC            |               | 1,179   | 1,858  | 798    | 122,137   | 銀行                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    |               | 418     | 682    | 197    | 30,178    | 保険                     |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS  |               | 193     | —      | —      | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| Associated British Foods PLC |               | 21      | 46     | 93     | 14,272    | 食品・飲料・タバコ              |
| PERSIMMON PLC                |               | 21      | 29     | 78     | 11,990    | 耐久消費財・アパレル             |
| PRUDENTIAL PLC               |               | 146     | 256    | 378    | 57,973    | 保険                     |
| RIO TINTO PLC                |               | 66      | 103    | 459    | 70,262    | 素材                     |
| ST JAMES'S PLACE PLC         |               | 50      | 69     | 110    | 16,870    | 各種金融                   |
| SSE PLC                      |               | 68      | 100    | 161    | 24,761    | 公益事業                   |
| BP PLC                       |               | 1,153   | 1,854  | 638    | 97,711    | エネルギー                  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     |               | 3,755   | 6,352  | 307    | 47,009    | 銀行                     |
| TESCO PLC                    |               | 495     | —      | —      | —         | 食品・生活必需品小売り            |
| SMITH & NEPHEW PLC           |               | 50      | 80     | 106    | 16,284    | ヘルスケア機器・サービス           |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          |               | 289     | 424    | 661    | 101,219   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ASTRAZENECA PLC              |               | 79      | 144    | 1,338  | 204,757   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BT GROUP PLC                 |               | 572     | 940    | 152    | 23,400    | 電気通信サービス               |
| BARCLAYS PLC                 |               | 1,030   | 1,524  | 289    | 44,303    | 銀行                     |
| INTERTEK GROUP PLC           |               | 11      | 14     | 74     | 11,417    | 商業・専門サービス              |
| BURBERRY GROUP PLC           |               | 23      | 38     | 77     | 11,796    | 耐久消費財・アパレル             |
| NEXT PLC                     |               | 9       | 14     | 119    | 18,331    | 小売                     |
| KINGFISHER PLC               |               | 187     | 245    | 81     | 12,413    | 小売                     |
| ADMIRAL GROUP PLC            |               | 16      | 24     | 72     | 11,067    | 保険                     |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  |               | 214     | 346    | 580    | 88,769    | エネルギー                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  |               | 220     | 358    | 602    | 92,144    | エネルギー                  |
| BUNZL PLC                    |               | 24      | 27     | 75     | 11,592    | 資本財                    |

| 銘<br>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                 |
| (イギリス)                            |               | 百株      | 百株     | 千英ポンド   | 千円        |                        |
| RENTOKIL INITIAL PLC              |               | 142     | 221    | 134     | 20,637    | 商業・専門サービス              |
| London Stock Exchange Group PLC   |               | 19      | 33     | 235     | 36,074    | 各種金融                   |
| UNILEVER PLC                      |               | 66      | 233    | 911     | 139,486   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EXPERIAN PLC                      |               | 52      | 82     | 283     | 43,352    | 商業・専門サービス              |
| MONDI PLC                         |               | 32      | 36     | 67      | 10,262    | 素材                     |
| SEVERN TRENT PLC                  |               | 19      | 24     | 66      | 10,108    | 公益事業                   |
| Whitbread PLC                     |               | 20      | 34     | 114     | 17,565    | 消費者サービス                |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           |               | 21      | 35     | 54      | 8,274     | 各種金融                   |
| SMITHS GROUP PLC                  |               | 30      | 52     | 73      | 11,290    | 資本財                    |
| ANGLO AMERICAN PLC                |               | 80      | 133    | 363     | 55,636    | 素材                     |
| 3I GROUP PLC                      |               | 73      | 96     | 130     | 19,903    | 各種金融                   |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       |               | 43      | 72     | 445     | 68,153    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RELX PLC                          |               | 96      | 153    | 358     | 54,916    | 商業・専門サービス              |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        |               | —       | 66     | 69      | 10,594    | 公益事業                   |
| OCADO GROUP PLC                   |               | —       | 74     | 129     | 19,769    | 食品・生活必需品小売り            |
| GLENCORE PLC                      |               | 659     | 1,038  | 369     | 56,476    | 素材                     |
| NATWEST GROUP PLC                 |               | 393     | 600    | 128     | 19,649    | 銀行                     |
| SAGE GROUP PLC/THE                |               | 83      | 83     | 61      | 9,436     | ソフトウェア・サービス            |
| WPP PLC                           |               | 114     | 133    | 146     | 22,396    | メディア・娯楽                |
| COMPASS GROUP PLC                 |               | 103     | 199    | 314     | 48,128    | 消費者サービス                |
| NATIONAL GRID PLC                 |               | 195     | 292    | 275     | 42,188    | 公益事業                   |
| ABRDN PLC                         |               | 192     | 192    | 49      | 7,565     | 各種金融                   |
| BHP GROUP PLC                     |               | 119     | 179    | 339     | 51,894    | 素材                     |
| VODAFONE GROUP PLC                |               | 1,534   | 2,616  | 292     | 44,736    | 電気通信サービス               |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |               | 16      | 27     | 143     | 21,910    | 消費者サービス                |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           |               | 9       | 12     | 117     | 17,938    | 素材                     |
| FERGUSON PLC                      |               | 12      | 17     | 196     | 30,038    | 資本財                    |
| M&G PLC                           |               | 220     | 415    | 81      | 12,471    | 各種金融                   |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           |               | 55      | —      | —       | —         | 保険                     |
| TESCO PLC                         |               | —       | 567    | 158     | 24,184    | 食品・生活必需品小売り            |
| INFORMA PLC                       |               | 151     | 218    | 116     | 17,763    | メディア・娯楽                |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            |               | —       | 623    | 103     | 15,766    | 資本財                    |
| AUTO TRADER GROUP PLC             |               | —       | 97     | 58      | 9,021     | メディア・娯楽                |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      |               | 5       | 7      | 119     | 18,257    | 資本財                    |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       |               | 81      | 266    | 73      | 11,270    | 保険                     |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            |               | 382     | —      | —       | —         | 資本財                    |
| JOHNSON MATTHEY PLC               |               | 13      | 19     | 52      | 7,981     | 素材                     |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 16,320  | 25,981 | 16,458  | 2,517,718 |                        |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 66      | 69     | —       | <4.1%>    |                        |
| (スイス)                             |               |         |        | 千スイスフラン |           |                        |
| SGS SA                            |               | 0.33    | 0.43   | 120     | 14,943    | 商業・専門サービス              |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG            |               | 0.24    | 0.4    | 86      | 10,690    | 食品・飲料・タバコ              |
| SWISSCOM AG-REG                   |               | 1       | 2      | 104     | 12,992    | 電気通信サービス               |
| Lindt & Spruengli AG              |               | 0.11    | 0.15   | 175     | 21,735    | 食品・飲料・タバコ              |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       |               | —       | 0.01   | 117     | 14,539    | 食品・飲料・タバコ              |
| GIVAUDAN-REG                      |               | 0.52    | 0.79   | 347     | 43,040    | 素材                     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG         |               | 7       | 12     | 495     | 61,399    | 保険                     |
| NOVARTIS AG-REG SHS               |               | 128     | 194    | 1,478   | 183,152   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘<br>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                      |               | 95      | 162   | 518         | 64,212    | 資本財                    |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSS     |               | 41      | 66    | 2,433       | 301,430   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG(REG)         |               | 13      | 21    | 99          | 12,364    | 商業・専門サー ビス             |
| HOLCIM LTD                   |               | 23      | 34    | 160         | 19,937    | 素材                     |
| CLARIANT AG-REG              |               | 21      | 31    | 60          | 7,532     | 素材                     |
| NESTLE SA-REGISTERED         |               | 171     | 258   | 3,176       | 393,461   | 食品・飲料・タバコ              |
| Baloise Holding AG           |               | 4       | 4     | 58          | 7,255     | 保険                     |
| TEMENOS GROUP AG-REG         |               | 5       | 10    | 147         | 18,236    | ソフトウェア・サービス            |
| SONOVA HOLDING AG            |               | 4       | 5     | 238         | 29,548    | ヘルスケア機器・サービス           |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |               | 0.91    | 1     | 262         | 32,498    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG       |               | 146     | 262   | 245         | 30,412    | 各種金融                   |
| THE SWATCH GROUP AG-B        |               | 2       | 4     | 111         | 13,788    | 耐久消費財・アパレル             |
| LONZA GROUP AG-REG           |               | 4       | 7     | 560         | 69,414    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SWISS LIFE HOLDING AG        |               | 2       | 3     | 180         | 22,318    | 保険                     |
| SWISS PRIME SITE             |               | 6       | 6     | 61          | 7,605     | 不動産                    |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |               | 1       | 2     | 357         | 44,278    | 各種金融                   |
| Schindler Holding AG         |               | 1       | 1     | 45          | 5,691     | 資本財                    |
| Schindler Holding AG         |               | 2       | 4     | 114         | 14,149    | 資本財                    |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   |               | 4       | 6     | 185         | 22,918    | 運輸                     |
| Logitech International SA    |               | 13      | 21    | 156         | 19,439    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| GEBERIT AG-REG               |               | 1       | 2     | 177         | 21,944    | 資本財                    |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |               | 19      | 28    | 184         | 22,905    | 各種金融                   |
| SWISS RE AG                  |               | 16      | 25    | 230         | 28,607    | 保険                     |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG  |               | 27      | 51    | 633         | 78,465    | 耐久消費財・アパレル             |
| SIKA AG-REG                  |               | 8       | 13    | 427         | 52,896    | 素材                     |
| ALCON INC                    |               | 29      | 50    | 397         | 49,181    | ヘルスケア機器・サービス           |
| UBS GROUP AG                 |               | 210     | 312   | 522         | 64,742    | 各種金融                   |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 1,020   | 1,611 | 14,676      | 1,817,733 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 34      | 35    | —           | <2.9%>    |                        |
| (スウェーデン)                     |               |         |       | 千スウェーデンクローナ |           |                        |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |               | 108     | 138   | 1,927       | 25,369    | 銀行                     |
| Swedbank AB                  |               | 56      | 68    | 1,298       | 17,093    | 銀行                     |
| SWEDISH MATCH AB             |               | 12      | —     | —           | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| SECURITAS AB-B SHS           |               | 26      | 62    | 871         | 11,470    | 商業・専門サー ビス             |
| INVESTOR AB-B SHS            |               | 20      | —     | —           | —         | 各種金融                   |
| HENNES & MAURITZ AB-B        |               | 55      | 87    | 1,449       | 19,078    | 小売                     |
| ERICSSON LM-B SHS            |               | 174     | 271   | 2,607       | 34,311    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELIA COMPANY AB             |               | 189     | 259   | 891         | 11,737    | 電気通信サー ビス              |
| SKANSKA AB-B SHS             |               | 22      | 32    | 714         | 9,397     | 資本財                    |
| LUNDIN ENERGY AB             |               | 15      | 37    | 1,351       | 17,782    | エネルギー                  |
| ALFA LAVAL AB                |               | 20      | 34    | 1,296       | 17,067    | 資本財                    |
| Husqvarna AB                 |               | 49      | 79    | 991         | 13,054    | 資本財                    |
| SKF AB-B SHARES              |               | 24      | 38    | 797         | 10,499    | 資本財                    |
| VOLVO AB-B SHS               |               | 80      | 136   | 2,789       | 36,715    | 資本財                    |
| SANDVIK AB                   |               | 57      | 90    | 2,022       | 26,613    | 資本財                    |
| Industrivarden AB            |               | —       | 2     | 60          | 790       | 各種金融                   |
| Industrivarden AB            |               | 15      | 29    | 825         | 10,869    | 各種金融                   |
| SVENSKA CELLULOSEA AB-B SHS  |               | —       | 63    | 858         | 11,299    | 素材                     |

| 銘<br>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                 |
| (スウェーデン)                     |               | 百株      | 百株    | 千スウェーデンクローナ | 千円      |                        |
| HEXAGON AB-B SHS             |               | 17      | —     | —           | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELE2 AB-B SHS               |               | 48      | 76    | 947         | 12,463  | 電気通信サービス               |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |               | 30      | 51    | 2,863       | 37,686  | 資本財                    |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |               | 32      | 42    | 2,009       | 26,448  | 資本財                    |
| EPIROC AB-A                  |               | 32      | —     | —           | —       | 資本財                    |
| EPIROC AB-B                  |               | 34      | —     | —           | —       | 資本財                    |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          |               | 33      | 55    | 1,579       | 20,785  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EQT AB                       |               | —       | 39    | 1,945       | 25,597  | 各種金融                   |
| BOLIDEN AB                   |               | 27      | —     | —           | —       | 素材                     |
| EVOLUTION AB                 |               | 10      | 19    | 2,730       | 35,933  | 消費者サービス                |
| EPIROC AB-A                  |               | —       | 67    | 1,509       | 19,858  | 資本財                    |
| EPIROC AB-B                  |               | —       | 39    | 755         | 9,944   | 資本財                    |
| INVESTOR AB-B SHS            |               | —       | 135   | 2,795       | 36,785  | 各種金融                   |
| BOLIDEN AB                   |               | —       | 32    | 963         | 12,677  | 素材                     |
| KINNEVIK AB-B                |               | 21      | —     | —           | —       | 各種金融                   |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     |               | —       | 180   | 2,426       | 31,928  | 資本財                    |
| KINNEVIK AB-B                |               | —       | 33    | 1,172       | 15,434  | 各種金融                   |
| HEXAGON AB-B SHS             |               | —       | 164   | 2,348       | 30,900  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SWEDISH MATCH AB             |               | —       | 169   | 1,144       | 15,063  | 食品・飲料・タバコ              |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |               | 97      | 136   | 1,375       | 18,098  | 銀行                     |
| ASSA ABLOY AB-B              |               | 48      | 80    | 2,082       | 27,402  | 資本財                    |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     |               | 29      | —     | —           | —       | 資本財                    |
| NORDEA BANK ABP              |               | 157     | 253   | 2,745       | 36,127  | 銀行                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 1,552   | 3,011 | 52,149      | 686,287 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 30      | 33    | —           | <1.1%>  |                        |
| (ノルウェー)                      |               |         |       | 千ノルウェークローネ  |         |                        |
| TELENOR ASA                  |               | 51      | 51    | 703         | 9,329   | 電気通信サービス               |
| EQUINOR ASA                  |               | 62      | 80    | 1,819       | 24,139  | エネルギー                  |
| YARA INTERNATIONAL ASA       |               | 9       | 9     | 443         | 5,883   | 素材                     |
| MOWI ASA                     |               | 30      | 49    | 1,177       | 15,619  | 食品・飲料・タバコ              |
| NORSK HYDRO ASA              |               | 149     | 202   | 1,228       | 16,295  | 素材                     |
| ORKLA ASA                    |               | 56      | 56    | 480         | 6,379   | 食品・飲料・タバコ              |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    |               | 15      | 34    | 734         | 9,746   | 保険                     |
| DNB BANK ASA                 |               | —       | 78    | 1,678       | 22,275  | 銀行                     |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          |               | 16      | 20    | 771         | 10,238  | メディア・娯楽                |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 392     | 582   | 9,036       | 119,908 |                        |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8       | 9     | —           | <0.2%>  |                        |
| (デンマーク)                      |               |         |       | 千デンマーククローネ  |         |                        |
| CARLSBERG AS-B               |               | 7       | 9     | 1,012       | 17,801  | 食品・飲料・タバコ              |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |               | 0.48    | 0.61  | 1,227       | 21,599  | 運輸                     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A       |               | 0.2     | 0.32  | 612         | 10,779  | 運輸                     |
| DANSKE BANK A/S              |               | 48      | 57    | 630         | 11,086  | 銀行                     |
| GENMAB A/S                   |               | 4       | 7     | 2,225       | 39,140  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |               | 12      | —     | —           | —       | 資本財                    |
| H LUNDBECK A/S               |               | 12      | —     | —           | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DSV A/S                      |               | 13      | 21    | 3,377       | 59,406  | 運輸                     |
| PANDORA A/S                  |               | 7       | 8     | 813         | 14,305  | 耐久消費財・アパレル             |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S |               | 7       | 14    | 773         | 13,598  | 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  |                        |
| (デンマーク)                        |              | 百株      | 百株    | 千デンマーククローネ | 千円      |                        |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES         |              | 13      | 18    | 905        | 15,931  | 素材                     |
| COLOPLAST-B                    |              | 7       | 10    | 1,189      | 20,916  | ヘルスケア機器・サービス           |
| NOVO NORDISK A/S-B             |              | 99      | 151   | 11,150     | 196,137 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S        |              | —       | 109   | 2,449      | 43,085  | 資本財                    |
| TRYG A/S                       |              | —       | 36    | 563        | 9,903   | 保険                     |
| ORSTED A/S                     |              | 12      | 22    | 1,969      | 34,634  | 公益事業                   |
| DEMANT A/S                     |              | 11      | 22    | 738        | 12,983  | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額    | 259     | 491   | 29,636     | 521,309 |                        |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 15      | 15    | —          | <0.8%>  |                        |
| (オーストラリア)                      |              |         |       | 千豪ドル       |         |                        |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD         |              | —       | 28    | 204        | 17,003  | ヘルスケア機器・サービス           |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LTD  |              | 155     | 226   | 632        | 52,613  | 銀行                     |
| WESTPAC BANKING CORPORATION    |              | 203     | 307   | 691        | 57,562  | 銀行                     |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     |              | 115     | 175   | 255        | 21,292  | 素材                     |
| TELSTRA CORP LTD               |              | 286     | 356   | 139        | 11,620  | 電気通信サービス               |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED       |              | 51      | —     | —          | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE      |              | 15      | 17    | 161        | 13,401  | 各種金融                   |
| BHP GROUP LIMITED              |              | 168     | 263   | 967        | 80,533  | 素材                     |
| COMPUTERSHARE LIMITED          |              | 47      | 100   | 191        | 15,899  | ソフトウェア・サービス            |
| CSL LIMITED                    |              | 27      | 42    | 1,349      | 112,324 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TRANSURBAN GROUP               |              | 175     | 309   | 422        | 35,189  | 運輸                     |
| COCHLEAR LIMITED               |              | 6       | 8     | 185        | 15,427  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ORIGIN ENERGY LIMITED          |              | 134     | 366   | 183        | 15,231  | 公益事業                   |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA |              | 100     | 157   | 1,713      | 142,619 | 銀行                     |
| RIO TINTO LIMITED              |              | 20      | 33    | 298        | 24,877  | 素材                     |
| APA GROUP                      |              | —       | 190   | 165        | 13,790  | 公益事業                   |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         |              | —       | 73    | 348        | 28,968  | 消費者サービス                |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP      |              | 131     | 225   | 103        | 8,607   | 保険                     |
| ORICA LTD                      |              | 31      | 86    | 132        | 11,013  | 素材                     |
| LENDLEASE GROUP                |              | 51      | 128   | 140        | 11,651  | 不動産                    |
| BLUESCOPE STEEL LTD            |              | —       | 53    | 112        | 9,367   | 素材                     |
| SUNCORP GROUP LTD              |              | 103     | 109   | 123        | 10,263  | 保険                     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    |              | 188     | 280   | 811        | 67,543  | 銀行                     |
| NEWCREST MINING LIMITED        |              | 49      | 73    | 182        | 15,219  | 素材                     |
| AMP LIMITED                    |              | 365     | —     | —          | —       | 各種金融                   |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED    |              | 105     | 151   | 177        | 14,751  | 保険                     |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD    |              | 62      | 186   | 188        | 15,679  | 素材                     |
| SANTOS LTD                     |              | 151     | 189   | 131        | 10,954  | エネルギー                  |
| SONIC HEALTHCARE LTD           |              | 40      | 46    | 184        | 15,380  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED       |              | 284     | 394   | 203        | 16,928  | 消費者サービス                |
| WESFARMERS LIMITED             |              | 59      | 89    | 536        | 44,641  | 小売                     |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD         |              | 58      | 81    | 186        | 15,517  | エネルギー                  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD           |              | 70      | 104   | 410        | 34,149  | 食品・生活必需品小売り            |
| SEEK LTD                       |              | 41      | 60    | 207        | 17,276  | メディア・娯楽                |
| BRAMBLES LTD                   |              | 107     | 107   | 111        | 9,286   | 商業・専門サービス              |
| MACQUARIE GROUP LTD            |              | 20      | 31    | 636        | 52,971  | 各種金融                   |
| EVOLUTION MINING LTD           |              | 163     | 348   | 137        | 11,409  | 素材                     |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    |              | —       | 42    | 228        | 19,021  | 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       |
| (オーストラリア)                            |               | 百株      | 百株    | 千豪ドル        | 千円        |              |
| TREASURY WINE ESTATES LTD            |               | 56      | 132   | 153         | 12,748    | 食品・飲料・タバコ    |
| SYDNEY AIRPORT                       |               | 100     | —     | —           | —         | 運輸           |
| XERO LTD                             |               | —       | 18    | 268         | 22,376    | ソフトウェア・サービス  |
| AFTERPAY LTD                         |               | 17      | 27    | 329         | 27,448    | ソフトウェア・サービス  |
| AMPOL LTD                            |               | 18      | 48    | 150         | 12,487    | エネルギー        |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA        |               | —       | 237   | 167         | 13,976    | 食品・生活必需品小売り  |
| AGL ENERGY LTD                       |               | 30      | —     | —           | —         | 公益事業         |
| SOUTH32 LTD                          |               | 469     | 597   | 211         | 17,600    | 素材           |
| COLES GROUP LTD                      |               | 83      | 111   | 196         | 16,356    | 食品・生活必需品小売り  |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 4,371   | 6,620 | 14,337      | 1,192,984 |              |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 40      | 43    | —           | <1.9%>    |              |
| (ニュージーランド)                           |               |         |       | 千ニュージーランドドル |           |              |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                 |               | 46      | 61    | 90          | 7,310     | ヘルスケア機器・サービス |
| A2 MILK CO LTD                       |               | 53      | 184   | 120         | 9,711     | 食品・飲料・タバコ    |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C         |               | 38      | 62    | 201         | 16,177    | ヘルスケア機器・サービス |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                |               | 112     | 346   | 157         | 12,638    | 電気通信サービス     |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD            |               | 84      | 229   | 187         | 15,095    | 運輸           |
| MERIDIAN ENERGY LTD                  |               | 114     | 212   | 104         | 8,401     | 公益事業         |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 451     | 1,096 | 862         | 69,336    |              |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6       | 6     | —           | <0.1%>    |              |
| (香港)                                 |               |         |       | 千香港ドル       |           |              |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY               |               | 40      | —     | —           | —         | 半導体・半導体製造装置  |
| BANK OF EAST ASIA                    |               | 174     | —     | —           | —         | 銀行           |
| CLP HOLDINGS LIMITED                 |               | 105     | 105   | 798         | 11,570    | 公益事業         |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR          |               | 78      | 122   | 5,673       | 82,201    | 各種金融         |
| MTR CORPORATION                      |               | 125     | 160   | 690         | 10,003    | 運輸           |
| HANG SENG BANK                       |               | 44      | 56    | 815         | 11,822    | 銀行           |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT           |               | 154     | 314   | 1,047       | 15,175    | 不動産          |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED        |               | 90      | 105   | 497         | 7,211     | 公益事業         |
| HONG KONG & CHINA GAS                |               | 773     | 985   | 1,171       | 16,971    | 公益事業         |
| Galaxy Entertainment Group Limited   |               | 180     | 330   | 1,453       | 21,063    | 消費者サービス      |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD           |               | 270     | 320   | 780         | 11,313    | 銀行           |
| SINO LAND CO                         |               | 358     | 698   | 695         | 10,073    | 不動産          |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES              |               | 65      | 120   | 1,186       | 17,188    | 不動産          |
| SWIRE PACIFIC LTD A                  |               | 70      | 125   | 616         | 8,938     | 不動産          |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO             |               | 100     | 160   | 2,579       | 37,372    | 資本財          |
| AIA GROUP LTD                        |               | 718     | 1,146 | 9,809       | 142,143   | 保険           |
| HKT Trust / HKT Ltd                  |               | 370     | 780   | 834         | 12,093    | 電気通信サービス     |
| Sands China Ltd                      |               | 240     | 576   | 1,042       | 15,106    | 消費者サービス      |
| SWIRE PROPERTIES LTD                 |               | 126     | 206   | 425         | 6,163     | 不動産          |
| WH Group Limited                     |               | 655     | 1,660 | 884         | 12,820    | 食品・飲料・タバコ    |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD            |               | 143     | 228   | 1,203       | 17,431    | 資本財          |
| CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI) |               | 70      | 115   | 537         | 7,790     | 公益事業         |
| CK ASSET HOLDINGS LIMITED            |               | 178     | 193   | 927         | 13,443    | 不動産          |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額     | 5,127   | 8,505 | 33,671      | 487,900   |              |
|                                      | 銘 柄 数 < 比 率 > | 23      | 21    | —           | <0.8%>    |              |
| (シンガポール)                             |               |         |       | 千シンガポールドル   |           |              |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING           |               | 194     | 294   | 112         | 9,385     | 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     |             |       |
| (シンガポール)                     |               | 百株      | 百株      | 千シンガポールドル  | 千円         |             |       |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       |               | 89      | 168     | 542        | 45,467     | 銀行          |       |
| CITY DEVELOPMENTS            |               | 86      | 169     | 122        | 10,252     | 不動産         |       |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |               | 215     | —       | —          | —          | 運輸          |       |
| UNITED OVERSEAS BANK         |               | 56      | 89      | 248        | 20,805     | 銀行          |       |
| UNITED OVERSEAS LAND LTD     |               | 71      | 119     | 84         | 7,099      | 不動産         |       |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |               | —       | 1,081   | 277        | 23,278     | 電気通信サービス    |       |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |               | 579     | —       | —          | —          | 電気通信サービス    |       |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |               | 130     | 226     | 268        | 22,496     | 銀行          |       |
| KEPPEL CORP LTD              |               | 159     | 306     | 162        | 13,614     | 資本財         |       |
| GENTING SINGAPORE LTD        |               | 856     | 1,792   | 146        | 12,237     | 消費者サービス     |       |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 2,435   | 4,244   | 1,964      | 164,637    |             |       |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 10      | 9       | —          | <0.3%>     |             |       |
| (イスラエル)                      |               |         |         | 千イスラエルシェケル |            |             |       |
| BANK HAPOLIM BM              |               | 86      | 117     | 361        | 13,125     | 銀行          |       |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |               | 102     | 102     | 311        | 11,301     | 銀行          |       |
| ICL GROUP LTD                |               | 35      | 139     | 384        | 13,955     | 素材          |       |
| NICE LTD                     |               | 4       | 7       | 648        | 23,570     | ソフトウェア・サービス |       |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |               | 18      | 30      | 339        | 12,332     | 銀行          |       |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 246     | 396     | 2,044      | 74,284     |             |       |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —          | <0.1%>     |             |       |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 62,448  | 100,767 | —          | 58,931,508 |             |       |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 978     | 1,014   | —          | <95.3%>    |             |       |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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<br>柄                              | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |         |     |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|---------|-----|
|                                     | 口 数     | 口 数   | 評 価 額 |         | 比 率 |
|                                     |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |     |
| (アメリカ)                              | 千口      | 千口    | 千米ドル  | 千円      | %   |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 0.757   | 1     | 264   | 29,802  | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP                 | 2       | 4     | 1,177 | 132,843 | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 0.607   | 1     | 255   | 28,781  | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC               | 0.824   | 1     | 188   | 21,232  | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST               | 0.66    | 0.864 | 140   | 15,889  | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTL CORP              | 2       | 4     | 737   | 83,194  | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 1       | 2     | 446   | 50,387  | 0.1 |
| DUKE REALTY CORP                    | 2       | 3     | 192   | 21,686  | 0.0 |
| EQUINIX INC                         | 0.535   | 0.887 | 707   | 79,864  | 0.1 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC     | 1       | 1     | 115   | 13,041  | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL                  | 1       | 2     | 254   | 28,683  | 0.0 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC            | 0.381   | 0.568 | 193   | 21,836  | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 0.93    | 1     | 242   | 27,334  | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST           | 0.502   | —     | —     | —       | —   |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC           | 3       | 5     | 179   | 20,202  | 0.0 |

| 銘 柄                                   |               | 期首(前期末) |       | 当 期 末  |           | 比 率 |
|---------------------------------------|---------------|---------|-------|--------|-----------|-----|
|                                       |               | 口 数     | 口 数   | 評 価 額  |           |     |
|                                       |               |         |       | 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        | %   |
| HOST HOTELS & RESORTS INC             |               | 5       | 10    | 194    | 21,905    | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC                  |               | —       | 5     | 237    | 26,827    | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC                     |               | 2       | —     | —      | —         | —   |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC          |               | 4       | 8     | 175    | 19,762    | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC |               | 0.834   | 0.969 | 196    | 22,151    | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC        |               | 1       | —     | —      | —         | —   |
| PROLOGIS INC                          |               | 4       | 6     | 1,024  | 115,619   | 0.2 |
| PUBLIC STORAGE                        |               | 0.842   | 1     | 418    | 47,206    | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP                    |               | 1       | 3     | 236    | 26,644    | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP                  |               | 1       | 2     | 154    | 17,417    | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP               |               | 0.686   | 1     | 364    | 41,175    | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC              |               | 1       | 3     | 554    | 62,549    | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC                   |               | 0.761   | 1     | 230    | 25,999    | 0.0 |
| UDR INC                               |               | 2       | 3     | 177    | 19,986    | 0.0 |
| VENTAS INC                            |               | 2       | 4     | 228    | 25,758    | 0.0 |
| VICI PROPERTIES INC                   |               | —       | 8     | 235    | 26,578    | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST                  |               | 1       | 3     | 142    | 16,075    | 0.0 |
| WP CAREY INC                          |               | 1       | 1     | 143    | 16,219    | 0.0 |
| WELLTOWER INC                         |               | 2       | 4     | 370    | 41,767    | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO                       |               | 4       | 6     | 260    | 29,355    | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 61      | 108   | 10,435 | 1,177,782 |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 33      | 32    | —      | <1.9%>    |     |
| (カナダ)                                 |               |         |       | 千カナダドル |           |     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   |               | 2       | 4     | 100    | 9,147     | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 2       | 4     | 100    | 9,147     |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | 1     | —      | <0.0%>    |     |
| (ユーロ…フランス)                            |               |         |       | 千ユーロ   |           |     |
| KLEPIERRE                             |               | 1       | 3     | 86     | 11,375    | 0.0 |
| GECINA SA                             |               | 0.267   | 0.267 | 32     | 4,282     | 0.0 |
| COVIVIO                               |               | 0.366   | 0.894 | 67     | 8,839     | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD             |               | 1       | 1     | 111    | 14,579    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                               | 口 数 ・ 金 額     | 3       | 6     | 298    | 39,077    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4       | 4     | —      | <0.1%>    |     |
| (イギリス)                                |               |         |       | 千英ポンド  |           |     |
| BRITISH LAND CO PLC                   |               | 6       | 16    | 82     | 12,590    | 0.0 |
| SEGRO PLC                             |               | 7       | 9     | 124    | 19,029    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC             |               | 4       | 10    | 74     | 11,462    | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 19      | 36    | 281    | 43,082    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3     | —      | <0.1%>    |     |
| (オーストラリア)                             |               |         |       | 千豪ドル   |           |     |
| MIRVAC GROUP                          |               | 28      | 39    | 112    | 9,383     | 0.0 |
| GPT GROUP                             |               | 14      | 17    | 92     | 7,692     | 0.0 |
| STOCKLAND                             |               | 19      | 24    | 110    | 9,182     | 0.0 |
| DEXUS/AU                              |               | 7       | 7     | 80     | 6,728     | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                         |               | 10      | 15    | 367    | 30,610    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                         |               | 35      | 50    | 159    | 13,264    | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 116     | 155   | 923    | 76,863    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6       | 6     | —      | <0.1%>    |     |

| 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       |          |
| (香港)<br>LINK REIT                                  |               | 千口<br>15 | 千口<br>18 | 千香港ドル<br>1,306   | 千円<br>18,932 | %<br>0.0 |
| 小 計                                                | 口 数 ・ 金 額     | 15       | 18       | 1,306            | 18,932       |          |
|                                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1        | 1        | —                | <0.0%>       |          |
| (シンガポール)<br>CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST |               | 47       | 87       | 千シンガポールドル<br>188 | 15,835       | 0.0      |
| 小 計                                                | 口 数 ・ 金 額     | 47       | 87       | 188              | 15,835       |          |
|                                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1        | 1        | —                | <0.0%>       |          |
| 合 計                                                | 口 数 ・ 金 額     | 266      | 418      | —                | 1,380,720    |          |
|                                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 49       | 48       | —                | <2.2%>       |          |

(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<br>1,161 | 百万円<br>— |
|       |        | DJ EU STX 50 | 232          | —        |
|       |        | FTSE 100 IDX | 144          | —        |
|       |        |              |              |          |

(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

(2021年11月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>58,931,509 | %<br>95.2 |
| 投資証券         | 1,380,720        | 2.2       |
| コール・ローン等、その他 | 1,580,234        | 2.6       |
| 投資信託財産総額     | 61,892,463       | 100.0     |

(注) 当期末における外貨建純資産(61,688,427千円)の投資信託財産総額(61,892,463千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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=112.86円、1カナダドル=90.70円、1ユーロ=130.83円、1英ポンド=152.97円、1スイスフラン=123.85円、1スウェーデンクローナ=13.16円、1ノルウェークローネ=13.27円、1デンマーククローネ=17.59円、1豪ドル=83.21円、1ニュージーランドドル=80.42円、1香港ドル=14.49円、1シンガポールドル=83.79円、1イスラエルシェケル=36.33円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 61,991,619,132  |
| コール・ローン等        | 741,899,903     |
| 株式(評価額)         | 58,931,509,195  |
| 投資証券(評価額)       | 1,380,720,842   |
| 未収入金            | 190,767,431     |
| 未収配当金           | 41,246,077      |
| 差入委託証拠金         | 705,475,684     |
| (B) 負債          | 162,195,320     |
| 未払金             | 115,784,332     |
| 未払解約金           | 46,410,643      |
| 未払利息            | 345             |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 61,829,423,812  |
| 元本              | 15,096,651,804  |
| 次期繰越損益金         | 46,732,772,008  |
| (D) 受益権総口数      | 15,096,651,804口 |
| 1万円当たり基準価額(C／D) | 40,956円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,631,640,362円、期中追加設定元本額は12,994,905,631円、期中一部解約元本額は7,529,894,189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2<適格機関投資家限定> | 7,123,272,084円 |
| 東京海上セレクション・外国株式インデックス             | 6,373,597,588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>   | 1,063,230,006円 |
| 先進国株式インデックス (適格機関投資家専用)           | 176,043,772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>   | 132,487,759円   |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)          | 74,127,394円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035            | 47,432,147円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065            | 35,586,164円    |
| TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>        | 31,864,387円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045            | 23,134,784円    |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055            | 15,875,719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1万円当たり基準価額が、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 (2020年11月11日～2021年11月10日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 707,048,816     |
| 受取配当金              | 693,718,246     |
| 受取利息               | △ 842,220       |
| その他収益金             | 14,259,604      |
| 支払利息               | △ 86,814        |
| (B) 有価証券売買損益       | 13,656,717,457  |
| 売買益                | 14,339,706,179  |
| 売買損                | △ 682,988,722   |
| (C) 先物取引等取引損益      | 340,277,892     |
| 取引益                | 370,436,926     |
| 取引損                | △ 30,159,034    |
| (D) 保管費用等          | △ 19,803,441    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 14,684,240,724  |
| (F) 前期繰越損益金        | 18,111,489,354  |
| (G) 追加信託差損益金       | 34,419,665,665  |
| (H) 解約差損益金         | △20,482,623,735 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 46,732,772,008  |
| 次期繰越損益金(I)         | 46,732,772,008  |

(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。