

東京海上ターゲット・ イヤー・ファンド2065

＜愛称 年金コンパス＞

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)			
信託期間	無期限 (2019年9月20日設定)			
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。			
主要投資対象	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	以下4つのマザーファンドを主要投資対象とします。		
	T M A 日 本 株 式 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	東京証券取引所第一部上場株式		
	T M A 日 本 債 券 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	わが国の公社債		
	T M A 外 国 株 式 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	外国の株式		
	T M A 外 国 債 券 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	外国の公社債		
投資制限	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	・株式への実質投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。		
	T M A 日 本 株 式 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	制限なし	外貨建資産への投資制限	20%以下
	T M A 日 本 債 券 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	10%以下		20%以下
	T M A 外 国 株 式 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	制限なし		制限なし
	T M A 外 国 債 券 投 資 信 託 マ ザ ー フ ァ ン ド	10%以下		制限なし
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。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。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。			

第2期 運用報告書 (全体版)

(決算日 2021年1月25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、「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065＜愛称 年金コンパス＞」は、このたび、第2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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率					
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2019年9月20日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	1
1期(2020年1月27日)	10,584	0	5.8	67.1	1.9	29.7	0.9	1	
2期(2021年1月25日)	11,490	0	8.6	66.4	3.6	29.1	0.7	79	

(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、「債券組入比率」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、「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。
(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	株 式	株 式	債 券	投 資	信 託
		騰 落					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2020年1月27日	10,584	—	67.1	1.9	29.7		0.9
1月末	10,524	△ 0.6	68.0	1.6	30.1		1.0
2月末	9,887	△ 6.6	65.6	2.2	32.1		1.0
3月末	9,131	△ 13.7	64.9	3.8	31.9		0.9
4月末	9,574	△ 9.5	66.7	5.4	28.3		0.9
5月末	9,938	△ 6.1	65.6	5.9	28.7		0.9
6月末	10,002	△ 5.5	67.8	2.7	29.6		0.9
7月末	9,992	△ 5.6	67.2	3.0	30.1		0.9
8月末	10,528	△ 0.5	69.1	2.9	28.2		0.8
9月末	10,435	△ 1.4	66.7	3.8	30.2		0.8
10月末	10,206	△ 3.6	66.6	3.3	30.3		0.8
11月末	11,021	4.1	67.6	4.8	27.8		0.8
12月末	11,256	6.3	67.5	3.8	29.4		0.8
(期 末)							
2021年1月25日	11,490	8.6	66.4	3.6	29.1		0.7

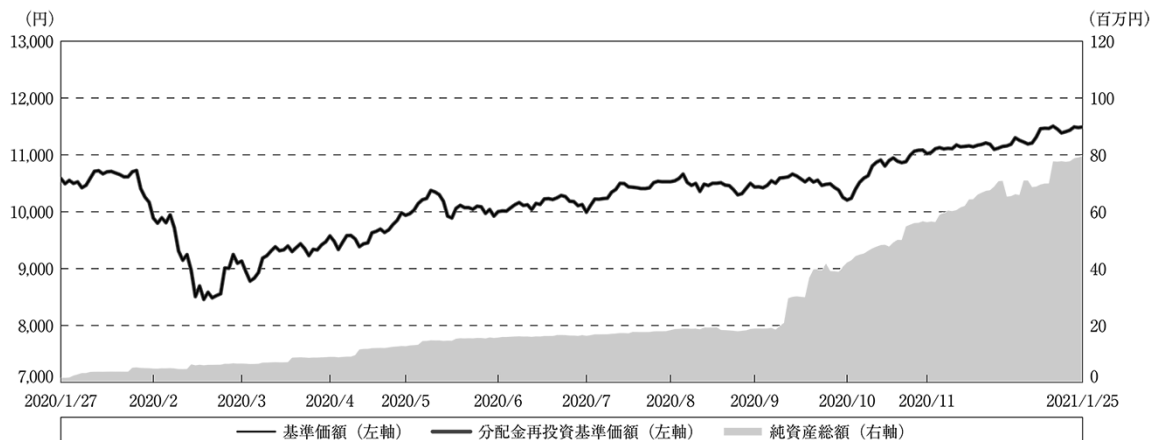
(注) 騰落率は期首比です。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○運用経過

(2020年1月28日～2021年1月25日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：10,584円

期 末：11,490円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 8.6% (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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2020年1月27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。

◇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の感染拡大を受けて、主要各国で大規模な財政・金融政策が実施されたこと
- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展による景気回復への期待
- ・米国大統領選挙でバイデン民主党候補の勝利が確実となり、大型財政出動への期待が高まったこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う景気減速懸念の高まり

■投資環境

【国内株式市況】

期初、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う景気減速が嫌気され、世界的に株式市場が下落するなか、国内株式市場も下落しました。その後、国内で新型コロナウイルス感染拡大ペースが鈍化したことに伴い、緊急事態宣言が解除されたことを受けて経済活動の正常化への期待が高まったことに加え、財政・金融政策の景気下支えもあり、国内株式市場は上昇に転じました。

期後半は、米国大統領選挙でバイデン民主党候補の勝利が確実となり大型財政出動への期待が高まったことや、欧米で新型コロナウイルスワクチンが承認されたことを受けて景気回復期待が高まったことなどから、国内株式市場は大きく上昇しました。また、米国連邦議会で9,000億米ドル規模の追加経済対策が成立したことも追い風となり、国内株式市場は前期末対比上昇しました。

【国内債券市況】

期初、-0.05%程度水準であった10年国債利回りは、新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした市場流動性の低下により、2020年3月中旬にかけて大きく上下する展開となりました。その後、主要各国で大規模な財政・金融政策が実施されたことを受けて市場のボラティリティ（変動性）が低下すると、10年国債利回りは期末にかけて0%から0.05%程度の狭いレンジ圏での推移が継続し、0.04%程度水準で期を終えました。

【外国株式市況】

期前半は、新型コロナウイルス感染拡大を受けて経済活動の制限措置などが世界的に導入されたことが嫌気され、外国株式市場は急落したものの、各国の政府や中央銀行による前例のない財政・金融政策が下支えとなり、株式市場は新型コロナウイルス感染拡大前の水準を回復しました。

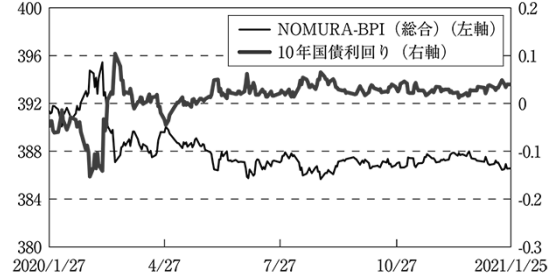
期後半は、欧米の製薬会社が開発した新型コロナウイルスワクチンの接種の進展とともに経済活動が正常化に向かうとの期待から、外国株式市場は続伸し、前期末比上昇しました。

TOPIX（東証株価指数）の推移



出所：ブルームバーグ

NOMURA-BPI（総合）・10年国債利回りの推移（%）



出所：ブルームバーグ

MSCIコクサイ指数
(円ヘッジなし・円ベース) の推移



(注) 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値を表示しています。

【外国債券市況】

期前半、米10年国債利回りはFRB（米連邦準備制度理事会）が緊急利下げや無制限の量的金融緩和などを講じたことにより大きく低下しました。期後半は、欧米の製薬会社が開発中の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、米国で民主党が大統領選挙に加え連邦議会選挙でも上下両院を制したことにより大規模な財政政策実現への期待が高まったことなどから、米10年国債利回りは上昇基調に転じましたが、期初からは低下した水準で期を終えました。

期初、ドイツ10年国債利回りは新型コロナウイルスの感染拡大への対応として、ECB（欧州中央銀行）がPEPP（パンデミック緊急購入プログラム）を導入したことなどを背景に大きく低下しました。その後、ドイツ10年国債利回りは上昇に転じる局面もありましたが、期後半は新型コロナウイルス感染再拡大などを背景に低下基調で推移し、期初からは小幅に低下した水準で期を終えました。

FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース) の推移



(注) FTSE世界国債インデックス（国内投信用）の値を表示しています。

出所：ブルームバーク

【為替市況】

米ドル円相場は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けてFRBが大規模な金融緩和策を講じたことにより米国債利回りが大きく低下したことなどを背景に、円高米ドル安が進行しました。主要国での経済活動の再開に伴い景気回復への期待が高まったことなどが好感され、円安米ドル高に振れる局面もありましたが、新型コロナウイルスの感染再拡大やFRBによる2023年までのゼロ金利政策維持の表明などを背景に円高米ドル安基調が継続し、前期末対比円高米ドル安となりました。

ユーロ円相場は、欧州復興基金が設立したことや、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などから円安ユーロ高基調で推移し、前期末対比円安ユーロ高となりました。

■ポートフォリオについて

<東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065>

国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れました。各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持しました。当期中の資産配分比率は以下の通りです。

【資産配分比率】

資産	マザーファンド	資産配分比率 (2020年1月28日以降)
国内株式	TMA日本株TOPIXマザーファンド	35%
国内債券	TMA日本債券インデックスマザーファンド	20%
外国株式	TMA外国株式インデックスマザーファンド	35%
外国債券	TMA外国債券インデックスマザーファンド	10%

以上の運用の結果、当ファンドの基準価額は、各マザーファンドの値動きを反映し、8.6%上昇しました。

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や、米国大統領選挙でバイデン民主党候補の勝利が確実となり大型財政出動期待が高まったことなどを背景に11.8%上昇し、株式配当などの要因を除くとベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

<TMA日本債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、国債利回りが上昇したことなどから1.3%下落し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

<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を目指して運用しました。当期の基準価額は、各国の政府や中央銀行による前例のない財政・金融政策や、新型コロナウイルスワクチン接種の進展により経済活動が正常化に向かうとの期待などを背景に11.2%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。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、FRBが緊急利下げや無制限の量的金融緩和政策などを講じたことを背景に4.2%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

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■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2期
	2020年1月28日～ 2021年1月25日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,490

（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四捨五入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

＜東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065＞

引き続き、国内外の複数の資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券）を主要投資対象とするマザーファンドを、それぞれの資産配分比率に応じて組み入れ、各マザーファンドの値動きによって生じる組入比率の変動に対し、資産配分からの乖離の修正を適宜行い、期を通じて各資産の資産配分を維持する運用を行います。

なお、各市場の今後の見通しは以下の通りです。

【国内株式市場見通し】

国内株式市場は、新型コロナウイルスの感染が拡大するなか、感染力の強い変異株の感染者が国内で確認されるなど先行き不透明感が強まっている一方、ワクチン接種の進展による経済活動の正常化や、米国の追加財政出動による景気回復への期待の高まりが、国内株式市場の下値を支えると考えられることから、おおむね横ばいでの推移を予想します。

【国内債券市場見通し】

国内債券市場は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に、国内経済には当面下押し圧力がかかると想定されます。こうした環境下では、日銀が現在の緩和的な金融政策を大きく変更する可能性は低く、国内投資家の余剰資金運用ニーズは根強いことなどから、長期金利は引き続き狭いレンジ内で推移すると予想します。

【外国株式市場見通し】

外国株式市場は、足元で株価バリュエーション（株価の割安度を測る指標）は高まっているものの、各国の政府や中央銀行による財政・金融政策が下支えとなり、中長期的には緩やかな上昇基調が継続すると想定しています。

【外国債券市場見通し】

米国債利回りは、新型コロナウイルスワクチン普及への期待感や追加財政刺激策による経済活動の回復期待から上昇すると予想します。ただし、FRBによる強力な金融緩和政策が継続されるなか、その上昇は緩やかに推移すると予想します。また、ドイツ国債利回りもECBが強力な金融緩和政策を継続する見通しであることから、利回りの上昇は限定的なものに止まると予想します。

為替市場では、米ドル円相場は日米金利差が低水準で推移する見込みであり、円高米ドル安が進みやすい地合いになると考えています。一方、ユーロ円相場は、現状円安ユーロ高が進んでいるものの、今後一段と円安ユーロ高が進行する余地は限定的と考えています。

＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

＜TMA外国株式インデックスマザーファンド＞

＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、上記4つのマザーファンドとも各々のベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 1 月28日～2021年 1 月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.306	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(15)	(0.142)	*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)	(15)	(0.142)	*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管理および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(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	1	0.014	(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)	(1)	(0.006)	*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
(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)	(0.007)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.008	(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)	(1)	(0.007)	*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	3	0.033	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.022)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.012)	*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)	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	36	0.361	
期中の平均基準価額は、10,207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。

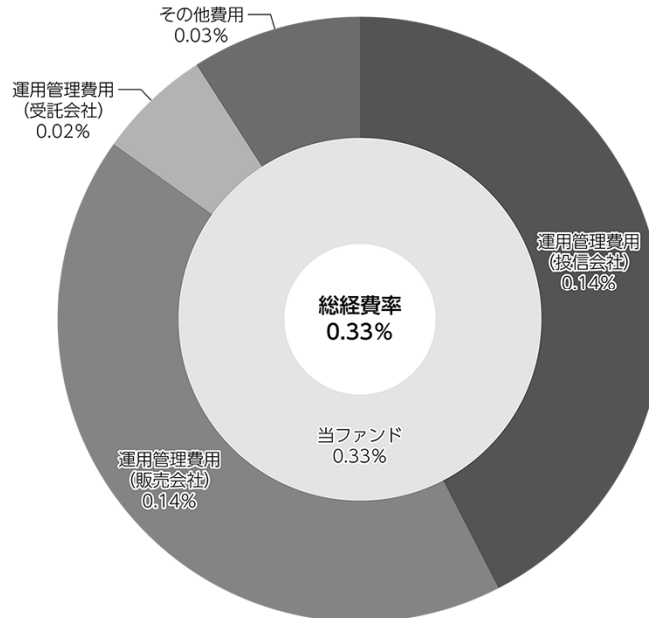
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.33%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

(2020年1月28日～2021年1月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 23,724	千円 33,786	千口 6,342	千円 9,233
TMA日本債券インデックスマザーファンド	15,588	20,237	3,796	4,929
TMA外国株式インデックスマザーファンド	12,067	33,983	3,266	9,414
TMA外国債券インデックスマザーファンド	5,990	9,982	1,464	2,445

○株式売買比率

(2020年1月28日～2021年1月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	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	14,484,915千円	11,919,928千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	27,746,332千円	20,821,011千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52	0.57

(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1月28日～2021年1月25日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	58	47	249

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○自社による当ファンドの設定・解約の状況

(2020年1月28日～2021年1月25日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 －	百万円 1	百万円 －	当初設定における取得の処分

○組入資産の明細

(2021年1月25日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	388	17,770	28,173
TMA日本債券インデックスマザーファンド	243	12,035	15,581
TMA外国株式インデックスマザーファンド	199	9,000	28,171
TMA外国債券インデックスマザーファンド	99	4,624	7,745

○投資信託財産の構成

(2021年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	28,173	35.3
TMA日本債券インデックスマザーファンド	15,581	19.5
TMA外国株式インデックスマザーファンド	28,171	35.3
TMA外国債券インデックスマザーファンド	7,745	9.7
コール・ローン等、その他	145	0.2
投資信託財産総額	79,815	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(32,481,420千円)の投資信託財産総額(32,547,672千円)に対する比率は99.8%です。

(注) TMA外国債券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(7,376,205千円)の投資信託財産総額(7,433,810千円)に対する比率は99.2%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＝103.84円、1カナダドル＝81.67円、1メキシコペソ＝5.21円、1ユーロ＝126.37円、1英ポンド＝142.11円、1スイスフラン＝117.31円、1スウェーデンクローナ＝12.51円、1ノルウェークローネ＝12.22円、1デンマーククローネ＝16.99円、1ポーランドズロチ＝27.84円、1豪ドル＝80.20円、1ニュージーランドドル＝74.71円、1香港ドル＝13.40円、1シンガポールドル＝78.25円、1マレーシアリンギット＝25.66円、1イスラエルシェケル＝31.73円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	79,815,665
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	28,173,412
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	15,581,723
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	28,171,325
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	7,745,628
未収入金	143,577
(B) 負債	140,419
未払解約金	76,419
未払信託報酬	61,885
その他未払費用	2,115
(C) 純資産総額(A－B)	79,675,246
元本	69,341,722
次期繰越損益金	10,333,524
(D) 受益権総口数	69,341,722口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,490円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,503,582円、期中追加設定元本額は88,824,986円、期中一部解約元本額は20,986,846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 (2020年1月28日～2021年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	5,213,895
売買益	6,353,378
売買損	△ 1,139,483
(B) 信託報酬等	△ 79,074
(C) 当期損益金(A＋B)	5,134,821
(D) 前期繰越損益金	26,297
(E) 追加信託差損益金	5,172,406
(配当等相当額)	(2,370,532)
(売買損益相当額)	(2,801,874)
(F) 計(C＋D＋E)	10,333,524
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	10,333,524
追加信託差損益金	5,172,406
(配当等相当額)	(2,452,189)
(売買損益相当額)	(2,720,217)
分配準備積立金	5,161,118

(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)	346,228円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	4,788,593円
c. 信託約款に規定する収益調整金	5,172,406円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	26,297円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	10,333,524円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,490円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

「つみたてNISA」の対象商品になるための要件として、「ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないこと」が定められており、当該要件を満たしていることが明確となるようにするため、また、各マザーファンドが連動する指数を明記するため、2020年10月24付で所要の約款変更を行いました。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2021年1月25日現在)

<TMA日本株TOPIXマザーファンド>

下記は、TMA日本株TOPIXマザーファンド全体(23, 205, 064千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	16.2	18	7,812
マルハニチロ	2.4	3.1	7,285
サカタのタネ	2.1	2	7,260
ホクト	1.9	2.5	5,440
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	68	68.4	42,271
石油資源開発	2.4	2.4	4,948
K&Oエナジーグループ	2.8	2.8	4,018
建設業 (2.3%)			
ショーボンドホールディングス	2.3	2.5	11,562
ミライト・ホールディングス	4.5	4.7	8,008
ベステラ	3	3	5,313
安藤・間	10.5	11.4	8,379
東急建設	5.1	7.9	4,068
コムシスホールディングス	6	6.4	19,936
東建コーポレーション	0.8	0.7	5,551
ヤマウラ	5.4	4.8	4,454
大成建設	13.3	14	49,000
大林組	41.7	42	38,682
清水建設	42.7	42.8	33,127
長谷工コーポレーション	17.6	17.2	21,482
鹿島建設	31.9	32.8	46,707
西松建設	2.8	2.8	6,728
三井住友建設	10.3	12.4	5,518
前田建設工業	10.1	11	9,713
奥村組	2.2	2.6	6,918
東鉄工業	2	2.9	7,948
戸田建設	17	19.4	14,297
熊谷組	1.8	2.8	7,411
大東建託	4.8	4.5	43,470
NIPPO	3.8	3.8	10,237

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
前田道路	4.2	4.2	7,366
東亜建設工業	3.8	2.9	6,066
五洋建設	16.7	18.3	16,579
住友林業	9.5	10.4	21,507
日本基礎技術	1.1	5.7	2,650
大和ハウス工業	39	41.1	124,820
積水ハウス	43.2	45.1	96,085
北陸電気工事	4.4	4	4,912
中電工	2.6	2.4	5,188
関電工	6	6.8	6,154
きんでん	9.4	10	17,230
日本電設工業	2.7	2.8	5,684
協和エクシオ	5.1	5.9	16,354
新日本空調	3.8	1.6	3,465
九電工	2.6	2.6	8,359
三機工業	5.3	4.2	5,237
日揮ホールディングス	12.1	13.2	15,628
中外炉工業	2.3	2.3	3,755
ヤマト	6.5	6.5	4,595
高砂熱学工業	3.5	4.6	7,355
三晃金属工業	0.8	0.8	2,318
大気社	1.9	3.7	10,374
日比谷総合設備	3.5	3.5	6,538
OSJBホールディングス	16.3	17.3	4,757
東洋エンジニアリング	4.7	5.6	2,542
レイズネクスト	4.9	3.3	3,966
食料品 (3.4%)			
ニッポン	3.7	3.9	6,314
日清製粉グループ本社	14.1	15.4	25,810
鳥越製粉	6.3	6	5,232
日本甜菜製糖	3	3	4,806
三井製糖	1.6	2	3,738

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
森永製菓	3.1	3.2	12,592
江崎グリコ	3.6	3.7	16,946
山崎製パン	10.4	10.6	18,910
亀田製菓	1.2	1	4,865
寿スピリッツ	1.3	1.2	6,600
カルビー	5.7	6	18,900
森永乳業	2.6	2.5	12,850
ヤクルト本社	8.8	9.1	50,596
明治ホールディングス	8.5	8.8	63,008
雪印メグミルク	2.8	2.8	6,409
プリマハム	2.3	2.3	7,291
日本ハム	5	5.1	22,491
丸大食品	2.2	2.9	4,953
S F o o d s	2.2	2.5	8,637
伊藤ハム米久ホールディングス	8.6	10.2	7,140
サッポロホールディングス	4.4	4.6	9,200
アサヒグループホールディングス	26.5	29	124,526
キリンホールディングス	53.5	56.4	129,579
宝ホールディングス	9.5	10.2	12,770
オエノンホールディングス	13.7	10.4	3,993
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9.6	9.9	15,592
サントリー食品インターナショナル	8.5	8.9	32,529
ダイドードールグループホールディングス	1	1.1	5,643
伊藤園	3.8	4	25,960
キーコーヒー	1.9	1.8	3,866
ユニカフェ	4	3.6	3,571
ジャパンフーズ	3.8	3.8	4,636
日清オイリオグループ	1.8	2.6	7,878
不二製油グループ本社	3	3	9,195
Jーオイルミルズ	0.9	0.7	2,569
キッコーマン	9	9.6	72,672
味の素	27.8	29.4	71,897
キュービー	7	7.5	17,055
ハウス食品グループ本社	4.6	4.6	17,250
カゴメ	4.9	5.1	17,314
アリアケジャパン	1.2	0.9	6,039
ニチレイ	6.4	6.8	19,896
東洋水産	6.4	6.8	35,088

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	5.3	5.6	50,512
フジッコ	2.2	3.5	7,101
ロック・フィールド	4.4	4.2	6,379
日本たばこ産業	72.5	71.3	146,414
ユーグレナ	8.2	5.6	4,933
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	4.6	4.6	6,311
グンゼ	0.6	1.1	3,630
東洋紡	4.8	5.4	7,300
倉敷紡績	2	1.9	3,431
日本毛織	6.5	7	6,741
帝国繊維	2.1	2.3	5,264
帝人	9.6	10.5	20,580
東レ	86.6	95.1	68,909
日本フェルト	10.3	8	3,440
セーレン	3.1	4.1	6,543
小松マテーレ	7.3	6.4	6,476
ワコールホールディングス	3.3	3.4	7,000
ホギメディカル	1.6	2.4	7,752
T S I ホールディングス	7.8	9.8	2,469
三陽商会	2.8	—	—
オンワードホールディングス	7.8	—	—
ゴールドウイン	2.2	2.1	13,440
デサント	3.7	3.7	6,722
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	1.2	1.1	5,285
王子ホールディングス	54.6	57.8	37,165
日本製紙	5.7	5.9	7,327
三菱製紙	2.6	6.3	2,104
北越コーポレーション	9.2	13.2	5,728
大王製紙	5.7	6	11,742
レンゴー	12.6	13.6	11,682
ザ・バック	1.4	1.1	2,839
化学 (7.5%)			
クラレ	20.8	21.6	24,472
旭化成	81.9	86.2	103,827
共和レザー	5.2	4.2	2,658
昭和電工	8.9	9.6	23,356

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友化学	96.8	98.9	49,450
日産化学	7	7.1	43,452
クレハ	1.1	1.1	7,447
石原産業	1	6.7	5,112
片倉コープアグリ	3.6	3.6	4,417
日本曹達	2.1	1.9	5,814
東ソー	19.1	20.3	36,316
トクヤマ	3.3	3.4	8,914
セントラル硝子	2.5	2.7	5,904
東亜合成	7.8	8.3	9,760
大阪ソーダ	1.9	1.8	4,716
デンカ	4.6	4.7	19,646
信越化学工業	21.2	22.3	437,860
堺化学工業	2.1	4.2	8,643
エア・ウォーター	10.1	11.4	20,041
日本酸素ホールディングス	10.9	12.4	25,953
日本パーカライジング	6.4	6.8	6,915
ステラ ケミファ	1.8	1.3	4,842
日本触媒	2.2	2	11,620
カネカ	3.1	3.1	11,454
三菱瓦斯化学	12.4	12.7	32,245
三井化学	11.3	12.1	37,026
J S R	12.7	12.1	39,688
東京応化工業	2	1.9	14,744
三菱ケミカルホールディングス	82.2	87.9	65,573
KHネオケム	2.2	2	5,052
ダイセル	18.9	18.4	14,591
住友ベークライト	1.9	1.7	6,392
積水化学工業	26.4	27.6	56,497
日本ゼオン	11.3	12.2	18,812
アイカ工業	3.5	3.6	12,852
宇部興産	6.1	6.5	13,247
旭有機材	2.8	2.8	4,202
日立化成	5.6	—	—
タイガースポリマー	4.6	5.6	2,240
ミライアル	2.8	2.8	3,460
日本化薬	7.3	7.8	7,800
A D E K A	5.7	6	10,836

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日油	4.7	4.8	24,192
ハリマ化成グループ	4.7	4.7	4,483
花王	30.2	31.6	242,688
ニイタカ	2.8	1.8	5,049
三洋化成工業	0.9	1.2	6,492
日本ペイントホールディングス	10.1	10.6	99,958
関西ペイント	13.8	14.7	44,394
中国塗料	5.9	6.4	6,278
太陽ホールディングス	2	0.8	5,248
D I C	5.5	5.7	14,877
サカタインクス	3.8	4	4,196
東洋インキ S C ホールディングス	2.3	2.7	5,043
富士フイルムホールディングス	24.1	25.4	158,927
資生堂	25	26.3	184,336
ライオン	16.4	17.3	40,776
高砂香料工業	1.3	2.2	5,533
マンダム	2.7	3	4,764
ミルボン	1.7	1.4	9,506
ファンケル	5.6	5.6	22,512
コーセー	2.3	2.5	41,550
コタ	4.2	4.1	6,031
ポーラ・オルビスホールディングス	5.2	5.4	11,674
ノエビアホールディングス	1	1.9	8,797
エステー	2.9	2.8	5,558
長谷川香料	3	2.9	5,939
小林製薬	3.5	3.7	43,956
荒川化学工業	4	4	4,828
メック	5.1	2	4,820
タカラバイオ	3.2	3.2	9,206
アース製薬	1	0.7	4,242
大成ラミック	1.7	1.6	4,624
クミアイ化学工業	9	7.1	6,248
日本農薬	4.3	6.3	3,068
日東電工	8.7	9.2	85,468
レック	1.9	3.3	4,464
前澤化成工業	3.8	3.8	3,678
エフビコ	1.4	2.4	10,020
天馬	2.7	2.7	5,894

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
信越ポリマー	8.4	5.2	5,049
ニフコ	4.8	4.9	18,914
バルカー	1.6	1.8	3,888
ユニ・チャーム	24.3	28	135,016
医薬品 (5.9%)			
協和キリン	14.3	13.5	39,393
武田薬品工業	104.9	110.2	409,282
アステラス製薬	110	114.9	197,628
大日本住友製薬	9.3	9.9	15,315
塩野義製薬	16.1	16.7	96,041
あすか製薬	3.9	3.7	5,842
日本新薬	3.3	3.4	24,752
中外製薬	13.1	41.4	233,868
科研製薬	2.3	2.2	9,020
エーザイ	15.2	15.9	124,815
ロート製薬	6.2	6.6	20,691
小野薬品工業	29.7	30.5	94,794
久光製薬	3.5	3.5	21,455
持田製薬	1.8	1.5	5,857
参天製薬	23.3	24.9	42,130
ツムラ	3.8	4	13,580
日医工	3.8	4.2	4,208
キッセイ薬品工業	2	4.1	9,134
生化学工業	4.1	3.8	3,917
栄研化学	2.2	3.5	6,982
鳥居薬品	1.6	1.2	3,924
J C R ファーマ	0.9	3.1	7,697
東和薬品	2.1	2.7	5,362
沢井製薬	2.4	2.5	11,937
ゼリア新薬工業	3	3.2	6,163
第一三共	36.1	113.7	407,728
キョーリン製薬ホールディングス	2.9	3.1	6,069
大幸薬品	2.6	4.2	6,854
大塚ホールディングス	24	27.5	123,145
大正製薬ホールディングス	2.7	2.7	18,171
ペプチドリーム	6.4	6.7	39,597
石油・石炭製品 (0.4%)			
ニチレキ	6.1	2.4	3,638

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
出光興産	14.4	14.9	37,607
ENEOSホールディングス	204	195.2	84,990
コスモエネルギーホールディングス	3.3	3.7	8,587
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	7	7.6	12,889
TOYO TIRE	6.8	7.2	11,800
ブリヂストン	38.8	35.2	144,320
住友ゴム工業	11	12	11,928
オカモト	0.8	0.9	3,514
ニッタ	1.4	1.8	4,005
住友理工	6.5	8.5	4,989
パンドー化学	3.7	5.8	3,828
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	1.8	1.6	7,456
A G C	12.4	12.2	46,726
日本山村硝子	3.2	3.2	2,761
日本電気硝子	5.3	5.3	11,962
住友大阪セメント	2.4	2.4	7,476
太平洋セメント	7.8	8.3	22,086
日本ヒューム	6.4	6.4	5,036
東海カーボン	11.8	13	19,890
東洋炭素	2.4	2.6	5,353
T O T O	9.1	9.5	56,620
日本碍子	14.8	16.4	28,749
日本特殊陶業	10.6	10.8	19,418
ニチアス	3.3	3.3	8,131
ニチハ	1.8	3.4	11,186
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	56.3	58.7	76,632
神戸製鋼所	22.6	25.1	13,077
ジェイ エフ イー ホールディングス	33.4	35	35,105
東京製鐵	6.8	8.1	5,459
共英製鋼	1.6	3.4	4,702
大和工業	2.4	2.4	6,451
大阪製鐵	1.6	3.2	4,060
淀川製鋼所	2.3	2.2	4,624
丸一鋼管	4.3	4.5	10,242
大同特殊鋼	2.1	2	8,440

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山陽特殊製鋼	0.1	5.1	7,486
愛知製鋼	0.7	1.4	4,459
日立金属	13.1	14.5	24,360
大太平洋金属	0.9	2.9	6,861
新日本電工	16.3	25.9	7,355
三菱製鋼	3.8	3.9	2,503
シンニッタン	11.5	9.4	1,927
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	34.9	4	7,928
三井金属鉱業	3.2	3.5	14,122
東邦亜鉛	1	2.4	5,712
三菱マテリアル	7.9	8.6	20,468
住友金属鉱山	16.2	16.8	85,730
DOWAホールディングス	2.8	2.8	11,326
古河機械金属	3.6	3.6	4,485
UACJ	2.7	2.3	4,420
古河電気工業	3.3	3.5	9,975
住友電気工業	46.4	49.1	71,145
フジクラ	13.9	15.8	7,694
タツタ電線	7.2	7.1	5,601
リョービ	2.6	4.5	5,589
アサヒホールディングス	2.9	2	8,660
金属製品 (0.6%)			
トーカロ	3.2	4.7	7,280
SUMCO	14.2	16.5	40,359
東洋製罐グループホールディングス	7.7	8.2	9,471
コロナ	3.8	3.4	3,202
横河ブリッジホールディングス	3.4	2.9	5,965
駒井ハルテック	1.8	1.8	4,181
三和ホールディングス	12.3	13.4	16,374
文化シヤッター	3.3	5.6	5,213
三協立山	4.9	4.7	3,821
LIXIL	18.3	19.4	48,247
ノーリツ	3.8	5.1	7,823
長府製作所	2.2	2.1	4,395
リンナイ	2.1	2.4	27,000
日東精工	9.1	9.1	4,113
東プレ	2.9	7.4	10,870

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高周波熱錬	7	4.8	2,318
パイオラックス	3	4.7	7,233
日本発條	12.4	13.8	9,963
三益半導体工業	4.2	1.5	4,515
機械 (5.8%)			
日本製鋼所	3.7	3.9	12,090
三浦工業	5.2	5.6	34,552
タクマ	4.3	4.9	10,613
オークマ	1.5	1.1	6,864
芝浦機械	2.4	2.7	6,782
アマダ	16.6	17.7	21,293
アイダエンジニアリング	6.5	5.7	5,654
F U J I	4.3	4.9	14,033
牧野フライス製作所	1.4	1.6	6,752
オーエスジー	6	6.4	12,473
旭ダイヤモンド工業	8.1	9.3	4,417
DMG森精機	7.6	8.1	13,113
ディスコ	1.7	1.8	66,960
日東工器	2.6	2.5	4,362
島精機製作所	1.8	2.3	4,324
日阪製作所	6.7	4.6	3,900
ナプテスコ	7.5	7.7	39,116
SMC	3.9	4.1	277,734
ユニオンツール	1.8	1.9	6,792
オイレス工業	2.4	2.3	3,877
サトーホールディングス	1.3	4	8,824
小松製作所	56.9	60	176,100
住友重機械工業	6.9	7.5	22,762
日立建機	4.8	5	16,100
巴工業	2.4	2.4	4,884
井関農機	2.8	3.7	5,135
タカキタ	6	5.5	3,905
クボタ	66.7	70.2	165,672
月島機械	4.3	3.8	5,266
帝国電機製作所	3.9	3.3	3,933
新東工業	4.9	6.1	4,593
小森コーポレーション	4.8	4.9	3,488
鶴見製作所	3.2	3.2	5,801

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
荏原製作所	5.4	5.6	20,636
西島製作所	5.9	5.9	5,156
ダイキン工業	16	16.9	394,277
栗田工業	6.5	7.1	31,488
椿本チエイン	1.5	2.2	6,072
ダイフク	6.5	6.7	86,095
タダノ	5.9	4.6	4,328
フジテック	4.7	5.2	12,339
CKD	4.3	3.8	10,066
平和	3.4	3.6	5,245
SANKYO	3.1	3.1	9,114
日本金銭機械	4.3	4.9	2,557
フクシマガリレイ	1.1	1.4	6,069
竹内製作所	1.5	2.5	6,010
アマノ	3.5	3.5	8,508
グローリー	3.4	3.9	7,987
大和冷機工業	5.7	4.7	4,869
セガサミーホールディングス	12.5	13.6	23,201
リケン	0.8	2	4,256
ホシザキ	3.7	4.2	37,926
大豊工業	5.8	4.2	3,192
日本精工	26.3	26.8	26,022
NTN	28.9	34.8	9,570
ジェイテクト	12.3	13.4	11,872
不二越	1.3	1.8	7,911
日本トムソン	8.3	10.6	5,119
THK	7.9	8	29,280
ユーシン精機	4	4.1	3,956
キッツ	7.1	6.6	3,960
マキタ	15.9	17.3	89,095
日立造船	11.4	12.4	8,208
三菱重工業	21.1	22.3	70,423
IHI	9.6	10.3	20,589
スター精密	3.2	3.7	6,012
電気機器 (18.0%)			
日清紡ホールディングス	6.7	8.1	6,366
イビデン	7.4	8	40,880
コニカミノルタ	27.7	30.8	13,028

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブラザー工業	15.6	16.3	38,142
ミネベアミツミ	23.2	24.8	58,329
日立製作所	60.4	63.5	279,273
三菱電機	124.8	132.4	221,108
富士電機	8	8	33,200
安川電機	13.8	14.3	83,226
明電舎	3.5	3.5	8,729
東芝テック	2.4	1.2	4,512
マブチモーター	3.5	3.5	14,630
日本電産	15.2	31.8	455,376
東光高岳	3.2	3.2	5,193
ダイヘン	2	1.5	7,462
日新電機	3.3	3.8	5,320
オムロン	11.8	11.8	111,038
日東工業	2.5	2.4	4,977
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4.2	4.7	15,110
メルコホールディングス	1.6	1.4	4,900
テクノメディカ	1.8	1.8	2,844
日本電気	15.5	16	94,880
富士通	12.2	12.7	212,598
沖電気工業	5	5.4	5,832
サンケン電気	2.4	2.1	10,731
アイホン	2.8	2.8	4,597
ルネサスエレクトロニクス	59.6	56.1	74,837
セイコーエプソン	15.7	17.3	28,752
ワコム	5.9	6.2	6,249
アルパック	2.5	2.6	13,390
E I Z O	1.3	3.1	11,625
日本信号	5.3	4.5	4,212
能美防災	2.1	2.3	5,112
ホーチキ	3.5	3.5	4,329
エレコム	—	1.2	6,060
パナソニック	142.6	151.4	215,442
シャープ	11.9	14.9	30,887
アンリツ	8.2	8.8	23,355
富士通ゼネラル	3.9	4	10,544
ソニー	79.7	82.8	852,840
TDK	6.1	6.4	113,600

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルプスアルパイン	11.1	12	18,516
日本トリム	0.2	0.7	3,181
フォスター電機	3.4	3.4	5,059
ヨコオ	2.5	2.2	7,238
ホシデン	4.2	8.4	8,064
ヒロセ電機	1.7	1.9	29,659
日本航空電子工業	3.5	3.9	6,345
アイコム	2.3	2	5,424
船井電機	8.3	5.6	2,408
横河電機	12.8	11.9	27,584
アズビル	8.2	8.4	45,780
日本光電工業	5.5	5.7	17,898
堀場製作所	2.5	2.5	17,350
アドバンテスト	9.2	9.8	89,866
キーエンス	11.4	12	689,640
日置電機	1.3	1	4,255
シスメックス	9.1	9.5	123,500
OBARA GROUP	0.9	1	4,140
コーセル	3.6	1.4	1,709
イリソ電子工業	1.1	1.1	5,285
オブテックスグループ	3.5	3.2	6,688
千代田インテグレ	2.6	2.6	4,682
レーザーテック	5	5.8	87,348
スタンレー電気	8.5	9.4	31,020
ウシオ電機	7.3	7.8	10,881
日本セラミック	1.5	1.9	5,401
図研	2.8	2.2	6,289
日本電子	2.6	2.6	11,635
カシオ計算機	10.8	11.7	20,697
ファナック	11.9	12.4	334,304
ローム	5.7	5.5	64,295
浜松ホトニクス	8.9	9.5	61,940
三井ハイテック	3.5	3.2	14,064
新光電気工業	6.4	4.9	13,230
京セラ	17.7	18.6	129,307
太陽誘電	5.2	5.8	35,032
村田製作所	37	38.9	411,562
双葉電子工業	3	4.5	4,257

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチコン	5.1	4.9	7,394
日本ケミコン	1.7	2.3	4,544
KOA	3.3	3.1	5,248
小糸製作所	7.6	7.9	55,853
ミツバ	7.8	7.8	3,525
S C R E E Nホールディングス	2.2	2.1	17,703
キャノン電子	2.8	3.4	5,429
キャノン	67.3	65.9	146,627
リコー	33.7	36.2	26,643
象印マホービン	3.5	3.7	6,434
東京エレクトロン	8.4	8.3	364,951
輸送用機器 (7.2%)			
トヨタ紡織	4	3.9	6,489
ユニプレス	2.3	6.3	6,167
豊田自動織機	10.1	10.7	92,876
モリタホールディングス	2.8	2.8	4,774
デンソー	27.7	29.1	174,396
東海理化電機製作所	3.1	3.5	5,964
川崎重工業	9.7	10.6	25,355
日産自動車	146.3	151.5	83,249
いすゞ自動車	39.9	38.9	37,032
トヨタ自動車	141.2	147.6	1,133,125
日野自動車	15.2	17.8	16,358
三菱自動車工業	46.1	51.5	12,102
武蔵精密工業	3.2	4	5,980
日産車体	6.5	4.7	4,074
新明和工業	5.3	4.5	4,090
極東開発工業	3.2	3	4,308
日信工業	3.9	—	—
トビー工業	1.3	2.8	3,592
ティラド	2.4	2.4	3,211
NOK	6.4	6.8	8,466
フタバ産業	7	8.2	4,223
KYB	1.8	2.9	6,757
プレス工業	11.8	19.8	6,138
ケーヒン	3	—	—
アイシン精機	10.4	11	34,430
マツダ	38.5	41.1	31,441

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
今仙電機製作所	6	6	4,410
本田技研工業	99.3	104.2	294,312
スズキ	25	26.2	134,589
S U B A R U	39	41.2	83,677
ヤマハ発動機	16.5	18.7	41,046
ショーワ	3.6	—	—
エクセディ	2.8	4.3	6,308
豊田合成	3.9	4.1	11,455
愛三工業	7.2	7.2	3,780
ヨロズ	3	3.8	4,753
エフ・シー・シー	2.4	2.7	4,654
シマノ	4.8	4.9	128,478
テイ・エス テック	2.8	2.9	8,961
精密機器 (2.6%)			
テルモ	35.6	37.5	157,237
クリエートメディック	4.4	4	3,872
島津製作所	15.2	15.9	66,064
ブイ・テクノロジー	0.9	0.9	5,859
東京精密	2.1	2.2	11,264
マニー	4.8	5	14,530
ニコン	22.2	22	18,810
トプコン	6.3	6.8	8,874
オリンパス	69.6	73.3	150,741
理研計器	2.2	2.4	7,296
タムロン	1.8	2.7	5,486
HOYA	25.4	26.2	359,202
朝日インテック	10.5	15	51,825
シチズン時計	14.6	18.7	5,722
メニコン	1.6	1.5	10,245
セイコーホールディングス	2.2	2.4	3,172
ニプロ	8.5	9.2	11,371
その他製品 (2.7%)			
パラマウントベッドホールディングス	1.3	1.4	6,685
バンダイナムコホールディングス	13	13.7	130,752
アイフィスジャパン	6.1	4.4	3,115
パイロットコーポレーション	2	1.9	5,677
トッパン・フォームズ	6	5.4	5,756
フジシールインターナショナル	2.7	2.9	5,599

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカラトミー	5.6	6.7	6,030
タカノ	4.9	4.1	2,447
大建工業	2.6	4.8	8,433
凸版印刷	18.1	19.7	29,313
大日本印刷	16.8	17.5	32,357
N I S S H A	1.9	4.2	5,812
アシックス	12.3	11.7	20,849
小松ウオール工業	2.2	2.2	3,825
ヤマハ	7.5	7.9	47,953
クリナップ	6.8	5.1	2,391
ビジョン	7.6	8.5	39,100
キングジム	5.8	5.8	4,993
リンテック	2.6	2.7	6,558
イトーキ	9.7	9.7	3,249
任天堂	7.7	8.1	507,708
三菱鉛筆	3.1	5	6,530
タカラスタンダード	3.2	3.4	5,130
コクヨ	5.6	6	8,058
オカムラ	4.5	6.9	6,499
美津濃	2.5	2.4	4,982
電気・ガス業 (1.4%)			
東京電力ホールディングス	99.8	108	44,172
中部電力	38.3	40.8	53,774
関西電力	50.3	50.6	54,622
中国電力	17.2	19.8	25,581
北陸電力	12.4	13.4	9,540
東北電力	29.5	33.9	30,849
四国電力	11.4	12.4	9,039
九州電力	25.8	28.7	29,417
北海道電力	12.2	13.7	5,849
沖縄電力	2.3	3.1	4,395
電源開発	9.9	10.8	19,170
レノバ	—	2	8,940
東京瓦斯	24.4	25.6	60,313
大阪瓦斯	24.3	25.8	50,851
東邦瓦斯	6	6.5	40,885
北海道瓦斯	3.5	3.2	4,992
西部瓦斯	2.3	2.3	6,957

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡ガス	5.9	5.6	5,583
陸運業 (3.3%)			
東武鉄道	13.2	13.9	40,907
相鉄ホールディングス	4.2	4.4	10,784
東急	32.8	33.7	42,697
京浜急行電鉄	16.4	17.7	28,674
小田急電鉄	19.2	19.8	63,459
京王電鉄	6.5	6.8	55,692
京成電鉄	8.9	9.4	32,571
富士急行	1.8	2.1	10,426
東日本旅客鉄道	22.2	23.3	159,372
西日本旅客鉄道	11.3	11.8	63,602
東海旅客鉄道	10.5	10.9	160,775
西武ホールディングス	16.5	18.1	17,900
西日本鉄道	3.2	3.2	9,372
近鉄グループホールディングス	11.9	12.6	56,385
阪急阪神ホールディングス	15.9	16.8	56,532
南海電気鉄道	5.1	5.6	14,207
京阪ホールディングス	5.3	5.6	27,636
名古屋鉄道	9.8	10.6	28,206
日本通運	4.6	4.5	32,760
ヤマトホールディングス	20.7	21.3	55,720
山九	3.4	3.4	13,447
丸運	16.7	12.5	3,175
センコーグループホールディングス	7.2	8.3	8,250
トナミホールディングス	0.8	0.7	3,794
ニッコンホールディングス	4.3	4.5	9,486
日本石油輸送	1.1	0.7	1,856
福山通運	1.5	1.5	6,120
セイノーホールディングス	8.8	9.6	13,344
日立物流	2.6	2.5	7,812
C&Fロジホールディングス	4	4	8,476
九州旅客鉄道	10.5	11.4	24,361
S Gホールディングス	11.9	26.4	73,260
海運業 (0.2%)			
日本郵船	10	10.9	28,176
商船三井	6.9	7.4	22,037
川崎汽船	4.6	4.8	9,460

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
飯野海運	11.7	15.2	6,551
空運業 (0.3%)			
日本航空	21.8	26.1	49,329
A N Aホールディングス	21.8	31.3	69,892
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	3.9	4	12,400
三井倉庫ホールディングス	2.3	2.3	5,267
住友倉庫	4.2	4.7	6,053
東陽倉庫	15.4	13.8	4,402
安田倉庫	5.8	4.9	4,669
上組	7.3	7.3	13,585
キムラユニティ	3.9	3.5	3,787
キューソー流通システム	1.8	1.8	2,817
近鉄エクスプレス	3.7	3.3	8,652
エーアイテイ	5.1	4.4	4,356
情報・通信業 (9.1%)			
N E C ネットエスアイ	2.6	4.1	7,859
システナ	4.7	5	10,190
デジタルアーツ	0.7	0.9	9,333
日鉄ソリューションズ	1.6	1.7	5,499
T I S	4.1	13.2	28,934
J N Sホールディングス	0.6	3.9	2,223
電算システム	0.9	1.2	3,924
グリー	9.2	10.4	6,167
コーエーテクモホールディングス	3	2.9	17,429
ブレインパッド	0.3	1.3	5,525
K L a b	3.1	4.6	4,236
ネクソン	34.9	32.8	107,092
エイチーム	0.9	5.9	6,985
コロブラ	4.4	6.7	6,231
サイバーリンクス	2.8	1.2	2,637
C A R T A H O L D I N G S	0.3	4.3	5,882
S H I F T	—	0.5	6,550
ティーガイア	2.2	2	3,836
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3	3.8	9,853
G M O ペイメントゲートウェイ	1.9	2.7	42,228
ザッパラス	11	6.8	3,379
インターネットイニシアティブ	2.4	4.1	9,167

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
L I N E	3.7	—	—
チェンジ	—	1.7	6,409
フェイス	3	3	2,436
野村総合研究所	20.9	18.5	70,392
C Eホールディングス	3.8	6.8	4,386
インテージホールディングス	5.5	4.5	5,188
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.8	2.8	5,502
フジ・メディア・ホールディングス	13	13.5	15,808
オービック	4.3	4.5	94,185
ジャストシステム	2.1	2	15,780
Zホールディングス	172	178.2	122,975
トレンドマイクロ	5.4	6.9	39,054
日本オラクル	2.4	2.6	34,242
フューチャー	4.4	3.9	7,082
C A C H o l d i n g s	3.6	5.9	8,206
S Bテクノロジー	2	1.8	6,282
オービックビジネスコンサルタント	1.2	1	6,910
伊藤忠テクノソリューションズ	5.5	5.7	21,232
大塚商会	6.6	7	37,100
サイボウズ	1.1	1.7	4,703
電通国際情報サービス	2.5	1.7	6,715
デジタルガレージ	2.3	2.2	8,305
ウェザーニューズ	1.4	0.7	3,619
日本エンタープライズ	0.1	4.8	1,123
ネットワンシステムズ	4.3	4.6	17,549
アルゴグラフィックス	2.6	1.5	4,642
エイベックス	4	4.2	5,548
日本ユニシス	3.8	3.9	15,658
兼松エレクトロニクス	1.5	1.7	6,825
T B Sホールディングス	8	8.4	16,170
日本テレビホールディングス	11.5	11.8	13,605
テレビ朝日ホールディングス	3.2	3.5	6,576
スカパー J S A Tホールディングス	9.9	13.5	6,412
テレビ東京ホールディングス	1	2.4	5,592
日本電信電話	165.4	173.6	475,664
K D D I	92.2	94.7	308,722
ソフトバンク	112.1	118.2	158,801
光通信	1.3	1.3	28,886

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
N T T ドコモ	91.4	—	—
G M Oインターネット	4.8	4.9	15,214
K A D O K A W A	3.8	3.8	13,262
ゼンリン	2.7	3.4	4,032
松竹	0.7	0.9	12,816
東宝	7.5	7.8	30,810
東映	0.5	0.2	3,498
エヌ・ティ・ティ・データ	32.7	34.8	52,548
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	2.4	3,847
D T S	2.9	3.1	6,503
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5.7	5.5	32,450
カプコン	5.3	6	43,200
S C S K	3.3	3.2	17,792
アイネス	6.1	5.7	8,116
T K C	2.1	0.9	6,471
富士ソフト	1.9	1.7	8,857
N S D	3.8	4.4	8,984
コナミホールディングス	5.1	5	33,100
ソフトバンクグループ	97.7	103	892,392
卸売業 (4.7%)			
伊藤忠食品	1	0.7	3,689
エレマテック	4.8	4.8	4,809
J A L U X	2	2	2,800
双日	69.7	73	18,104
アルフレッサ ホールディングス	13.6	14.7	29,649
横浜冷凍	5.8	6.1	5,331
神戸物産	4.2	8.8	26,708
あい ホールディングス	3.2	2.6	5,309
ダイワボウホールディングス	1	0.8	7,112
マクニカ・富士エレホールディングス	3.9	3.5	7,612
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3.9	6.9	5,499
レスターホールディングス	2.6	2.3	4,968
O C H I ホールディングス	3.1	3.1	4,070
T O K A I ホールディングス	6.9	7.5	7,320
シップヘルスケアホールディングス	2.6	2.3	14,053
明治電機工業	2.8	2.8	4,396
コメダホールディングス	2.8	3.1	5,862
エコートレーディング	8	7.4	4,847

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナガイレーベン	1.8	3	9,060
三菱食品	2.2	2.2	6,272
松田産業	3.6	3.7	7,004
第一興商	1.8	1.7	5,967
メディバルホールディングス	13.3	14.6	29,798
アズワン	0.8	0.8	13,184
尾家産業	3.2	3.2	4,073
ドウシシャ	3.2	2.9	5,727
丸文	6.3	5.1	2,810
橋本総業ホールディングス	2.7	2.3	5,950
日本ライフライン	3.7	3.7	5,672
進和	2.5	2	4,236
オーハシテクニカ	3.1	2.3	3,247
白銅	2.4	2.4	3,410
伊藤忠商事	86.1	91.2	285,456
丸紅	128.9	135.1	97,069
長瀬産業	7.2	7.7	12,073
豊田通商	13.7	14.6	62,488
兼松	5.1	5.6	7,504
三井物産	109.3	112.6	229,366
日本紙パルプ商事	1.2	0.9	3,163
日立ハイテク	3.7	—	—
山善	5.4	5.3	5,315
住友商事	78.2	82.6	118,861
内田洋行	1.1	0.8	3,308
三菱商事	86.7	85.6	231,762
キャノンマーケティングジャパン	3.1	3.1	7,514
西華産業	3.9	3.5	4,749
菱洋エレクトロ	3.2	1.9	6,498
東京産業	2.4	4.7	2,885
阪和興業	2	3.8	10,586
岩谷産業	2.7	2.8	19,516
イワキ	0.3	9.2	6,329
三菱石油	5.8	5.3	5,962
稲畑産業	3.9	4.1	6,072
ワキタ	5.5	3.6	3,510
東邦ホールディングス	3.4	3.6	7,052
サンゲツ	3.9	3.8	5,931

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シナネンホールディングス	2.8	1.4	4,228
伊藤忠エネクス	5.7	5.3	5,496
サンリオ	3.7	4	6,216
リョーサン	2	1.8	3,751
三信電気	2.3	1.1	2,071
モスフードサービス	2.2	2.2	6,743
加賀電子	2.9	2.5	5,847
立花エレクトック	3.3	2.5	3,997
フォーバル	5.5	4.6	3,634
PALTAC	2.1	2	11,140
日鉄物産	1.3	1.1	4,015
トラスコ中山	2.5	2.7	7,138
オートバックスセブン	4.6	5.1	7,236
加藤産業	1.8	1.6	5,560
イノテック	5	4.3	5,654
杉本商事	2.9	2.4	5,524
因幡電機産業	3.4	3.5	8,690
ミスミグループ本社	15.4	16.4	52,644
スズケン	5.6	5.8	22,939
ジェコス	5.3	5.3	5,088
小売業 (4.8%)			
ローソン	3	3	14,550
サンエー	1.1	1.9	7,761
エービーシー・マート	2	1.8	10,656
ハードオフコーポレーション	4.5	4.2	3,225
アスクル	2.4	1.8	6,759
ゲオホールディングス	2.9	4.9	5,880
アダストリア	1.9	2.1	3,987
ジーフット	5.2	2.8	1,164
エディオン	5.3	5.6	5,717
あみやき亭	1.6	1.1	3,141
ハニーズホールディングス	0.2	5.6	5,588
ジズホールディングス	0.9	0.2	1,370
ビックカメラ	6.8	7.4	8,413
DCMホールディングス	6.6	7.1	7,682
MonotaRO	8.4	9.4	49,162
J. フロント リテイリング	15.9	17.4	15,016
ドトール・日レスホールディングス	2.9	2.4	3,748

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マツモトキヨシホールディングス	5.1	5.3	22,710
ZOZO	8.9	9.6	29,232
トレジャー・ファクトリー	0.1	2.1	1,533
ココカラファイン	1.2	1	7,040
三越伊勢丹ホールディングス	23.2	24.3	14,993
ウエルシアホールディングス	3.2	7.9	28,637
クリエイトSDホールディングス	1.9	2	6,860
シュッピン	4.1	3.6	3,358
ジョイフル本田	3.6	3.8	5,418
すかいらーくホールディングス	13.7	15.3	25,352
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3.9	4.3	4,833
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.7	5	4,385
あさひ	2.6	3.3	5,441
コスモス薬品	0.6	1.2	19,500
トーエル	3.6	2.9	2,409
セブン&アイ・ホールディングス	48.5	51	204,255
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3.5	8.4	6,098
ツルハホールディングス	2.7	2.8	39,396
サンマルクホールディングス	2.3	2.8	4,174
トリドールホールディングス	2	4.8	7,137
クスリのアオキホールディングス	1.2	0.9	7,695
スシローグローバルホールディングス	1.2	7	27,090
ノジマ	—	2.2	6,342
カップ・クリエイト	4.8	4.1	6,158
ライトオン	0.2	5.2	3,140
良品計画	16.8	17.4	41,881
三城ホールディングス	9	7.5	2,377
アドヴァン	3.9	3.7	4,247
G-7ホールディングス	3.2	3.9	9,878
コーナン商事	—	2.6	7,529
エコス	2.1	1.4	2,675
マルシェ	5.3	3.8	1,877
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	29.6	28.9	65,834
西松屋チェーン	4.2	4.4	6,199
ゼンショーホールディングス	5.7	6.4	18,508
サイゼリヤ	3.4	3.2	6,617
魚力	2.9	2.9	5,391
ユナイテッドアローズ	1.5	2.9	4,445

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハイデイ日高	2.5	2.4	4,092
京都きもの友禅	4.9	3.5	738
コロナイド	3.8	4.2	7,677
老番屋	1.3	1	5,160
スギホールディングス	2.6	2.6	18,928
薬王堂ホールディングス	1.4	1.9	4,951
スクロール	6.6	5.8	5,185
ファミリーマート	9.8	—	—
木曽路	2.7	2.4	5,752
千趣会	12.8	14.7	4,748
ケーヨー	11	7.8	5,904
上新電機	2	2.1	5,959
日本瓦斯	2	1.8	9,108
ロイヤルホールディングス	2.3	2.6	4,726
いなげや	3.6	2	3,514
島忠	2.5	2.4	13,152
チヨダ	1.9	4	3,564
ライフコーポレーション	1.6	1.4	4,592
AOKIホールディングス	2.5	7.5	4,027
コメリ	2	2.2	6,476
青山商事	2.2	7	4,312
しまむら	1.3	1.5	17,400
高島屋	9.6	10.3	9,651
松屋	3.5	5.1	4,222
エイチ・ツー・オー リテイリング	6	7.5	5,287
パルコ	4.5	—	—
丸井グループ	10.1	12.1	21,598
アクシアル リテイリング	0.8	1.1	5,621
イオン	47.7	50.2	168,722
イズミ	2.3	2.3	8,636
平和堂	3.1	2.9	6,295
フジ	2.3	2.4	4,790
ヤオコー	1.3	1.2	8,052
ゼビオホールディングス	4.2	4.2	3,616
ケーズホールディングス	12.3	13.5	19,413
Genky DrugStores	1.4	1.2	4,794
ブックオフグループホールディングス	1.7	2.7	2,273
アインホールディングス	1.8	1.5	9,765

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマダホールディングス	37.5	41.7	22,476
ニトリホールディングス	5.4	5.6	121,716
吉野家ホールディングス	4.2	4.6	9,830
王将フードサービス	0.9	1.8	10,458
ブレナス	3.2	2.9	5,655
ミニストップ	2.6	3.1	4,398
アークス	2.2	3.1	7,151
パローホールディングス	2.4	2.5	6,175
ファーストリテイリング	1.7	1.7	159,800
サンドラッグ	4.4	4.4	17,820
ヤマザワ	2.4	2.4	4,173
ペルーナ	4.9	4.9	5,796
銀行業 (4.7%)			
めぶきフィナンシャルグループ	64.7	75.4	15,834
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.6	3.8	4,237
九州フィナンシャルグループ	19.7	26.5	11,236
ゆうちょ銀行	34.9	37.6	33,802
コンコルディア・フィナンシャルグループ	76.9	78.9	31,007
西日本フィナンシャルホールディングス	7.3	8.6	5,615
関西みらいフィナンシャルグループ	5.2	12.6	6,514
三十三フィナンシャルグループ	2.1	3.8	4,799
第四北越フィナンシャルグループ	2.1	2.8	6,246
ひろぎんホールディングス	—	19.9	12,377
新生銀行	9	9.7	12,891
あおぞら銀行	6.6	7.4	14,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	846.3	894.1	429,168
りそなホールディングス	134.5	145.2	54,101
三井住友トラスト・ホールディングス	23.7	24.7	78,299
三井住友フィナンシャルグループ	86.9	90.3	299,434
千葉銀行	41.5	43.6	25,506
群馬銀行	25.5	28.1	9,132
武蔵野銀行	2.8	4.5	6,961
千葉興業銀行	11.6	—	—
七十七銀行	3.3	3.9	5,358
青森銀行	0.5	1.6	3,881
秋田銀行	1.3	2.8	3,889
山形銀行	1.8	5.7	5,768
岩手銀行	1.1	2.1	4,097

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦銀行	12.2	12.3	2,496
東北銀行	0.9	2.1	2,297
ふくおかフィナンシャルグループ	10.6	11.5	22,103
静岡銀行	30.9	31.2	24,148
十六銀行	2.8	2.1	3,950
スルガ銀行	12.7	14.2	4,501
八十二銀行	27.6	30.9	10,444
山梨中央銀行	1.9	3	2,385
大垣共立銀行	2.5	2.7	5,427
福井銀行	2.1	2.1	4,004
北國銀行	2.3	2	5,016
滋賀銀行	2.4	3.4	6,677
南都銀行	1.6	2.5	4,255
百五銀行	13	17.4	5,046
京都銀行	4.3	4.5	25,380
紀陽銀行	4.1	4.4	6,036
ほくほくフィナンシャルグループ	7.8	8.4	7,988
広島銀行	18	—	—
山陰合同銀行	6.3	9.5	4,655
中国銀行	9.8	10.7	8,795
鳥取銀行	0.9	1.6	1,785
伊予銀行	16.1	18.1	11,113
百十四銀行	2.2	2.1	3,114
四国銀行	2.7	5.7	3,796
阿波銀行	1.8	2	4,430
大分銀行	0.6	3	6,120
宮崎銀行	1.1	2.1	4,659
佐賀銀行	2.4	2.4	3,153
沖縄銀行	1.4	2.2	5,940
琉球銀行	3.2	4.2	3,108
セブン銀行	42.7	47.7	10,971
みずほフィナンシャルグループ	1,683.8	177.6	247,308
山口フィナンシャルグループ	15.2	16.7	10,170
長野銀行	0.9	1.9	2,367
名古屋銀行	1.2	4.1	11,098
北洋銀行	19	19.7	4,176
中京銀行	1.8	1.8	3,450
愛媛銀行	3	4.8	4,660

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トマト銀行	1.7	2.2	2,250
京葉銀行	6.4	7.5	3,052
栃木銀行	11.7	19.3	3,319
トモニホールディングス	10.3	14.1	4,314
フィデアホールディングス	20.8	22	2,376
池田泉州ホールディングス	9.5	24	3,624
証券・商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	5.7	7.4	3,685
S B I ホールディングス	14.1	14.9	40,230
ジャフコ グループ	1.8	1.8	9,810
大和証券グループ本社	98.2	106.8	53,303
野村ホールディングス	215.7	230.2	129,602
岡三証券グループ	11	12	4,848
丸三証券	5.1	7.3	3,825
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11.9	19.2	6,201
水戸証券	9.6	12.3	3,296
いちよし証券	4	6.9	3,491
松井証券	5.8	7.3	5,986
だいこう証券ビジネス	7.5	—	—
マネックスグループ	7.9	13.3	6,862
極東証券	3.6	5.6	4,272
藍澤證券	4.9	5.8	4,680
保険業 (1.9%)			
かんぽ生命保険	4.5	5.1	11,316
S O M P O ホールディングス	23.4	24.6	103,885
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	32.5	34.1	106,119
ソニーフィナンシャルホールディングス	10	—	—
第一生命ホールディングス	69.9	74.1	121,227
東京海上ホールディングス	44.5	46.2	249,895
T & D ホールディングス	38.1	39.3	49,242
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	3.3	3.4	15,351
クレディセゾン	8.3	9	10,962
芙蓉総合リース	1.4	1.2	8,664
みずほリース	2.2	2.1	6,835
東京センチュリー	2.5	2.5	23,050
日本証券金融	7.5	9.2	4,784
アイフル	21	20.2	5,353

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リコーリース	1.5	1.3	4,056
イオンフィナンシャルサービス	8.1	8.6	11,171
アコム	25.6	28.4	13,262
オリエントコーポレーション	31.5	37.4	4,562
日立キャピタル	2.8	3.1	8,242
オリックス	77.6	79.3	137,744
三菱UFJリース	27.8	32.1	17,013
日本取引所グループ	37.2	37.6	99,884
アサックス	7.2	5.5	4,020
NECキャピタルソリューション	1.5	2	3,946
不動産業 (1.8%)			
いちご	18.3	18.6	5,282
ヒューリック	26.2	29.2	33,054
野村不動産ホールディングス	8.2	8.3	18,467
ユニゾホールディングス	1.6	—	—
オープンハウス	3.3	3.5	14,717
東急不動産ホールディングス	32.4	36.1	20,504
飯田グループホールディングス	10.1	11	26,103
パーク24	7.1	7.6	14,934
三井不動産	62	63.5	130,460
三菱地所	86.2	91.8	151,056
平和不動産	2.8	2.8	10,332
東京建物	13.8	13	18,876
ダイビル	5.5	5.4	6,561
京阪神ビルディング	5.7	2.8	4,723
住友不動産	27.9	29.5	91,125
テアオーシー	8.4	6.2	4,488
スターツコーポレーション	1.9	1.9	5,173
空港施設	7.2	5.5	2,634
ワールドクレスト	3.4	3.4	5,735
エスリード	3.5	2	3,050
A V A N T I A	5	4.3	3,710
イオンモール	6.4	6.8	11,648
カチタス	1.7	3.5	11,795
日本空港ビルデング	3.9	4.2	23,940
サービス業 (5.6%)			
ミクシィ	—	2.5	6,307
日本M&Aセンター	9	9.7	57,618

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
U Tグループ	—	2.2	7,293
バソナグループ	3.3	2.3	4,468
G C A	4.4	7.3	5,139
エス・エム・エス	4.3	4.2	17,451
パーソルホールディングス	12.1	13.3	26,134
クックパッド	11.7	13.3	4,149
学情	0.9	2.6	3,484
スタジオアリス	1.7	1.8	3,641
シミックホールディングス	1.7	3.7	5,598
N J S	2.5	2.5	4,995
総合警備保障	4.7	5	26,150
カカクコム	8.9	9.7	28,721
アイロムグループ	1.5	2	3,690
ディップ	3.9	2.9	7,467
キャリアデザインセンター	2.5	2.5	2,280
ベネフィット・ワン	3.1	3.9	12,363
エムスリー	26.1	27.8	293,707
アウトソーシング	6.5	4.5	6,034
ディー・エヌ・エー	6.2	6	11,736
博報堂D Yホールディングス	16.7	18.4	27,084
ぐるなび	0.2	5.3	2,893
ファンコミュニケーションズ	10.7	10.5	4,294
W D Bホールディングス	2.3	3.1	8,174
インフォマート	12.2	13.6	12,648
E P Sホールディングス	3	4.6	4,710
クイック	1.7	3.7	4,118
ケネディクス	11.4	—	—
電通グループ	12.3	14.3	45,188
H. U. グループホールディングス	3.3	3.3	10,428
ダイオーズ	3.8	3.4	3,247
日本空調サービス	7.6	7.1	5,225
オリエンタルランド	12.9	13.6	220,728
ダスキン	3	3.2	9,030
ラウンドワン	4	5.6	4,905
リゾートトラスト	4.8	5.4	8,083
ビー・エム・エル	2	1.9	6,973
りらいあコミュニケーションズ	5.2	4.8	6,729
リソー教育	7.6	13.4	4,033

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
早稲田アカデミー	5	2.6	2,576
ユー・エス・エス	14.8	14.5	30,450
サイバーエージェント	6.8	7.8	59,202
楽天	55.7	60	58,200
テー・オー・ダブリュー	6.7	6.3	1,732
エン・ジャパン	1.8	1.6	5,032
テクノプロ・ホールディングス	2.4	2.5	21,100
インターワークス	4	4.8	1,756
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.2	3,826
ジャパンマテリアル	3.6	3.5	5,586
キャリアリンク	0.1	1.6	4,118
ライドオンエクスプレスホールディングス	2.8	1.3	2,770
リクルートホールディングス	86	90.5	422,906
エラン	0.4	2.2	3,656
日本郵政	97.4	102.5	85,669
ペイカレント・コンサルティング	—	0.5	9,280
M S - J a p a n	0.9	1.6	1,849
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	—	2.6	6,835
リログループ	6.7	7.2	18,295
エイチ・アイ・エス	2	2.5	4,347
共立メンテナンス	1.8	1.6	5,432
建設技術研究所	3.5	3.6	9,072
よみうりランド	1	—	—
東京都競馬	1.5	1.4	6,244
カナモト	2	2.6	5,922
東京ドーム	6.4	—	—
トランス・コスモス	3.4	1.7	4,505
乃村工藝社	5.7	6.2	4,997
日本管財	1.7	3.3	6,639
白洋舎	1.5	1.1	2,645
セコム	12.8	13.4	126,898
セントラル警備保障	0.9	1.8	6,210
メイテック	1.5	1.3	6,799
応用地質	5.1	4.7	6,105
船井総研ホールディングス	2.3	2.6	5,980
ベネッセホールディングス	4.2	4.5	9,180
イオンディライト	1.5	2.6	7,087
ニチイ学館	4.9	—	—

銘柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
ダイセキ		2	2	6,460
ステップ		3	3	4,620
合 計	株 数 ・ 金 額	14,735	14,032	34,094,932
	銘柄数＜比率＞	1,085	1,077	<92.7%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	T O P I X	百万円	百万円
			2,694	－

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

下記は、TMA日本債券インデックスマザーファンド全体(14,840,406千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	15,985,000	16,876,678	87.8	—	57.5	19.6	10.7
地方債証券	920,000	940,470	4.9	—	2.3	2.1	0.5
	(920,000)	(940,470)	(4.9)	(—)	(2.3)	(2.1)	(0.5)
特殊債券	400,000	404,464	2.1	—	0.5	0.5	1.0
(除く金融債)	(400,000)	(404,464)	(2.1)	(—)	(0.5)	(0.5)	(1.0)
普通社債券	885,595	948,955	4.9	—	3.4	1.6	—
(含む投資法人債券)	(885,595)	(948,955)	(4.9)	(—)	(3.4)	(1.6)	(—)
合 計	18,190,595	19,170,568	99.8	—	63.6	23.9	12.3
	(2,205,595)	(2,293,890)	(11.9)	(—)	(6.1)	(4.2)	(1.6)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

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

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利率	当期末			銘柄	利率	当期末		
		額面金額	評価額	償還年月日			額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第406回利付国債 (2年)	0.1	10,000	10,017	2021/11/1	第355回利付国債 (10年)	0.1	137,000	138,615	2029/6/20
第413回利付国債 (2年)	0.1	65,000	65,209	2022/6/1	第356回利付国債 (10年)	0.1	190,000	192,141	2029/9/20
第414回利付国債 (2年)	0.1	110,000	110,377	2022/7/1	第357回利付国債 (10年)	0.1	186,000	187,904	2029/12/20
第415回利付国債 (2年)	0.1	75,000	75,267	2022/8/1	第358回利付国債 (10年)	0.1	65,000	65,624	2030/3/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	30,000	30,042	2021/9/20	第359回利付国債 (10年)	0.1	271,000	273,417	2030/6/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	110,000	110,216	2021/12/20	第360回利付国債 (10年)	0.1	185,000	186,424	2030/9/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	400,000	401,052	2022/3/20	第2回利付国債 (30年)	2.4	24,000	29,249	2030/2/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	120,000	120,393	2022/6/20	第3回利付国債 (30年)	2.3	20,000	24,283	2030/5/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	440,000	441,707	2022/9/20	第5回利付国債 (30年)	2.2	10,000	12,205	2031/5/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	250,000	251,117	2022/12/20	第22回利付国債 (30年)	2.5	10,000	13,312	2036/3/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	350,000	351,729	2023/3/20	第26回利付国債 (30年)	2.4	8,000	10,628	2037/3/20
第136回利付国債 (5年)	0.1	300,000	301,695	2023/6/20	第27回利付国債 (30年)	2.5	8,000	10,808	2037/9/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	250,000	251,560	2023/9/20	第28回利付国債 (30年)	2.5	20,000	27,130	2038/3/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	270,000	271,844	2023/12/20	第29回利付国債 (30年)	2.4	60,000	80,713	2038/9/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	230,000	231,706	2024/3/20	第31回利付国債 (30年)	2.2	72,000	94,986	2039/9/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	255,000	257,045	2024/6/20	第32回利付国債 (30年)	2.3	65,000	87,350	2040/3/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	250,000	252,152	2024/9/20	第33回利付国債 (30年)	2.0	38,000	49,120	2040/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	210,000	211,934	2024/12/20	第34回利付国債 (30年)	2.2	60,000	80,134	2041/3/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	150,000	151,468	2025/3/20	第35回利付国債 (30年)	2.0	40,000	52,058	2041/9/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	270,000	272,805	2025/6/20	第36回利付国債 (30年)	2.0	87,000	113,584	2042/3/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	90,000	90,967	2025/9/20	第37回利付国債 (30年)	1.9	90,000	116,087	2042/9/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	8,000	11,354	2051/3/20	第38回利付国債 (30年)	1.8	43,000	54,689	2043/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	63,000	86,599	2052/3/20	第39回利付国債 (30年)	1.9	30,000	38,811	2043/6/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	8,000	10,846	2053/3/20	第40回利付国債 (30年)	1.8	25,000	31,838	2043/9/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	45,000	58,766	2054/3/20	第42回利付国債 (30年)	1.7	114,000	143,120	2044/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	36,000	43,974	2055/3/20	第43回利付国債 (30年)	1.7	3,000	3,769	2044/6/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	86,000	78,611	2056/3/20	第44回利付国債 (30年)	1.7	21,000	26,413	2044/9/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	64,000	68,582	2057/3/20	第45回利付国債 (30年)	1.5	26,000	31,584	2044/12/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	73,000	75,935	2058/3/20	第46回利付国債 (30年)	1.5	93,000	113,035	2045/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	58,000	54,507	2059/3/20	第47回利付国債 (30年)	1.6	51,000	63,198	2045/6/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	46,000	43,172	2060/3/20	第48回利付国債 (30年)	1.4	83,000	99,066	2045/9/20
第320回利付国債 (10年)	1.0	50,000	50,503	2021/12/20	第49回利付国債 (30年)	1.4	30,000	35,819	2045/12/20
第324回利付国債 (10年)	0.8	50,000	50,650	2022/6/20	第50回利付国債 (30年)	0.8	35,000	36,892	2046/3/20
第327回利付国債 (10年)	0.8	205,000	208,628	2022/12/20	第51回利付国債 (30年)	0.3	54,000	50,485	2046/6/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	25,000	25,559	2023/6/20	第52回利付国債 (30年)	0.5	90,000	88,293	2046/9/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	103,000	105,531	2023/9/20	第53回利付国債 (30年)	0.6	65,000	65,219	2046/12/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	30,000	30,637	2023/12/20	第54回利付国債 (30年)	0.8	35,000	36,747	2047/3/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	30,000	30,747	2024/6/20	第55回利付国債 (30年)	0.8	55,000	57,703	2047/6/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	100,000	102,310	2024/9/20	第56回利付国債 (30年)	0.8	38,000	39,837	2047/9/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	90,000	92,129	2025/6/20	第57回利付国債 (30年)	0.8	52,000	54,471	2047/12/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	110,000	112,726	2025/9/20	第58回利付国債 (30年)	0.8	80,000	83,734	2048/3/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	165,000	168,455	2025/12/20	第59回利付国債 (30年)	0.7	40,000	40,844	2048/6/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	220,000	222,503	2026/3/20	第60回利付国債 (30年)	0.9	9,000	9,628	2048/9/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,151	2026/6/20	第61回利付国債 (30年)	0.7	30,000	30,534	2048/12/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,199	2026/9/20	第62回利付国債 (30年)	0.5	97,000	93,648	2049/3/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	235,000	237,928	2026/12/20	第63回利付国債 (30年)	0.4	50,000	46,891	2049/6/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	195,000	197,470	2027/3/20	第64回利付国債 (30年)	0.4	80,000	74,897	2049/9/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	210,000	212,702	2027/6/20	第65回利付国債 (30年)	0.4	59,000	55,143	2049/12/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	210,000	212,738	2027/9/20	第66回利付国債 (30年)	0.4	62,000	57,917	2050/3/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	385,000	390,074	2027/12/20	第67回利付国債 (30年)	0.6	48,000	47,349	2050/6/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	165,000	167,133	2028/3/20	第68回利付国債 (30年)	0.6	60,000	59,107	2050/9/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	80,000	81,040	2028/6/20	第51回利付国債 (20年)	2.0	90,000	90,761	2021/6/21
第352回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,282	2028/9/20	第53回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,400	2021/12/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	202,000	204,563	2028/12/20	第60回利付国債 (20年)	1.4	20,000	20,582	2022/12/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	215,000	217,635	2029/3/20	第62回利付国債 (20年)	0.8	21,000	21,469	2023/6/20

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第66回利付国債 (20年)	1.8	60,000	63,360	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	30,000	31,923	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	40,000	43,453	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	60,000	64,770	2024/6/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	40,000	43,495	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	30,000	32,781	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	10,000	10,843	2025/3/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	40,000	43,934	2025/6/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	30,000	33,121	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	5,000	5,546	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	60,000	66,267	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	20,000	22,292	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	20,000	22,623	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	10,000	11,257	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	65,000	73,535	2026/9/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	6,000	6,927	2027/6/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,032	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	20,000	23,268	2028/3/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,319	2028/9/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	7,000	8,262	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,694	2029/9/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	50,000	60,087	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	92,000	109,718	2030/3/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	113,000	136,018	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	40,000	47,753	2030/12/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	31,000	37,120	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	59,366	2031/3/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	55,000	65,091	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	64,000	75,242	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	90,000	106,782	2031/12/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	90,000	106,047	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	77,000	89,879	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	12,000	14,171	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	25,000	28,960	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	50,000	58,484	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	72,000	85,216	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	50,000	59,302	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	10,000	11,977	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	60,000	70,587	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	75,000	87,336	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	105,000	125,036	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	90,000	107,383	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	82,000	96,983	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	95,000	111,317	2034/3/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	123,000	142,895	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	100,000	113,522	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	91,000	103,375	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	112,000	128,879	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	92,000	104,646	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	115,000	127,479	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	99,000	100,945	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	100,000	98,819	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	119,000	122,831	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	92,000	96,260	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	90,000	95,470	2037/3/20

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第161回利付国債 (20年)	0.6	93,000	97,131	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	105,000	109,560	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	48,000	50,034	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	80,000	81,940	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	90,000	92,062	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	80,000	84,443	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	48,000	48,965	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	68,000	68,057	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	104,000	102,042	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	65,000	63,650	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	43,000	42,059	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	79,000	78,580	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	81,000	80,492	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	85,000	84,308	2040/9/20
小 計		15,985,000	16,876,678	
地方債証券				
第781回東京都公募公債	0.16	100,000	100,588	2028/6/20
平成30年度第11回北海道公募公債 (5年)	0.03	100,000	100,012	2023/9/28
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	20,000	23,136	2034/6/20
第6回大阪府公募公債 (20年)	1.98	50,000	58,854	2039/9/13
平成28年度第2回京都府公募公債 (15年)	0.21	50,000	50,251	2031/4/22
平成31年度第1回愛知県公募公債 (10年)	0.09	100,000	99,959	2029/4/26
平成29年度第7回広島県公募公債	0.2	100,000	100,853	2028/3/23
平成25年度第8回埼玉県公募公債	0.703	100,000	102,020	2023/12/25
平成27年度第3回福岡県公募公債	0.529	200,000	204,798	2025/8/25
平成29年度第1回広島市公募公債 (5年)	0.01	100,000	99,999	2022/6/24
小 計		920,000	940,470	
特殊債券(除く金融債)				
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	100,167	2021/2/26
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,805	2028/5/31
第42回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	101,487	2022/11/14
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	102,005	2024/3/15
小 計		400,000	404,464	
普通社債証券(含む投資法人債券)				
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	101,963	2025/3/25
第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.02	100,000	99,982	2024/6/20
第33回道路債証券	2.91	100,000	133,871	2034/6/20
第101回都市再生債券	0.935	100,000	106,965	2029/11/20
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	36,201	38,298	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	40,324	42,666	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	38,136	40,284	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	39,485	41,791	2047/4/10
第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	31,449	31,696	2039/2/10
第16回成田国際空港株式会社社債	0.57	100,000	101,930	2024/10/28
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	100,000	108,778	2026/12/22
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	100,729	2028/6/6
小 計		885,595	948,955	
合 計		18,190,595	19,170,568	

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

<TMA外国株式インデックスマザーファンド>

下記は、TMA外国株式インデックスマザーファンド全体(10,389,370千口)の内容です。

外国株式

銘柄	株数	期末(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	
AFLAC INC	22	32	150	15,620	保険
AT&T INC	262	434	1,255	130,380	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	63	114	1,294	134,456	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	55	113	1,255	130,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	2	4	146	15,245	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	29	52	497	51,704	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	2	—	—	—	資本財
ADOBE INC	17	31	1,471	152,816	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	3	5	95	9,947	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	39	77	722	74,991	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13	21	272	28,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7	13	374	38,931	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	7	13	150	15,582	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	4	9	164	17,045	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10	15	250	25,990	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	3	5	284	29,559	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	0.73	0.84	49	5,106	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	—	21	106	11,051	公益事業
ALLSTATE CORP	10	15	172	17,865	保険
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	10	185	19,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	11	18	3,591	372,898	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	10	19	3,618	375,752	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	66	110	462	48,014	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	15	26	8,849	918,933	小売
AMEREN CORPORATION	10	15	110	11,472	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	15	26	217	22,560	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	24	42	534	55,510	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3	7	65	6,836	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30	55	221	22,957	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6	12	204	21,186	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	8	14	153	15,945	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5	9	199	20,694	各種金融
AMETEK INC	7	10	122	12,673	資本財
AMGEN INC	22	36	923	95,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	10	16	218	22,739	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES	15	23	366	38,094	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	3	6	238	24,815	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	9	15	501	52,053	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	17	—	—	—	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	19	90	9,391	各種金融
APPLE INC	163	1,077	14,990	1,556,627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	33	62	666	69,206	半導体・半導体製造装置
AQUA AMERICA INC	8	—	—	—	公益事業
ARAMARK	13	26	92	9,621	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17	28	149	15,533	食品・飲料・タバコ

銘	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ARISTA NETWORKS INC		2	4	143	14,865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC		3	6	85	8,909	保険
ATMOS ENERGY CORP		5	11	100	10,463	公益事業
AUTODESK INC		9	15	458	47,561	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC		4	7	67	7,048	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING		16	26	432	44,943	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC		0.94	1	174	18,094	小売
AVERY DENNISON CORP		4	6	103	10,754	素材
BAKER HUGHES COMPANY		26	61	135	14,049	エネルギー
BALL CORP		13	22	204	21,285	素材
BANK OF AMERICA CORP		318	482	1,523	158,162	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		29	43	183	19,018	各種金融
BAXTER INTL INC		17	28	226	23,505	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO		10	18	473	49,169	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP		8	10	65	6,847	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		46	86	2,012	208,946	各種金融
BEST BUY COMPANY INC		9	17	202	21,016	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		8	16	143	14,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC		7	9	263	27,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC		—	14	122	12,759	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC		3	9	696	72,358	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		26	42	275	28,651	各種金融
BOEING CO		19	34	716	74,404	資本財
BOOKING HOLDINGS INC		1	2	541	56,214	小売
BORGWARNER INC		11	19	83	8,639	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP		52	83	307	31,965	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		85	146	947	98,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS		5	9	144	15,032	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC		14	26	1,227	127,431	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		11	18	132	13,743	食品・飲料・タバコ
CBOE GLOBAL MARKETS INC		5	8	80	8,323	各種金融
CBRE GROUP INC - A		14	24	158	16,460	不動産
CDK GLOBAL INC		5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE		6	10	138	14,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		11	19	85	8,860	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		6	9	93	9,668	運輸
CIGNA CORP		14	24	541	56,236	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC		12	21	393	40,820	各種金融
CMS ENERGY CORP		13	22	134	13,919	公益事業
CSX CORP		25	43	378	39,287	運輸
CVS HEALTH CORPORATION		48	83	618	64,243	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP		15	24	45	4,699	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC		—	20	279	29,038	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO		9	16	75	7,835	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		16	29	309	32,093	各種金融
CARDINAL HEALTH INC		15	25	139	14,534	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC		8	15	178	18,528	小売
CARNIVAL CORP		17	—	—	—	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP		—	60	239	24,829	資本財
CATERPILLAR INC		20	34	661	68,682	資本財
CELANESE CORP-SERIES A		5	10	137	14,313	素材
CENTENE CORP		18	38	238	24,737	ヘルスケア機器・サービス

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	
CENTERPOINT ENERGY INC		25	46	99	10,321	公益事業
CERNER CORP		10	14	119	12,403	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		6	9	629	65,339	メディア・娯楽
CHEVRONTXACO CORP		66	117	1,081	112,274	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A		1	2	300	31,186	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		10	19	164	17,071	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP		7	11	99	10,309	保険
CISCO SYSTEMS INC		149	256	1,146	119,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		2	5	192	19,980	商業・専門サービス
CITIGROUP INC		81	129	794	82,510	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP		16	34	134	13,928	銀行
CITRIX SYSTEMS INC		6	8	112	11,713	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY		4	8	170	17,692	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY		142	248	1,206	125,270	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP		9	15	130	13,509	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		19	33	273	28,391	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		26	47	368	38,241	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A		163	284	1,387	144,030	メディア・娯楽
COMERICA INC		7	—	—	—	銀行
CONAGRA BRANDS INC		20	36	124	12,948	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC		7	—	—	—	エネルギー
CONOCOPHILLIPS		38	84	359	37,378	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC		10	18	126	13,108	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A		6	10	234	24,387	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE		2	3	139	14,481	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC		9	15	175	18,253	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH		6	9	124	12,899	ソフトウェア・サービス
CORNING INC		25	46	173	17,987	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC		28	49	206	21,405	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		15	27	1,002	104,097	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC		1	2	253	26,331	商業・専門サービス
COUPA SOFTWARE INC		—	5	189	19,704	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A		—	11	255	26,575	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC		—	13	122	12,712	素材
CUMMINS INC		4	7	192	19,980	資本財
DR HORTON INC		14	25	200	20,810	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY		4	13	160	16,697	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO		15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP		23	42	1,005	104,384	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC		5	12	146	15,225	消費者サービス
DAVITA INC		6	8	102	10,592	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO		11	19	596	61,983	資本財
DENTSPLY SIRONA INC		11	21	120	12,491	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION		18	—	—	—	エネルギー
DEXCOM INC		4	7	259	26,980	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO		65	116	2,011	208,838	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		10	23	213	22,161	各種金融
DISCOVERY INC-A		11	23	89	9,296	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C		17	30	98	10,266	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION		13	20	64	6,692	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD		2	3	71	7,464	保険
DOCUSIGN INC		—	12	331	34,416	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
Dollar General Corp		9	16	334	34,753	小売
DOLLAR TREE INC		9	16	180	18,718	小売
DOMINION ENERGY INC		29	48	348	36,151	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC		2	3	119	12,402	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		—	49	258	26,883	半導体・半導体製造装置
DOVER CORP		6	9	120	12,479	資本財
DOW INC		26	48	279	29,000	素材
DUKE ENERGY CORP		23	43	392	40,803	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC		28	47	385	39,988	素材
EOG RESOURCES INC		20	33	183	19,009	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORP		12	—	—	—	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		2	4	65	6,777	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		7	—	—	—	消費者サービス
EAST WEST BANCORP INC		8	—	—	—	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY		6	12	133	13,853	素材
EBAY INC		28	45	259	26,927	小売
ECOLAB INC		8	14	311	32,332	素材
BUNGE LIMITED		6	15	103	10,742	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL		13	26	158	16,434	公益事業
Edwards Lifesciences Corp		7	39	341	35,494	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC		10	19	280	29,108	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO		19	32	275	28,604	資本財
ENTERGY CORP		8	14	140	14,578	公益事業
EPAM SYSTEMS INC		—	4	166	17,255	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC		5	9	161	16,760	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC		17	40	107	11,195	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC		—	21	99	10,361	公益事業
EVERGY INC		12	22	119	12,407	公益事業
EVERSOURCE ENERGY		10	21	186	19,396	公益事業
EXELON CORP		31	51	219	22,780	公益事業
EXPEDIA GROUP INC		7	11	156	16,231	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC		6	10	101	10,574	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION		149	255	1,213	125,989	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC		6	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A		87	152	4,194	435,542	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		1	2	90	9,410	各種金融
FASTENAL CO		18	31	151	15,762	資本財
FEDEX CORP		8	16	429	44,641	運輸
F5 NETWORKS INC		2	4	97	10,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES		23	39	510	53,051	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		12	17	68	7,150	保険
FIFTH THIRD BANCORP		23	50	157	16,319	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA		7	9	148	15,457	銀行
FISERV INC		22	37	398	41,418	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP		19	42	132	13,783	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		3	6	176	18,354	ソフトウェア・サービス
FLOWERVE CORP		8	—	—	—	資本財
FORD MOTOR CO		136	251	290	30,139	自動車・自動車部品
FORTINET INC		6	11	176	18,294	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP		9	17	124	12,906	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		7	13	123	12,794	資本財
FOX CORP-CLASS A		14	26	79	8,261	メディア・娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
FOX CORP-CLASS B		11	22	66	6,951	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC		11	23	62	6,464	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC		—	105	322	33,471	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO		8	14	166	17,302	保険
GARTNER INC		4	8	135	14,041	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC		—	5	164	17,123	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP		8	12	196	20,432	資本財
GENERAL ELECTRIC CO		321	572	636	66,077	資本財
GENERAL MILS INC		19	34	195	20,306	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO		43	83	464	48,213	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO		7	12	124	12,918	小売
GILEAD SCIENCES INC		49	76	509	52,939	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC		12	20	377	39,158	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC		5	6	59	6,191	保険
GODADDY INC - CLASS A		8	15	133	13,871	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		11	19	571	59,319	各種金融
WW GRAINGER INC		1	2	115	12,012	資本財
HCA HEALTHCARE INC		10	17	297	30,896	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC		7	—	—	—	資本財
HP INC		50	90	227	23,660	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO		28	67	130	13,525	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC		9	—	—	—	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		9	22	114	11,930	保険
HASBRO INC		5	9	95	9,950	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		3	5	84	8,746	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE		6	8	132	13,757	食品・飲料・タバコ
HESS CORP		12	25	151	15,682	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		48	100	121	12,612	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC		11	21	225	23,411	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP		9	—	—	—	エネルギー
HOME DEPOT INC		38	67	1,911	198,441	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		25	43	886	92,050	資本財
HORMEL FOODS CORP		12	21	98	10,218	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC		5	8	338	35,173	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		4	5	87	9,074	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC		49	99	137	14,298	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		2	2	46	4,874	資本財
IAC/INTERACTIVECORP		—	7	148	15,470	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP		3	—	—	—	メディア・娯楽
IDEX CORP		4	5	105	10,918	資本財
IDEXX LABORATORIES INC		3	6	308	32,037	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC		10	17	360	37,479	資本財
ILLUMINA INC		5	9	401	41,678	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP		9	16	156	16,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC		—	29	133	13,911	資本財
INGREDION INC		3	—	—	—	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP		158	263	1,492	155,032	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		19	32	364	37,875	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP		31	52	623	64,723	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		4	5	68	7,107	素材
INTERNATIONAL PAPER CO		13	26	137	14,239	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC		22	41	102	10,628	メディア・娯楽

銘柄	株数	期首(前期末)	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	
INTUIT INC	9	17	648	67,339	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	4	7	572	59,416	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	7	13	258	26,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	115	189	2,531	262,864	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6	11	124	12,979	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	19	—	—	—	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	93	163	2,681	278,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	16	19	48	5,072	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	6	11	351	36,454	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC	—	42	172	17,899	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	—	6	146	15,250	運輸
KELLOGG CO	10	16	94	9,813	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	—	47	149	15,512	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	44	77	140	14,574	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8	12	187	19,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	12	19	258	26,798	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	73	101	155	16,178	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	9	13	60	6,331	運輸
KOHL'S CORP	8	—	—	—	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	26	44	146	15,166	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	28	45	151	15,692	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	17	28	107	11,133	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8	13	246	25,613	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	—	7	170	17,660	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	5	10	570	59,194	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	—	12	95	9,957	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	15	27	148	15,466	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8	14	367	38,135	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	2	4	71	7,442	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	8	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	6	12	136	14,195	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	12	22	187	19,489	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	2	79	8,218	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	5	12	199	20,673	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	9	21	86	8,985	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	32	56	1,173	121,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	9	19	101	10,492	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	9	14	489	50,786	資本財
LOEWS CORP	12	19	92	9,626	保険
LOWE'S COMPANIES	28	49	853	88,650	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	4	8	295	30,643	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	3	6	92	9,588	銀行
MSCI INC	3	5	242	25,191	各種金融
MANPOWERGROUP	2	—	—	—	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	43	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	25	45	206	21,406	エネルギー
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	3	154	16,089	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	17	28	321	33,385	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	11	20	257	26,723	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2	4	136	14,145	素材
MASCO CORP	13	20	118	12,286	資本財
MASIMO CORP	—	4	126	13,087	ヘルスケア機器・サービス

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	
MASTERCARD INC-CLASS A		32	56	1,856	192,743	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC		—	18	261	27,130	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		11	20	193	20,133	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		4	18	166	17,276	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP		26	46	984	102,211	消費者サービス
MCKESSON CORP		7	11	203	21,171	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC		1	3	607	63,051	小売
MERCK & CO. INC.		93	157	1,275	132,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC		24	40	207	21,516	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC		1	1	222	23,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP		262	453	10,251	1,064,476	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		10	18	278	28,887	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC		42	74	610	63,396	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP		3	—	—	—	資本財
MODERNA INC		—	20	269	27,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC		3	4	67	7,045	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B		9	17	88	9,138	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC		48	82	463	48,106	食品・飲料・タバコ
MONSTER BEVERAGE CORP		14	23	204	21,193	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP		6	10	271	28,220	各種金融
MORGAN STANLEY		43	87	648	67,316	各種金融
MOSAIC CO/THE		23	41	116	12,102	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC		5	10	174	18,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC		—	16	67	7,025	公益事業
NVR INC		—	0.26	116	12,111	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC		—	9	137	14,231	各種金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		15	—	—	—	エネルギー
NETAPP INC		11	16	109	11,331	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC		16	28	1,605	166,671	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		—	9	113	11,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC		19	39	98	10,244	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION		28	56	349	36,247	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I		28	46	86	8,935	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC		17	125	1,060	110,161	公益事業
NIKE INC -CL B		44	79	1,104	114,690	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC		20	40	88	9,152	公益事業
NOBLE ENERGY INC		21	—	—	—	エネルギー
NORDSON CORP		—	5	96	10,007	資本財
NORDSTROM INC		6	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP		9	14	363	37,760	運輸
NORTHERN TRUST CORP		8	14	134	14,007	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		6	8	267	27,802	資本財
NORTONLIFELOCK INC		25	49	102	10,618	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP		13	23	127	13,287	素材
NVIDIA CORP		21	39	2,179	226,344	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP		12	17	55	5,786	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		2	4	209	21,796	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		31	—	—	—	エネルギー
OKTA INC		—	9	246	25,577	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC		3	7	150	15,595	運輸
ONEOK INC		16	33	142	14,835	エネルギー
ORACLE CORPORATION		83	124	751	78,027	ソフトウェア・サービス

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	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	22	144	15,003	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16	23	362	37,674	銀行
PPG INDUSTRIES INC	7	12	175	18,203	素材
PPL CORPORATION	25	48	134	13,964	公益事業
PVH CORP	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PACCAR INC	12	19	193	20,098	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	5	7	111	11,575	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	4	7	262	27,298	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	4	9	248	25,830	資本財
PAYCHEX INC	9	18	159	16,606	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	4	170	17,744	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	42	72	1,819	188,982	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	23	—	—	—	銀行
PEPSICO INC	48	84	1,166	121,173	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	—	10	153	15,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	196	358	1,311	136,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	55	95	771	80,100	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	15	24	178	18,494	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	6	8	68	7,084	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	—	35	258	26,878	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6	11	150	15,676	エネルギー
POLARIS INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	7	12	202	21,054	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12	23	126	13,156	保険
PROCTER & GAMBLE CO	89	154	2,009	208,711	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	19	36	332	34,565	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13	21	174	18,102	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15	28	165	17,192	公益事業
PULTE HOMES INC	14	23	114	11,854	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	44	73	1,191	123,760	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	6	9	124	12,898	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	9	83	8,696	素材
RALPH LAUREN CORP	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6	10	108	11,295	各種金融
RAYTHEON COMPANY	10	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	96	650	67,508	資本財
Regeneron Pharmaceuticals Inc	3	7	380	39,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	42	74	132	13,714	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	5	64	6,715	保険
REPUBLIC SERVICES INC	6	9	89	9,253	商業・専門サービス
RESMED INC	6	10	229	23,879	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	5	223	23,238	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	4	11	76	7,894	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	4	6	177	18,393	資本財
ROKU INC	—	7	337	35,083	メディア・娯楽
ROLLINS INC	7	24	89	9,264	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	3	6	269	27,947	資本財
ROSS STORES INC	12	23	269	27,984	小売
S&P GLOBAL INC	9	14	446	46,402	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	7	7	44	4,650	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11	20	141	14,644	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	2	3	184	19,145	銀行

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
SALESFORCE.COM INC		30	59	1,340	139,186	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		50	84	206	21,400	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP		44	100	584	60,721	各種金融
SEAGEN INC		—	10	188	19,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP		6	14	65	6,846	素材
SEATTLE GENETICS INC		6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY		10	16	203	21,174	公益事業
SERVICENOW INC		7	12	699	72,649	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		3	5	388	40,295	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC		7	10	174	18,169	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP		6	9	55	5,769	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM		5	8	94	9,846	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC		2	4	83	8,667	資本財
SNAP INC - A		—	66	354	36,830	メディア・娯楽
SOUTHERN CO		39	65	394	41,010	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO		7	17	85	8,838	運輸
SPLUNK INC		6	12	214	22,253	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A		15	25	566	58,808	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		5	9	164	17,102	資本財
STARBUCKS CORP		44	77	808	83,978	消費者サービス
STATE STREET CORP		13	20	152	15,858	各種金融
STRYKER CORP		12	21	520	54,089	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		6	11	305	31,726	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL		22	43	162	16,887	各種金融
SYSCO CORP		17	32	242	25,226	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP		13	—	—	—	各種金融
TJX COMPANIES INC		43	77	520	54,054	小売
T-MOBILE US INC		13	37	493	51,290	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		5	9	187	19,509	メディア・娯楽
TAPESTRY INC		13	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP		19	32	621	64,566	小売
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		—	3	128	13,335	資本財
TELEFLEX INC		2	3	140	14,566	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC		5	47	4,013	416,805	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS		33	56	974	101,171	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC		10	19	99	10,296	資本財
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		—	3	260	27,013	ソフトウェア・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		15	25	1,331	138,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO		20	33	573	59,557	資本財
TIFFANY & CO		5	—	—	—	小売
TRACTOR SUPPLY COMPANY		5	10	163	16,983	小売
TRANSDIGM GROUP INC		2	3	227	23,582	資本財
TRANSUNION		8	15	142	14,754	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE		8	13	191	19,899	保険
TRIMBLE INC		13	21	154	16,076	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I		10	—	—	—	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP		49	78	403	41,862	銀行
TWILIO INC - A		—	9	374	38,915	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC		31	58	278	28,945	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A		10	20	133	13,849	食品・飲料・タバコ
US BANCORP		57	85	390	40,577	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC		—	66	361	37,531	運輸

銘 柄	株 数	期首(前期末)	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	
ULTA BEAUTY INC	2	4	132	13,796	小売
UNION PACIFIC CORP	25	40	840	87,324	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	24	45	716	74,391	運輸
UNITED RENTALS INC	3	6	167	17,400	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	30	—	—	—	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	34	60	2,091	217,187	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3	5	70	7,292	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	10	—	—	—	保険
VF CORP	12	21	180	18,791	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	2	3	106	11,083	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	14	27	162	16,877	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4	7	123	12,845	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5	10	292	30,367	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	4	8	161	16,744	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	145	253	1,455	151,149	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	4	9	176	18,374	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10	18	435	45,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOMCBS INC-CLASS B	26	45	209	21,757	メディア・娯楽
VIATRIS INC	—	85	148	15,436	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	61	104	2,118	220,035	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	4	7	96	10,041	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	7	12	72	7,511	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	5	8	135	14,060	素材
WABCO HOLDINGS INC	2	—	—	—	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	11	19	168	17,539	公益事業
WABTEC CORP/DE	8	15	124	12,968	資本財
WALMART INC	49	88	1,294	134,459	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26	43	208	21,610	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	9	15	159	16,528	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	13	22	262	27,264	商業・専門サービス
WATERS CORP	3	4	132	13,723	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & COMPANY	149	234	749	77,790	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	—	5	179	18,603	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	12	22	114	11,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	21	33	74	7,731	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	12	23	108	11,257	素材
WHIRLPOOL CORP	3	5	116	12,122	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	44	77	168	17,490	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	7	13	308	32,039	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	18	29	193	20,079	公益事業
XILINX INC	9	17	252	26,168	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	8	14	147	15,277	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	10	16	181	18,882	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2	4	176	18,340	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8	12	206	21,467	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	18	31	520	54,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	12	465	48,332	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	19	48	102	10,595	各種金融
CHUBB LTD	15	27	420	43,699	保険
LyondellBasell Industries NV	8	16	148	15,379	素材
GARMIN LTD	6	11	138	14,401	耐久消費財・アパレル

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ACCENTURE PLC-CL A		23	39	1,017	105,688	ソフトウェア・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV		11	19	328	34,083	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY		11	17	104	10,865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AON PLC		7	—	—	—	保険
TE CONNECTIVITY LTD		10	19	255	26,570	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND PLC		8	—	—	—	資本財
APTIV PLC		9	19	267	27,767	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC		13	22	275	28,619	資本財
IHS MARKIT LTD		16	27	238	24,789	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		4	7	153	15,932	保険
TECHNIPFMC PLC		21	—	—	—	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		9	15	88	9,237	資本財
STERIS PLC		—	7	145	15,131	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC		7	13	59	6,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC		68	119	132	13,731	素材
CAPRI HOLDINGS LTD		7	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC		—	15	235	24,493	資本財
AON PLC		—	13	269	28,020	保険
PENTAIR PLC		7	14	86	8,970	資本財
MEDTRONIC PLC		46	82	958	99,557	ヘルスケア機器・サービス
MYLAN NV		24	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		29	42	222	23,119	資本財
ALLERGAN PLC		12	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		11	15	72	7,532	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC		20	32	818	85,026	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		7	16	70	7,318	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	10,399	19,126	213,056	22,123,764	
	銘 柄 数 < 比 率 >	487	490	—	<68.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		11	20	185	15,109	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		32	52	197	16,169	食品・生活必需品小売り
BCE INC		8	15	86	7,068	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		21	38	372	30,409	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		41	68	471	38,541	銀行
BARRICK GOLD CORP		65	124	372	30,434	素材
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		36	87	429	35,107	各種金融
CAE INC		16	32	97	7,985	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B		8	16	99	8,100	素材
CGI INC		8	16	162	13,243	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP		29	60	95	7,802	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		14	23	265	21,677	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		23	40	553	45,205	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES		43	81	252	20,617	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		4	7	332	27,148	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		2	6	114	9,378	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		11	24	78	6,398	公益事業
CENOVUS ENERGY INC		51	145	108	8,899	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		0.93	1	241	19,762	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC		13	27	143	11,679	小売
EMERA INC		—	24	132	10,807	公益事業
ENCANA CORP		59	—	—	—	エネルギー
ENBRIDGE INC		75	127	563	46,005	エネルギー

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	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1	2	92 7,559	保険
FORTIS INC	20	34	178 14,614	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	7	14	224 18,369	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13	25	84 6,902	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	16	25	76 6,265	保険
HUSKY ENERGY INC	39	—	— —	エネルギー
HYDRO ONE LTD	22	40	121 9,909	公益事業
IGM FINANCIAL INC	8	18	66 5,430	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	10	38	99 8,140	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	7	11	173 14,186	保険
INTER PIPELINE LTD	22	64	86 7,050	エネルギー
KEYERA CORP	13	37	94 7,677	エネルギー
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	24	123 10,116	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	9	15	97 7,993	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	9	20	201 16,457	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	71	111	268 21,950	保険
METRO INC	13	22	126 10,303	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	16	24	178 14,602	銀行
NUTRIEN LTD	20	37	252 20,614	素材
OPEN TEXT CORP	13	26	160 13,086	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	25	48	172 14,106	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	17	51	159 13,007	保険
POWER FINANCIAL CORP	17	—	— —	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14	—	— —	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	12	25	195 15,981	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	14	28	172 14,121	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	49	84	904 73,906	銀行
SAPUTO INC	9	19	69 5,652	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	25	45	101 8,270	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	4	7	1,100 89,902	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	16	29	182 14,864	保険
SUNCOR ENERGY INC	56	105	238 19,454	エネルギー
TC ENERGY CORP	34	54	305 24,984	エネルギー
TELUS CORP	8	16	42 3,454	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	9	13	141 11,562	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	62	105	778 63,566	銀行
WESTON (GEORGE) LTD	4	7	68 5,613	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22	37	190 15,595	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	1,324	2,322 12,891 1,052,826	
	銘 柄 数 < 比 率 >	59	57 — <3.2%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ	
ADIDAS AG	6	11	316 39,978	耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG	14	23	90 11,386	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8	16	61 7,819	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4	9	44 5,643	素材
HANNOVER RUECK SE	3	4	60 7,669	保険
GEA GROUP AG	8	18	55 7,071	資本財
CONTINENTAL AG	3	7	89 11,265	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	31	57	245 31,016	運輸
MERCK KGAA	6	10	143 18,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	25	43	159 20,160	公益事業
SAP SE	35	63	660 83,407	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	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	
E.ON SE	72	120		105	13,301	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	5	9		73	9,303	家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG	4	7		64	8,123	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	33	61		322	40,765	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	3	7		64	8,201	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	30	52		346	43,813	素材
BEIERSDORF AG	4	7		66	8,375	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	5	10		70	8,966	素材
FRESenius MEDICAL CARE AG & Co	9	14		97	12,333	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	14	24		477	60,385	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16	—		—	—	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4	7		171	21,714	保険
VOLKSWAGEN AG	2	3		65	8,324	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	5	9		152	19,317	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	31	57		336	42,563	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	26	47		635	80,284	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG	82	154		137	17,341	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9	19		142	17,962	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	106	186		280	35,449	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	—	3		125	15,875	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45	90		312	39,515	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	6	10		133	16,861	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6	11		69	8,802	自動車・自動車部品
WIRECARD AG	5	—		—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	5	7		50	6,411	素材
MTU AERO ENGINES AG	2	4		96	12,233	資本財
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	—	24		101	12,837	不動産
SYMRISE AG	6	9		94	11,989	素材
BRENTAG AG	6	14		95	12,130	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	9	11		32	4,074	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	93	191		44	5,561	電気通信サービス
COMMERZBANK AG	60	107		62	7,890	銀行
LEG IMMOBILIEN AG	—	5		66	8,464	不動産
VONOVIA SE	22	31		175	22,223	不動産
METRO AG	12	—		—	—	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	17		76	9,672	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG	—	37		118	14,918	資本財
ZALANDO SE	—	13		131	16,663	小売
SCOUT24 AG	—	10		71	9,078	メディア・娯楽
COVESTRO AG	6	15		88	11,231	素材
UNIPER SE	11	15		47	6,034	公益事業
DELIVERY HERO SE	7	11		154	19,505	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	928	1,713	7,692	972,078	
	銘柄 数 < 比 率 >	46	50	—	< 3.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	34	68		99	12,593	保険
INTESA SANPAOLO	588	992		187	23,633	銀行
MEDIOBANCA SPA	42	80		59	7,563	銀行
ENEL SPA	304	545		455	57,530	公益事業
ENI SPA	79	158		135	17,063	エネルギー
ATLANTIA S.P.A	24	—		—	—	運輸
TERNA SPA	80	128		76	9,689	公益事業

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
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		7	14	60	7,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONCLER SPA		9	18	90	11,464	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA		36	62	82	10,476	銀行
UNICREDIT SPA		87	171	132	16,799	銀行
POSTE ITALIANE SPA		38	76	63	7,974	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		38	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	1,373	2,316	1,443	182,471	
	銘 柄 数 < 比 率 >	13	11	—	<0.6%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		12	15	53	6,707	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		27	37	84	10,630	公益事業
L' OREAL		8	14	435	55,041	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		10	17	896	113,246	耐久消費財・アパレル
THALES SA		4	7	54	6,850	資本財
CAPGEMINI		6	11	145	18,369	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)-B		4	7	83	10,605	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		6	10	165	20,895	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		7	—	—	—	自動車・自動車部品
SCHNEIDER ELECTRIC SE		18	30	388	49,073	資本財
VIVENDI SA		33	43	114	14,526	メディア・娯楽
ORANGE		56	92	88	11,187	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		0.79	1	147	18,699	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		5	8	137	17,327	ソフトウェア・サービス
KERING		2	4	248	31,347	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES		15	25	33	4,296	保険
CARREFOUR SA		22	39	58	7,413	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		4	7	48	6,132	ソフトウェア・サービス
SANOFI		41	70	571	72,192	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA		10	21	63	8,041	消費者サービス
SOCIETE GENERALE-A		30	63	103	13,087	銀行
TELEPERFORMANCE		3	4	138	17,505	商業・専門サービス
SODEXO		4	10	77	9,744	消費者サービス
AXA SA		61	103	198	25,076	保険
PEUGEOT SA		23	—	—	—	自動車・自動車部品
ESSILORLUXOTTICA		10	17	209	26,517	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA		57	94	94	11,892	銀行
BNP PARIBAS		39	69	298	37,764	銀行
ORPEA		—	5	69	8,801	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		15	30	130	16,446	資本財
Wendel		2	3	37	4,770	各種金融
SAFRAN SA		12	21	235	29,714	資本財
ENGIE		58	106	139	17,640	公益事業
ALSTOM		11	22	105	13,341	資本財
Eutelsat Communications		15	—	—	—	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE		30	51	64	8,132	公益事業
Legrand SA		7	13	107	13,529	資本財
Eiffage SA		4	6	52	6,670	資本財
TOTAL SE		82	153	556	70,263	エネルギー
Aeroports de Paris		1	3	34	4,361	運輸
Natixis		68	125	39	4,984	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		4	9	84	10,645	メディア・娯楽
SCOR SE		7	16	44	5,668	保険

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
VINCI S.A.		16	30	243	30,716	資本財
DANONE		19	32	176	22,270	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE		15	27	359	45,372	素材
Bureau Veritas SA		12	23	52	6,579	商業・専門サービス
GETLINK SE		26	40	52	6,596	運輸
SUEZ		21	42	71	9,088	公益事業
EDENRED		12	20	97	12,354	ソフトウェア・サービス
VALEO SA		10	21	67	8,561	自動車・自動車部品
EUROFINS SCIENTIFIC		—	13	102	13,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORLDLINE SA		6	18	137	17,421	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	2	93	11,836	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	995	1,675	8,094	1,022,954	
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	51	—	<3.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE		21	39	347	43,913	資本財
RANDSTAD NV		6	11	61	7,798	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER		7	12	88	11,227	商業・専門サービス
Koninklijke Vopak NV		5	5	23	3,013	エネルギー
AEGON NV		99	187	65	8,292	保険
KONINKLIJKE KPN NV		177	319	84	10,628	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		32	45	147	18,624	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV		32	53	244	30,835	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV		8	13	120	15,226	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		5	7	58	7,385	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		6	9	146	18,539	素材
UNILEVER NV		49	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV		15	27	1,283	162,152	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		40	61	144	18,312	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV		5	8	143	18,096	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV		—	91	102	12,909	資本財
AKZO NOBEL		6	10	94	11,952	素材
PROSUS NV		18	34	337	42,692	小売
STELLANTIS NV		—	81	107	13,551	自動車・自動車部品
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		—	67	59	7,493	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV		14	24	88	11,209	保険
QIAGEN N V		14	21	95	12,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV /WI		0.59	1	251	31,768	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA		135	247	190	24,085	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	704	1,383	4,286	541,728	
	銘 柄 数 < 比 率 >	21	23	—	<1.7%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA		18	23	50	6,371	公益事業
Bankinter SA		48	—	—	—	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		199	440	176	22,292	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		15	27	53	6,780	公益事業
REPSOL SA		37	119	101	12,784	エネルギー
BANCO SANTANDER S.A		547	1,128	291	36,805	銀行
TELEFONICA SA		138	323	117	14,867	電気通信サービス
ENAGAS SA		10	13	24	3,060	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		12	22	61	7,724	資本財
FERROVIAL SA		25	40	81	10,305	資本財
MAPFRE S.A.		109	—	—	—	保険

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CaixaBank SA		174	253	52	6,578	銀行
IBERDROLA SA		196	351	409	51,788	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		15	29	159	20,180	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		16	25	40	5,065	公益事業
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS		—	22	0.96469	121	資本財
INDITEX		36	60	155	19,622	小売
AENA SME SA		2	4	55	6,953	運輸
CELLNEX TELECOM SAU		12	27	135	17,181	電気通信サービス
GRIFOLS SA		16	24	61	7,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,633	2,938	2,027	256,204	
		19	18	—	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		9	21	128	16,178	銀行
SOLVAY SA		3	6	62	7,960	素材
UCB SA		6	11	98	12,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		3	6	30	3,827	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		5	8	75	9,586	各種金融
AGEAS		9	13	58	7,410	保険
UMICORE		10	15	73	9,309	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		26	49	270	34,245	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	75	132	798	100,948	
		8	8	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		8	21	78	9,867	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		16	30	78	9,957	銀行
ANDRITZ AG		6	—	—	—	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31	51	156	19,824	
		3	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA		23	64	40	5,123	エネルギー
SES SA		23	65	47	6,008	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		40	93	54	6,883	不動産
ARCELORMITTAL		37	61	114	14,518	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	124	284	257	32,534	
		4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA		17	45	39	4,990	資本財
UPM-KYMMENE OYJ		16	26	83	10,512	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS		22	41	66	8,396	素材
SAMPO OYJ-A SHS		11	28	100	12,700	保険
FORTUM OYJ		21	28	59	7,549	公益事業
ELISA OYJ		7	10	50	6,383	電気通信サービス
NOKIA OYJ		195	338	114	14,513	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ		17	29	183	23,211	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		7	—	—	—	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		9	18	118	14,965	資本財
ORION OYJ		6	13	53	6,723	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	332	580	870	109,946	
		11	10	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC(DUBLIN)		33	39	141	17,933	素材
KINGSPAN GROUP PLC		6	13	87	11,017	資本財

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額		
(ユーロ…アイルランド)		百株	百株	千ユーロ 千円		
KERRY GROUP PLC-A		6	8	97	12,374	食品・飲料・タバコ
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		4	12	197	24,912	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	51	74	524	66,238	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		124	245	130	16,442	公益事業
Galp Energia SGPS SA		21	43	38	4,840	エネルギー
JERONIMO MARTINS		14	18	26	3,377	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	160	307	195	24,660	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	6,411	11,458	26,347	3,329,590	
	銘 柄 数 < 比 率 >	183	184	—	<10.2%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ASHTREAD GROUP PLC		23	35	136	19,424	資本財
AVIVA PLC		108	229	80	11,369	保険
DIAGEO PLC		80	138	403	57,382	食品・飲料・タバコ
SCHROEDERS PLC		9	12	44	6,270	各種金融
BAE SYSTEMS PLC		103	193	92	13,145	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		83	141	387	55,071	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		—	29	76	10,902	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		112	190	87	12,480	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		30	57	95	13,579	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		700	1,259	512	72,896	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		231	440	116	16,589	保険
MEGGITT PLC		47	—	—	—	資本財
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS		118	193	36	5,123	食品・生活必需品小売り
Associated British Foods PLC		14	21	48	6,931	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC		13	21	59	8,414	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC		92	155	216	30,824	保険
RIO TINTO PLC		44	73	430	61,116	素材
ST JAMES'S PLACE PLC		—	56	67	9,535	各種金融
SSE PLC		42	75	116	16,552	公益事業
BP PLC		702	1,226	355	50,564	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		2,696	4,131	143	20,416	銀行
TESCO PLC		359	495	119	17,032	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		36	50	83	11,934	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC		183	303	418	59,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE		16	—	—	—	資本財
ASTRAZENECA PLC		48	86	671	95,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC		301	623	84	11,951	電気通信サービス
CARNIVAL PLC		7	—	—	—	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		103	—	—	—	小売
BARCLAYS PLC		692	1,076	153	21,881	銀行
INTERTEK GROUP PLC		7	11	66	9,507	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		15	23	41	5,886	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC		5	11	87	12,416	小売
KINGFISHER PLC		110	236	64	9,194	小売
ITV PLC		215	—	—	—	メディア・娯楽
G4S PLC		84	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC		10	21	62	8,843	保険
CENTRICA PLC		273	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		147	268	380	54,107	エネルギー

銘柄		期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		138	220	300	42,688	エネルギー
BUNZL PLC		15	27	65	9,273	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC		98	166	87	12,416	商業・専門サービス
London Stock Exchange Group PLC		13	19	181	25,726	各種金融
UNILEVER PLC		37	161	706	100,391	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC		27	54	144	20,573	商業・専門サービス
MONDI PLC		21	32	60	8,576	素材
SEVERN TRENT PLC		12	19	46	6,554	公益事業
Whitbread PLC		7	22	70	10,032	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC		12	21	35	5,046	各種金融
SMITHS GROUP PLC		22	34	50	7,240	資本財
ANGLO AMERICAN PLC		45	87	229	32,627	素材
3I GROUP PLC		46	86	98	14,048	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		25	45	287	40,799	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		60	103	194	27,619	商業・専門サービス
OCADO GROUP PLC		－	44	118	16,839	小売
GLENCORE PLC		436	690	187	26,580	素材
NATWEST GROUP PLC		245	433	67	9,570	銀行
SAGE GROUP PLC/THE		57	83	50	7,238	ソフトウェア・サービス
WPP PLC		52	114	91	12,950	メディア・娯楽
COMPASS GROUP PLC		56	116	162	23,150	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC		115	195	170	24,299	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		131	192	59	8,404	各種金融
BHP GROUP PLC		81	127	269	38,258	素材
VODAFONE GROUP PLC		992	1,611	205	29,169	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		8	17	85	12,102	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		6	10	70	9,987	素材
FERGUSON PLC		7	13	125	17,784	資本財
M&G PLC		144	220	43	6,120	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		43	108	73	10,393	保険
INFORMA PLC		－	151	78	11,093	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		－	6	79	11,272	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		65	81	26	3,720	保険
MELROSE INDUSTRIES PLC		227	437	76	10,897	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC		7	13	39	5,579	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,141 69	17,668 67	10,381 －	1,475,285 <4.5%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA		0.19	0.33	90	10,603	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.2	0.27	54	6,417	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG		1	1	86	10,187	電気通信サービス
Lindt & Spruengli AG		0.07	0.11	88	10,336	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG		0.29	0.52	187	21,990	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG		4	8	311	36,554	保険
NOVARTIS AG-REG SHS		75	138	1,186	139,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD		62	100	268	31,515	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS		25	44	1,407	165,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG(REG)		5	13	79	9,277	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		16	25	125	14,716	素材
CLARIANT AG-REG		14	21	41	4,875	素材
NESTLE SA-REGISTERED		105	177	1,796	210,763	食品・飲料・タバコ
Baloise Holding AG		2	4	62	7,377	保険

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
TEMENOS GROUP AG-REG		3	5	61	7,244	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG		2	4	101	11,951	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG		0.57	0.98	101	11,938	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG		95	146	178	20,893	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B		1	2	62	7,331	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG		3	5	322	37,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG		1	2	98	11,496	保険
SWISS PRIME SITE		—	6	56	6,609	不動産
PARTNERS GROUP HOLDING AG		0.82	1	147	17,317	各種金融
Schindler Holding AG		1	1	43	5,115	資本財
Schindler Holding AG		1	2	66	7,763	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		2	5	109	12,842	運輸
Logitech International SA		—	14	136	16,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG		1	1	101	11,892	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD		11	21	121	14,214	各種金融
SWISS RE AG		9	16	134	15,734	保険
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		17	33	285	33,504	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG		4	9	232	27,216	素材
ALCON INC		14	30	201	23,674	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG		127	228	300	35,276	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	617	1,078	8,650	1,014,766	
	銘 柄 数 < 比 率 >	32	34	—	<3.1%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		77	108	1,007	12,598	銀行
Swedbank AB		34	61	1,010	12,637	銀行
SWEDISH MATCH AB		7	14	869	10,879	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS		13	26	341	4,274	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS		11	22	1,420	17,764	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B		26	61	1,129	14,130	小売
ERICSSON LM-B SHS		107	185	1,802	22,550	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA COMPANY AB		101	189	687	8,598	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		19	29	676	8,457	資本財
LUNDIN ENERGY AB		11	15	380	4,759	エネルギー
ALFA LAVAL AB		14	20	494	6,186	資本財
Millicom International Cellular SA		6	—	—	—	電気通信サービス
Husqvarna AB		32	64	701	8,776	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES		15	24	585	7,322	資本財
VOLVO AB-B SHS		37	80	1,756	21,977	資本財
SANDVIK AB		30	57	1,250	15,638	資本財
Industrivarden AB		12	23	635	7,953	各種金融
HEXAGON AB-B SHS		11	17	1,328	16,615	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS		30	48	557	6,973	電気通信サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS		17	33	1,595	19,959	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		20	34	1,400	17,524	資本財
EPIROC AB-A		24	47	771	9,650	資本財
EPIROC AB-B		22	39	603	7,548	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		23	33	886	11,087	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB		16	27	824	10,317	素材
EVOLUTION AB		—	14	1,262	15,795	消費者サービス
KINNEVIK AB-B		14	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB-B		—	23	970	12,138	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		60	97	847	10,602	銀行

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		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	千円		
ASSA ABLOY AB-B		30	48	1,021	12,781	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	33	982	12,288	資本財
NORDEA BANK ABP		103	157	1,116	13,973	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	936	1,644	28,917	361,762	
		29	30	—	<1.1%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
TELENOR ASA		30	51	750	9,173	電気通信サービス
EQUINOR ASA		26	62	1,025	12,526	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		6	9	372	4,551	素材
MOWI ASA		21	30	579	7,077	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		106	179	708	8,655	素材
ORKLA ASA		32	56	473	5,780	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		15	29	608	7,432	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		11	18	510	6,237	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	251	438	5,027	61,434	
		8	8	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		4	7	669	11,372	食品・飲料・タバコ
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.33	0.56	802	13,638	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.2	0.26	344	5,848	運輸
DANSKE BANK A/S		31	48	547	9,294	銀行
GENMAB A/S		—	5	1,377	23,395	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		7	14	2,083	35,395	資本財
H LUNDBECK A/S		7	15	352	5,985	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A/S		8	15	1,474	25,045	運輸
PANDORA A/S		4	8	556	9,462	耐久消費財・アパレル
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		4	9	482	8,193	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		7	13	470	7,997	素材
COLOPLAST-B		5	7	656	11,158	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B		63	107	4,784	81,290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S		7	13	1,713	29,112	公益事業
DEMANT A/S		9	17	429	7,296	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	162	283	16,744	284,489	
		14	15	—	<0.9%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD		92	169	416	33,442	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION		117	208	454	36,484	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		50	132	322	25,835	素材
TELSTRA CORP LTD		207	286	91	7,340	電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED		35	74	97	7,833	食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE		10	15	110	8,838	各種金融
BHP GROUP LIMITED		109	182	842	67,540	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		12	—	—	—	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED		27	68	99	7,995	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED		17	28	787	63,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP		115	175	235	18,847	運輸
COCHLEAR LIMITED		3	6	121	9,713	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED		77	134	68	5,494	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		62	109	933	74,854	銀行
RIO TINTO LIMITED		15	23	284	22,813	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		88	164	82	6,601	保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		5	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	当期(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
ORICA LTD	25	31	50	4,025	素材	
LENDEASE GROUP	28	67	84	6,777	不動産	
SUNCORP GROUP LTD	55	103	107	8,636	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102	217	524	42,042	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	29	56	151	12,175	素材	
INCITEC PIVOT LTD	136	—	—	—	素材	
AMP LIMITED	154	495	77	6,181	各種金融	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	63	105	89	7,157	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	85	115	9,233	素材	
SANTOS LTD	97	172	124	9,973	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	24	44	155	12,433	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	143	284	118	9,535	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	33	66	353	28,335	小売	
ALUMINA LTD	189	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	25	58	156	12,533	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	38	76	309	24,857	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	18	41	118	9,471	メディア・娯楽	
BRAMBLES LTD	63	107	114	9,173	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	11	22	302	24,222	各種金融	
CROWN RESORTS LIMITED	33	—	—	—	消費者サービス	
EVOLUTION MINING LTD	—	186	85	6,895	素材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	37	77	72	5,781	食品・飲料・タバコ	
SYDNEY AIRPORT	70	100	59	4,747	運輸	
AFTERPAY LTD	—	18	261	20,991	ソフトウェア・サービス	
AMPOL LTD	—	25	77	6,204	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	30	30	36	2,900	公益事業	
SOUTH32 LTD	279	469	130	10,427	素材	
COLES GROUP LTD	49	98	178	14,351	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	2,792	4,823	8,801	705,842	
	銘柄数<比率>	41	40	—	<2.2%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	33	61	97	7,258	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	29	53	58	4,356	食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	49	173	12,964	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	85	112	54	4,076	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56	84	62	4,657	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	114	168	135	10,160	公益事業	
小計	株数・金額	321	530	581	43,474	
	銘柄数<比率>	5	6	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	18	53	661	8,870	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	144	174	293	3,935	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	55	105	763	10,228	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	40	83	4,237	56,777	各種金融	
MTR CORPORATION	90	125	545	7,303	運輸	
HANG SENG BANK	24	44	633	8,484	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	94	154	497	6,666	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	70	90	372	4,986	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	349	773	872	11,694	公益事業	
Galaxy Entertainment Group Limited	100	190	1,121	15,034	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	195	320	777	10,419	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	195	—	—	—	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	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		60	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SINO LAND CO		258	478	498	6,674	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		65	75	817	10,954	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A		35	70	346	4,643	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		75	115	1,398	18,738	資本財
AIA GROUP LTD		434	780	7,831	104,938	保険
HKT Trust / HKT Ltd		270	370	375	5,037	電気通信サービス
Sands China Ltd		124	240	735	9,857	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		106	206	484	6,486	不動産
WH Group Limited		470	655	427	5,722	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		93	143	809	10,847	資本財
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)		45	70	303	4,066	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		108	178	726	9,734	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	3,518	5,492	25,530	342,103	
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	23	—	<1.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		113	235	90	7,061	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD		60	99	259	20,273	銀行
CITY DEVELOPMENTS		39	86	64	5,053	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		138	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		53	—	—	—	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		41	56	132	10,385	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		49	96	72	5,709	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		165	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		289	579	143	11,236	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		85	143	151	11,883	銀行
KEPPEL CORP LTD		84	159	89	7,017	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		341	1,024	90	7,051	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,457	2,477	1,094	85,670	
	銘 柄 数 < 比 率 >	12	9	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM BM		37	86	205	6,527	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		51	102	213	6,765	銀行
ICL GROUP LTD		35	35	61	1,966	素材
NICE LTD		2	4	398	12,631	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		7	18	144	4,574	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	133	246	1,023	32,464	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	39,467	67,590	—	30,913,475	
	銘 柄 数 < 比 率 >	969	968	—	<95.1%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

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

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 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	—	0.876	147	15,358	0.0	
AMERICAN TOWER CORP	1	2	605	62,826	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.412	0.76	125	13,000	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	0.42	1	102	10,637	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.513	0.66	67	7,028	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	1	2	429	44,572	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.816	1	233	24,197	0.1	
DUKE REALTY CORP	1	3	122	12,685	0.0	
EQUINIX INC	0.339	0.577	416	43,208	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	0.943	1	86	8,989	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	1	2	137	14,261	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.245	0.423	102	10,693	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.674	1	127	13,218	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.411	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	3	119	12,413	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	3	6	93	9,686	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	1	2	76	7,974	0.0	
KIMCO REALTY CORP	2	—	—	—	—	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.863	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2	5	113	11,780	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.539	0.834	111	11,620	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.921	—	—	—	—	
PROLOGIS INC	2	4	449	46,667	0.1	
PUBLIC STORAGE	0.463	0.842	187	19,479	0.1	
REALTY INCOME CORP	0.987	1	116	12,141	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	0.962	1	89	9,312	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.474	0.74	201	20,955	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	0.346	—	—	—	—	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.96	2	203	21,140	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	—	0.761	111	11,611	0.0	
UDR INC	1	2	81	8,431	0.0	
VENTAS INC	1	2	144	15,014	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	0.718	1	67	7,052	0.0	
WP CAREY INC	0.825	1	92	9,576	0.0	
WELLTOWER INC	1	2	172	17,951	0.1	
WEYERHAEUSER CO	2	5	184	19,108	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	40	67	5,321	552,594	
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	31	—	<1.7%>	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	3	58	4,811	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1	3	58	4,811	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		1	2	35	4,483	0.0
GECINA SA		0.267	0.267	31	3,951	0.0
COVIVIO		0.315	0.548	37	4,736	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		0.387	1	67	8,548	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	2	4	171	21,719	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		5	10	48	6,837	0.0
SEGRO PLC		5	8	83	11,897	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		4	6	39	5,611	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	15	25	171	24,346	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		22	39	99	8,000	0.0
GPT GROUP		8	14	65	5,224	0.0
STOCKLAND		14	24	110	8,889	0.0
DEXUS		4	7	66	5,306	0.0
GOODMAN GROUP		7	11	197	15,851	0.0
SCENTRE GROUP		17	39	113	9,108	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	75	136	653	52,380	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		6	15	1,093	14,647	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6	15	1,093	14,647	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		17	47	108	8,510	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	47	108	8,510	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	157	301	—	679,011	
	銘柄 数 < 比 率 >	50	47	—	<2.1%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

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

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		S&P 500 EMIN	656	—
		DJ EU STX 50	136	—
		FTSE 100 IDX	122	—

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

<TMA外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、TMA外国債券インデックスマザーファンド全体(4,412,965千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 28,150	千米ドル 30,201	千円 3,136,075	% 42.4	% —	% 19.1	% 15.8	% 7.6
カナダ	千カナダドル 1,600	千カナダドル 1,720	140,507	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 10,000	千メキシコペソ 11,416	59,479	0.8	—	0.5	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	3,800	4,517	570,902	7.7	—	4.9	1.9	0.9
イタリア	4,500	5,419	684,840	9.3	—	6.0	2.4	0.9
フランス	5,100	6,168	779,507	10.5	—	7.5	2.6	0.5
オランダ	900	1,242	157,003	2.1	—	1.7	0.2	0.2
スペイン	2,900	3,538	447,148	6.1	—	4.4	1.3	0.4
ベルギー	1,100	1,452	183,609	2.5	—	1.9	0.4	0.2
オーストリア	700	901	113,959	1.5	—	1.2	0.2	0.2
フィンランド	300	346	43,761	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	400	463	58,567	0.8	—	0.6	0.2	—
イギリス	千英ポンド 2,640	千英ポンド 3,526	501,162	6.8	—	5.4	1.0	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,600	千スウェーデンクローナ 1,749	21,885	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,100	千ノルウェークローネ 1,157	14,139	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,700	千デンマーククローネ 2,143	36,422	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,500	千ポーランドズロチ 1,620	45,108	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 2,300	千豪ドル 2,538	203,616	2.8	—	2.1	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 400	千シンガポールドル 454	35,588	0.5	—	0.5	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 1,400	千マレーシアリンギット 1,513	38,834	0.5	—	0.4	0.1	0.0

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
イスラエル	千イスラエルシェケル 900	千イスラエルシェケル 1,073	千円 34,051	% 0.5	% —	% 0.3	% 0.1	% 0.0
合 計	—	—	7,306,175	98.9	—	58.4	28.3	12.1

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。
(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
		千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	99	10,286	2027/4/30
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	197	20,552	2027/5/31
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	98	10,264	2027/6/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	200	197	20,488	2027/8/31
T 0 1/2 10/31/27	0.5	100	98	10,220	2027/10/31
T 0 1/4 04/15/23	0.25	100	100	10,409	2023/4/15
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	199	20,667	2025/5/31
T 0 1/4 06/15/23	0.25	300	300	31,229	2023/6/15
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	298	30,986	2025/6/30
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	99	10,320	2025/7/31
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	298	30,945	2025/8/31
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	198	20,615	2025/9/30
T 0 1/4 10/31/25	0.25	100	99	10,300	2025/10/31
T 0 1/8 04/30/22	0.125	100	100	10,384	2022/4/30
T 0 1/8 05/15/23	0.125	200	199	20,756	2023/5/15
T 0 1/8 05/31/22	0.125	100	100	10,384	2022/5/31
T 0 1/8 06/30/22	0.125	200	200	20,768	2022/6/30
T 0 1/8 07/15/23	0.125	200	199	20,755	2023/7/15
T 0 1/8 07/31/22	0.125	300	300	31,154	2022/7/31
T 0 1/8 08/15/23	0.125	100	99	10,375	2023/8/15
T 0 1/8 09/15/23	0.125	100	99	10,374	2023/9/15
T 0 1/8 09/30/22	0.125	400	399	41,532	2022/9/30
T 0 1/8 10/15/23	0.125	300	299	31,117	2023/10/15
T 0 1/8 12/15/23	0.125	500	499	51,842	2023/12/15
T 0 3/8 03/31/22	0.375	300	300	31,237	2022/3/31
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	100	10,395	2025/4/30
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	195	20,341	2027/7/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	200	195	20,297	2027/9/30
T 0 5/8 05/15/30	0.625	400	384	39,952	2030/5/15
T 0 5/8 08/15/30	0.625	200	191	19,912	2030/8/15
T 0 5/8 11/30/27	0.625	300	297	30,889	2027/11/30
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	210	21,856	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	500	520	54,081	2030/2/15
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	102	10,677	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	102	10,689	2023/3/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	400	408	42,467	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	104	10,851	2024/9/30
T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	313	32,573	2024/10/31
T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	209	21,722	2024/11/30
T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	172	17,883	2050/5/15
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	102	10,670	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	100	103	10,751	2024/8/31
T 1 1/8 02/28/22	1.125	100	101	10,498	2022/2/28

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
		千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 1 1/8 02/28/25	1.125	300	309	32,164	2025/2/28
T 1 1/8 05/15/40	1.125	100	91	9,486	2040/5/15
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	309	32,162	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	508	52,844	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	408	42,415	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	518	53,834	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	315	32,792	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	205	21,334	2022/9/30
T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	319	33,176	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/24	1.75	200	211	21,944	2024/12/31
T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	320	33,254	2026/12/31
T 1 3/8 01/31/22	1.375	300	303	31,551	2022/1/31
T 1 3/8 01/31/25	1.375	100	104	10,823	2025/1/31
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	205	21,295	2023/2/15
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	177	18,470	2050/8/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	102	10,606	2022/10/15
T 1 3/8 11/15/40	1.375	100	95	9,885	2040/11/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	635	65,940	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	211	21,983	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	511	53,149	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	210	21,903	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	211	22,009	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/22	1.625	100	102	10,663	2022/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	200	211	22,009	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	102	10,676	2022/12/15
T 1 5/8 12/31/21	1.625	100	101	10,529	2021/12/31
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	203	21,167	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	107	11,144	2026/7/31
T 2 02/15/22	2.0	500	510	52,962	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	311	32,337	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	213	22,176	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	400	414	43,022	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	106	11,010	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	858	89,153	2025/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	213	22,208	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	114	11,902	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	537	55,801	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	114	11,896	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	317	33,018	2023/8/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	109	11,419	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	218	22,723	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	100	109	11,351	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	859	89,250	2024/11/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	440	45,715	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	322	33,507	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	108	11,222	2026/11/15
T 2 11/30/22	2.0	400	413	42,963	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	681	70,778	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	106	11,061	2023/7/31
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	643	66,825	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	238	24,790	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	110	11,491	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	111	11,581	2029/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	215	22,325	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	100	112	11,655	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	110	11,505	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	113	11,774	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	109	11,364	2025/3/31
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	114	11,909	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	121	12,640	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	221	23,029	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	111	11,544	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	114	11,934	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	122	12,695	2045/8/15
T 3 02/15/47	3.0	300	376	39,083	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	300	377	39,193	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	505	52,474	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	125	13,036	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	126	13,084	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	126	13,130	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	128	13,360	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	380	39,536	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	234	24,306	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	126	13,108	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	375	38,940	2045/11/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	100	134	13,989	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	136	14,174	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	136	14,139	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	277	28,789	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	145	15,094	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	154	16,060	2041/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	146	15,262	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	200	293	30,454	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	76	7,919	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	141	14,681	2031/2/15
小 計				3,136,075	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
(カナダ) 国債証券					
CAN 0 1/2 03/01/22	0.5	100	100	8,200	2022/3/1
CAN 0 1/2 09/01/25	0.5	100	100	8,190	2025/9/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	100	96	7,841	2030/12/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	102	8,392	2027/6/1
CAN 1 09/01/22	1.0	200	202	16,562	2022/9/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	103	8,419	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	105	8,606	2026/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	103	8,458	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	103	8,465	2030/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	104	8,545	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	107	8,777	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	112	9,173	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	103	8,456	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	130	10,622	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	144	11,794	2045/12/1
小 計				140,507	
(メキシコ) 国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	277	1,443	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	718	3,743	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	800	840	4,376	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	618	3,222	2022/6/9
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	105	547	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,936	10,091	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	350	1,824	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	452	2,357	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	234	1,220	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,455	7,585	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,823	9,500	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	400	488	2,547	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	400	466	2,429	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,500	1,648	8,589	2023/12/7
小 計				59,479	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券					
BKO 0 03/11/22	—	200	201	25,463	2022/3/11
BKO 0 09/16/22	—	100	101	12,781	2022/9/16
DBR 0 02/15/30	—	100	105	13,309	2030/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	105	13,278	2035/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	104	13,156	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	105	13,301	2029/8/15
DBR 0 08/15/30	—	200	210	26,622	2030/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	105	13,290	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	106	13,442	2026/2/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	105	13,391	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	107	13,557	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	321	40,570	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	100	104	13,229	2027/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	108	13,658	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	104	13,225	2023/2/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	103	13,091	2022/9/4
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	138	17,524	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	103	13,084	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	165	20,927	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	170	21,488	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	177	22,464	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	171	21,712	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	172	21,770	2034/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	187	23,634	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	162	20,499	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	147	18,673	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	200	204	25,886	2024/4/5
OBL 0 04/11/25	—	200	206	26,077	2025/4/11
OBL 0 10/13/23	—	200	204	25,797	2023/10/13
OBL 0 10/18/24	—	200	205	25,986	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.3 08/15/23	0.3	200	202	25,584	2023/8/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	100	101	12,807	2025/2/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	200	206	26,128	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	102	12,944	2023/3/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	100	102	12,964	2030/8/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	106	13,414	2025/6/1
BTPS 1 3/4 07/01/24	1.75	100	106	13,417	2024/7/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	300	306	38,676	2022/4/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	105	13,348	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	215	27,174	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	108	13,751	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	100	109	13,776	2030/12/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	100	107	13,627	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	110	14,022	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	116	14,698	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	109	13,778	2025/12/1
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	125	15,855	2047/3/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	127	16,075	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	240	30,379	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	125	15,850	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	136	17,293	2046/9/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	113	14,346	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	130	16,458	2035/3/1
BTPS 3.45 03/01/48	3.45	100	142	17,991	2048/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	141	17,890	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	114	14,433	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	110	13,992	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	112	14,217	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	131	16,650	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	165	20,948	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	150	19,051	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	162	20,480	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	163	20,637	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	220	27,834	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	155	19,640	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	151	19,196	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	140	17,776	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	140	17,722	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	200	202	25,620	2023/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	200	206	26,033	2026/2/25
FRTR 0 03/25/23	—	100	100	12,758	2023/3/25
FRTR 0 03/25/24	—	200	204	25,802	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	300	307	38,908	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	105	13,371	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	100	106	13,462	2040/5/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	206	26,070	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	100	102	12,913	2030/11/25
FRTR 0 3/4 05/25/52	0.75	100	107	13,548	2052/5/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	324	41,004	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	329	41,639	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	237	29,949	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	130	16,534	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	234	29,595	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	119	15,041	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	107	13,634	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	105	13,350	2023/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	129	16,325	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	218	27,618	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	141	17,891	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	253	32,077	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	315	39,852	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	243	30,779	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	170	21,529	2045/5/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	213	26,942	2055/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	170	21,513	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	169	21,471	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	113	14,369	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	299	37,868	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	171	21,647	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	132	16,690	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	187	23,691	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/27	—	100	102	12,922	2027/1/15
NETHER 0 1/2 07/15/26	0.5	100	106	13,448	2026/7/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	109	13,836	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	135	17,089	2033/1/15
NETHER 2 3/4 01/15/47	2.75	100	175	22,205	2047/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	183	23,215	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	169	21,460	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	143	18,120	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	116	14,705	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	200	203	25,675	2025/1/31
SPGB 0 04/30/23	—	100	101	12,777	2023/4/30
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	101	12,857	2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	105	13,272	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	212	26,870	2027/7/30
SPGB 1 1/4 10/31/30	1.25	100	110	13,990	2030/10/31
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	108	13,749	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	109	13,793	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	111	14,064	2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	110	14,013	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	119	15,123	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	112	14,161	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	235	29,704	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	112	14,162	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	111	14,144	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	124	15,779	2033/7/30
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	147	18,640	2046/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	157	19,879	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	113	14,359	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	176	22,349	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	116	14,665	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	178	22,558	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	162	20,571	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	140	17,749	2028/10/31

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	106	13,454	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	148	18,777	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	103	13,094	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	12,941	2023/10/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	107	13,620	2027/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	108	13,742	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	113	14,318	2031/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	130	16,483	2047/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	181	22,907	2045/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	180	22,794	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	108	13,674	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	172	21,850	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	143	18,180	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	—	100	101	12,775	2022/9/20
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	107	13,618	2029/2/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	107	13,627	2026/10/20
RAGB 1 1/2 02/20/47	1.5	100	135	17,183	2047/2/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	106	13,481	2023/10/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	172	21,830	2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	169	21,442	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	107	13,606	2028/9/15
RFBG 1 1/8 04/15/34	1.125	100	117	14,849	2034/4/15
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	121	15,305	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	104	13,198	2030/10/18
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	117	14,838	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	116	14,723	2031/3/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	125	15,807	2025/3/13
ユ ー ロ 計				3,039,301	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	100	14,277	2026/1/30
UKT 0 1/8 01/31/23	0.125	100	100	14,265	2023/1/31
UKT 0 5/8 06/07/25	0.625	100	102	14,620	2025/6/7
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	93	13,225	2050/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	103	14,706	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	114	16,312	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	107	15,265	2027/7/22

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(イギリス) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 1 1/4 10/22/41	1.25	100	108	15,357	2041/10/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	200	206	29,286	2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	116	16,514	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	111	15,809	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	109	15,546	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	106	15,078	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	157	22,324	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	206	29,367	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	149	21,290	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	179	25,515	2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	173	24,694	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	152	21,633	2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	100	160	22,876	2039/9/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	38	5,474	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	163	23,276	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	178	25,318	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	186	26,465	2049/12/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	143	20,337	2030/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	142	20,256	2032/6/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,064	2028/12/7
小 計				501,162	
(スウェーデン) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	100	100	1,254	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	200	212	2,654	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	200	213	2,668	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	300	315	3,948	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	200	213	2,674	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	200	224	2,802	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	154	1,933	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	300	315	3,948	2022/6/1
小 計				21,885	
(ノルウェー) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	103	1,268	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	105	1,289	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	104	1,276	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	100	106	1,296	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	100	102	1,257	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	100	107	1,314	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	300	311	3,805	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	200	215	2,630	2024/3/14
小 計				14,139	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(デンマーク) 国債証券	%	千クローナ	千クローナ	千円	
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	300	320	5,451	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	400	432	7,354	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/22	0.25	200	203	3,449	2022/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	200	212	3,601	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	222	3,780	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	400	752	12,785	2039/11/15
小 計				36,422	
(ポランド) 国債証券		千ゾロツクス	千ゾロツクス		
POLGB 0 07/25/22	—	200	199	5,548	2022/7/25
POLGB 0 3/4 04/25/25	0.75	100	101	2,827	2025/4/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	200	209	5,838	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	107	2,987	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	200	220	6,151	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	111	3,096	2027/7/25
POLGB 2 1/4 10/25/24	2.25	100	107	2,995	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	100	113	3,147	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	200	227	6,330	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	112	3,135	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	109	3,050	2022/9/23
小 計				45,108	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 0 1/2 09/21/26	0.5	100	99	8,016	2026/9/21
ACGB 0 1/4 11/21/25	0.25	100	99	7,974	2025/11/21
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	207	16,649	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	100	8,051	2032/5/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	100	99	7,955	2030/12/21
ACGB 1 3/4 06/21/51	1.75	100	90	7,298	2051/6/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	113	9,089	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	110	8,878	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	200	217	17,410	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	227	18,266	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/28	2.75	200	229	18,399	2028/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	115	9,247	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	118	9,542	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	112	9,028	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	118	9,534	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	100	137	10,989	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	119	9,609	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	112	8,984	2023/4/21
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	108	8,689	2022/7/15
小 計				203,616	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨換算金額	償還年月日
(シンガポール) 国債証券	%	千円	千円	千円	
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	113	8,868	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	108	8,461	2026/6/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	233	18,258	2027/3/1
小 計				35,588	
(マレーシア) 国債証券		千円	千円		
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	99	2,544	2031/4/15
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	103	2,648	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	106	2,733	2027/5/31
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	105	2,705	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	104	2,668	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	102	2,626	2022/3/10
MGS 3.885 08/15/29	3.885	100	108	2,794	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25	3.955	100	108	2,773	2025/9/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	107	2,748	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	110	2,840	2026/4/15
MGS 4.498 04/15/30	4.498	100	114	2,925	2030/4/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	111	2,857	2046/3/15
MGS 4.762 04/07/37	4.762	100	114	2,928	2037/4/7

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額	外貨換算金額	償還年月日
(マレーシア) 国債証券	%	千円	千円	千円	
MGS 5.248 09/28	5.248	100	118	3,038	2028/9/15
小 計				38,834	
(イスラエル) 国債証券		千円	千円		
ILGOV 1 03/31/30	—	100	102	3,247	2030/3/31
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	107	3,409	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	200	222	7,058	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	112	3,585	2028/9/28
ILGOV 3 3/4 03/31/47	—	100	140	4,459	2047/3/31
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	112	3,571	2023/3/31
ILGOV 5 1/2 01/31/22	—	100	105	3,347	2022/1/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	169	5,372	2042/1/31
小 計				34,051	
合 計				7,306,175	

(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) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証
券等の組み入れはありません。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

運用報告書 第20期（決算日 2020年3月23日）

（計算期間 2019年3月21日～2020年3月23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	純総資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
16期(2016年3月22日)	10,430	△11.6	1,369.93	△13.3	98.5	1.6	131,902
17期(2017年3月21日)	12,166	16.6	1,563.42	14.1	97.2	2.1	79,920
18期(2018年3月20日)	13,619	11.9	1,716.29	9.8	93.8	6.2	68,511
19期(2019年3月20日)	13,116	△3.7	1,614.39	△5.9	94.9	4.8	40,598
20期(2020年3月23日)	10,786	△17.8	1,292.01	△20.0	92.3	5.2	24,339

（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TOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○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
		騰 落 率				
(期 首) 2019年3月20日	円	%		%	%	%
	13,116	—	1,614.39	—	94.9	4.8
3月末	13,071	△ 0.3	1,591.64	△ 1.4	93.7	6.3
4月末	13,287	1.3	1,617.93	0.2	93.8	6.2
5月末	12,426	△ 5.3	1,512.28	△ 6.3	95.6	6.8
6月末	12,768	△ 2.7	1,551.14	△ 3.9	93.6	6.4
7月末	12,881	△ 1.8	1,565.14	△ 3.1	92.6	7.4
8月末	12,447	△ 5.1	1,511.86	△ 6.4	92.9	7.1
9月末	13,202	0.7	1,587.80	△ 1.6	92.8	7.2
10月末	13,860	5.7	1,667.01	3.3	93.0	7.4
11月末	14,125	7.7	1,699.36	5.3	92.6	7.4
12月末	14,331	9.3	1,721.36	6.6	97.0	2.9
2020年1月末	14,033	7.0	1,684.44	4.3	96.8	3.2
2月末	12,595	△ 4.0	1,510.87	△ 6.4	95.3	4.9
(期 末) 2020年3月23日	10,786	△17.8	1,292.01	△20.0	92.3	5.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2019年3月21日～2020年3月23日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：13,116円

期 末：10,786円

騰落率：△17.8%

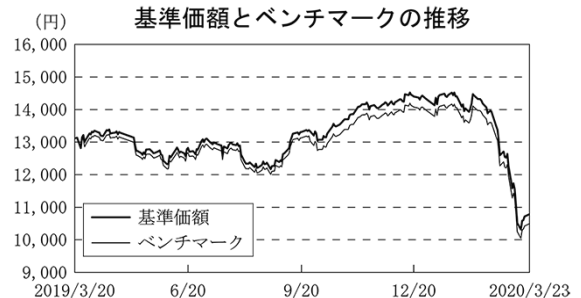
◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・期中、米中の貿易問題の対立が緩和し、企業業績の改善期待が高まったこと
- ・各国中央銀行の金融緩和姿勢の継続

マイナス要因

- ・期前半、米中貿易摩擦が激化したこと
- ・新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念



(注) ベンチマークは、期首(2019年3月20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、TOPIX(東証株価指数)です。

■投資環境

当期、国内株式市場は、米中貿易協議の進展期待から上昇して始まりましたが、米国による対中追加関税の実施や円高の進行が嫌気されて2019年8月まで下落基調となりました。9月に入り、米中貿易協議再開の観測やECB(欧州中央銀行)による量的金融緩和の再開などを受けて国内株式市場は大きく持ち直しました。

10月以降も米中貿易問題が好転の様相を見せたことで、世界経済の先行きに対して楽観的な見方が広がり、国内株式市場の上昇は続きました。また、FRB(米連邦準備制度理事会)が予想通り利下げを実施したことや、為替市場が円安傾向で推移したことも追い風となりました。

2020年1月中旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念から、国内株式市場は下落に転じ、期末にかけては、欧州・米国でも新型コロナウイルスの感染が拡大したことや原油価格の下落などが悪材料視されて、急落しました。

■ポートフォリオについて

日本の株式市場全体への投資を目的とし、TOPIX(東証株価指数)に連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、市場でのウェイトが一定以上の銘柄についてはそのウェイト通り組み入れ、一定以下の銘柄については当社独自の業種分類と時価総額による規模分類に基づいて選定します。これにより、業種配分および企業規模などの特性がファンド全体でTOPIXとほぼ一致するよう調整しています。

期首の保有銘柄数は1,084銘柄でしたが、期中は設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、期末における保有銘柄数は1,083銘柄となりました。なお、実質的な株式の組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は17.8%下落しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は△17.8%となり、ベンチマークであるTOPIXの騰落率△20.0%にほぼ連動しました。

また、ベンチマークであるTOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラー[※]は、過去1年で1.4%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・配当金収入

マイナス要因

- ・特にありません。

※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。

○今後の運用方針

引き続き、基本方針に基づき、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、TOPIXとの連動性を高位に保つことを目指して運用します。

○1万口当たりの費用明細

(2019年3月21日～2020年3月23日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.008	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.008)	
合 計	1	0.008	
期中の平均基準価額は、13,252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

(2019年3月21日～2020年3月23日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,551 (353)	千円 2,704,336 (-)	千株 6,758	千円 13,052,172

(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。

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
国 内	株式先物取引	百万円 25,696	百万円 26,176	百万円 2,874	百万円 2,872

○株式売買比率

(2019年3月21日～2020年3月23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	15,756,508千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	32,816,954千円
(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

(2019年3月21日～2020年3月23日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 16	百万円 104	百万円 202

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2020年3月23日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	21.9	16	7,360
マルハニチロ	3.4	2.5	5,342
サカタのタネ	2.7	2	6,040
ホクト	2.4	1.9	3,391
鉱業 (0.2%)			
国際石油開発帝石	90.6	66.6	34,432
石油資源開発	3.3	2.3	3,728
K&Oエナジーグループ	3	2.8	4,121
建設業 (2.6%)			
ショーバンドホールディングス	1.7	2.2	8,261
ミライト・ホールディングス	5.9	4.3	5,310
ベステラ	3.8	3	2,478
安藤・間	14.1	10.3	6,303
東急建設	7.9	1.7	860
コムシスホールディングス	8.2	5.9	13,652
ミサワホーム	6.6	—	—
東建コーポレーション	1	0.7	5,166
ヤマウラ	6.7	5.4	4,806
大成建設	18.6	12.9	36,816
大林組	56.5	39.2	31,085
清水建設	57.7	40.2	30,150
長谷工コーポレーション	22.9	17.4	19,261
鹿島建設	43.4	30.8	30,091
西松建設	4	2.7	5,518
三井住友建設	13.7	10.3	4,604
前田建設工業	13.5	9.9	7,048
奥村組	3	2.1	4,487
東鉄工業	2.8	2	5,814
戸田建設	22.5	17.5	10,325
熊谷組	2.7	1.8	4,030
大東建託	6.6	4.5	45,472
N I P P O	5.1	3.6	7,768
前田道路	5.8	4.1	9,003

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東亜建設工業	4.8	3.8	5,069
五洋建設	22.1	16.5	7,788
住友林業	12.9	9.3	11,122
日本基礎技術	14.5	0.5	183
大和ハウス工業	51.6	38.4	90,873
積水ハウス	57.1	42.5	72,377
北陸電気工事	5.8	4.4	4,114
中電工	3.4	2.4	5,260
関電工	8.1	6	4,854
きんでん	12.6	9.2	13,588
日本電設工業	3.6	2.7	5,599
協和エクシオ	7.2	5	11,480
新日本空調	4.2	3.8	7,296
九電工	3.7	2.5	6,695
三機工業	6.8	5.1	5,717
日揮ホールディングス	16.3	11.9	9,032
中外炉工業	2.9	2.3	3,302
ヤマト	7.8	6.5	3,497
高砂熱学工業	4.9	3.5	5,558
三晃金属工業	1.8	0.8	1,596
大気社	2.5	1.8	5,805
日比谷総合設備	4.5	3.5	6,492
東芝プラントシステム	3.9	—	—
OSJ Bホールディングス	25.7	12.8	2,892
東洋エンジニアリング	8	2.6	715
レイズネクスト	5.9	1.7	1,927
食料品 (4.3%)			
日本製粉	5.3	3.4	5,514
日清製粉グループ本社	19.1	13.8	21,666
鳥越製粉	6	6.3	4,800
日本甜菜製糖	3.3	3	5,022
三井製糖	2.2	0.6	1,177
森永製菓	4.3	3	11,925
江崎グリコ	5	3.4	15,045

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山崎製パン	13.7	10.2	22,368
亀田製菓	1.6	1.1	4,818
寿スピリッツ	1.8	1.3	5,291
カルビー	7.5	5.6	14,403
森永乳業	3.2	2.5	8,600
ヤクルト本社	12.4	8.5	49,810
明治ホールディングス	11.8	8.2	57,482
雪印メグミルク	4	2.7	5,629
プリマハム	2.8	2.3	5,004
日本ハム	7.3	4.8	15,120
丸大食品	2.8	2.2	4,103
S F o o d s	1.7	2.2	4,556
伊藤ハム米久ホールディングス	11.6	9	5,535
サッポロホールディングス	6	4.3	7,628
アサヒグループホールディングス	35	26	84,786
キリンホールディングス	75.5	52.8	112,305
宝ホールディングス	12.8	9.4	6,363
オエノンホールディングス	16.3	10.4	3,972
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12.8	9.4	20,163
サントリー食品インターナショナル	11.3	8.3	33,490
ダイドーグループホールディングス	1.3	0.9	3,105
伊藤園	5.5	3.7	18,722
キーコーヒー	2.9	1.9	4,440
ユニカフェ	4	4	3,420
ジャパンフーズ	4.3	3.8	4,575
日清オイリオグループ	2.4	1.8	5,967
不二製油グループ本社	4.2	2.9	6,942
Jーオイルミルズ	1.3	0.8	3,220
キッコーマン	11.1	8.9	35,600
味の素	36.9	27.4	47,237
キュービー	9.4	6.8	14,123
ハウス食品グループ本社	6.3	4.4	14,278
カゴメ	6.7	4.7	12,760
アリアケジャパン	1.5	1.1	6,578
ニチレイ	8.6	6.3	16,134
東洋水産	8.6	6.3	30,429
日清食品ホールディングス	7.2	5.3	44,891
フジッコ	3	2.2	4,292

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ロック・フィールド	5.1	4.2	6,090
日本たばこ産業	96.5	71.5	136,207
ユーグレナ	10.5	7.8	4,641
繊維製品 (0.6%)			
片倉工業	5.5	4.6	3,588
グンゼ	1.5	0.5	1,780
東洋紡	6.6	5	4,770
倉敷紡績	2.7	1.9	4,368
日本毛織	8.3	6.2	5,127
帝国繊維	3.1	2.1	3,847
帝人	13.6	9.4	15,406
東レ	126.4	86.6	36,068
日本フェルト	12.7	9.2	3,910
セーレン	4.4	2.9	3,526
小松マターレ	8	7.2	5,191
ワコールホールディングス	4.6	3.1	7,049
ホギメディカル	2.4	1.5	4,890
T S I ホールディングス	10.2	4.5	1,755
三陽商会	2.8	2.8	3,791
オンワードホールディングス	10.7	7.8	3,354
ゴールドウイン	1.5	2.1	13,524
デサント	3.9	3.5	3,675
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	1.7	1.2	4,374
王子ホールディングス	73.9	52	27,300
日本製紙	7.8	5.5	7,947
三菱製紙	8.8	2.6	884
北越コーポレーション	12.6	5.6	2,038
大王製紙	7.5	5.5	7,920
レンゴー	17.2	12.4	9,548
ザ・バック	1.9	1.3	4,491
化学 (7.4%)			
クラレ	27.8	20.5	20,479
旭化成	116.1	80.7	53,907
共和レザー	5.2	4.8	3,115
昭和電工	10.9	8.7	17,226
住友化学	129.4	93.8	26,451
日産化学	10.1	6.7	20,133

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クレハ	1.6	1.1	4,356
石原産業	5.8	0.6	306
片倉コープアグリ	4.2	3.6	3,978
日本曹達	3	2.1	4,798
東ソー	25.5	18.8	20,059
トクヤマ	4.7	3.1	5,514
セントラル硝子	3.3	2.5	4,375
東亜合成	10.5	7.7	6,799
大阪ソーダ	2.5	1.9	4,774
デンカ	6.3	4.5	9,144
信越化学工業	28.7	20.8	186,305
堺化学工業	3.6	2.1	3,355
エア・ウォーター	13.6	9.9	12,543
大陽日酸	13.7	10.7	14,883
日本パーカライジング	8.7	6.3	6,470
ステラ ケミファ	2.2	1.2	2,732
日本触媒	2.8	2.1	9,492
カネカ	4.3	2.9	6,896
三菱瓦斯化学	16.5	12.2	13,566
三井化学	15	11	22,110
J S R	16.8	12.5	19,325
東京応化工業	2.7	1.9	6,754
三菱ケミカルホールディングス	109.1	80.9	48,604
KHネオケム	2.9	2.1	2,660
ダイセル	25.5	18.6	13,447
住友ベークライト	2.7	1.8	3,817
積水化学工業	35.9	26.1	33,799
日本ゼオン	15	11	7,766
アイカ工業	4.9	3.3	9,692
宇部興産	8.3	6	9,288
旭有機材	3.5	2.8	3,463
日立化成	8	5.6	24,388
タイガースポリマー	5.8	4.6	1,835
ミライアル	4.5	2.8	2,293
日本化薬	10.9	7.2	6,300
A D E K A	7.8	5.6	6,557
日油	6.3	4.6	14,973
ハリマ化成グループ	5.6	4.7	4,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
花王	40.4	29.6	231,945
ニイタカ	2.8	0.7	1,576
三洋化成工業	1.1	3.8	13,224
日本ペイントホールディングス	13.4	10	53,500
関西ペイント	18.5	13.6	27,132
中国塗料	7.6	2.6	1,991
太陽ホールディングス	2	1.9	7,182
D I C	7.4	5.3	10,499
サカタインクス	4.7	3.5	2,719
東洋インキ S C ホールディングス	3.3	2.4	4,442
富士フイルムホールディングス	34.6	23.7	110,299
資生堂	33	24.6	139,408
ライオン	23.4	16.1	35,001
高砂香料工業	1.8	1.3	2,112
マンダム	3.6	2.8	5,476
ミルボン	2	1.5	7,770
ファンケル	7.2	5.4	12,463
コーセー	2.8	2.3	28,290
コタ	3.1	4.2	5,787
ポーラ・オルビスホールディングス	7.2	5	9,740
ノエビアホールディングス	1.5	0.9	4,644
エステー	3.3	2.9	4,077
長谷川香料	3.6	2.8	5,426
小林製薬	4.6	3.5	34,965
荒川化学工業	4.4	4	4,396
メック	5	5.1	6,339
タカラバイオ	4.2	3	5,697
アース製薬	1.4	1	5,200
大成ラミック	1.4	1.6	3,940
クミアイ化学工業	11.2	10.5	7,318
日本農薬	10.6	4.3	1,642
日東電工	12.5	8.5	36,167
レック	2.4	1.9	1,778
前澤化成工業	3.2	3.8	3,332
エフビコ	1.3	1.3	9,282
天馬	3.1	2.7	4,554
信越ポリマー	9.6	5.2	3,645
ニフコ	6.5	4.7	9,244

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バルカー	2.1	1.6	2,556
ユニ・チャーム	35.3	23.9	85,920
医薬品 (6.4%)			
協和キリン	21	12.5	26,112
武田薬品工業	143.5	102.9	309,934
アステラス製薬	153.5	108.4	157,180
大日本住友製薬	12.4	9.1	11,011
塩野義製薬	21.8	15.8	75,002
田辺三菱製薬	17.5	—	—
あすか製薬	6.1	3.7	3,984
日本新薬	4.3	3.2	23,424
中外製薬	17.4	12.8	155,072
科研製薬	2.9	2.2	9,977
エーザイ	19.9	14.8	98,938
ロート製薬	8.5	6	18,180
小野薬品工業	39.3	28.6	59,287
久光製薬	4.9	3.3	15,493
持田製薬	1.3	1.6	6,568
参天製薬	31.9	23	39,997
ツムラ	5.2	3.7	9,812
日医工	5	3.8	4,917
キッセイ薬品工業	2.8	2.1	5,008
生化学工業	4.6	4.1	4,305
栄研化学	2.9	2.2	3,896
鳥居薬品	3.4	1.5	3,396
J C Rファーマ	1.3	0.8	6,528
東和薬品	1	1.9	3,988
沢井製薬	3.4	2.3	12,144
ゼリア新薬工業	3.8	3	5,712
第一三共	47.6	35.4	237,604
キョーリン製薬ホールディングス	4.3	3	5,958
大幸薬品	2.8	3.5	14,647
大塚ホールディングス	31.7	23.5	80,816
大正製薬ホールディングス	3.7	2.6	16,432
ペプチドリーム	7.7	6.2	24,180
石油・石炭製品 (0.5%)			
昭和シェル石油	15.6	—	—
ニチレキ	6.9	5.6	7,487

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
出光興産	13	13.9	33,554
J X T Gホールディングス	282.6	186.6	62,716
コスモエネルギーホールディングス	4.7	3.3	4,603
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	9.6	6.8	8,364
TOYO TIRE	8.4	6.6	6,336
ブリヂストン	51.1	35.4	109,209
住友ゴム工業	14.9	10.8	10,000
オカモト	1.3	0.7	2,422
ニッタ	2.1	1.4	2,531
住友理工	8.6	4.3	2,193
パンドー化学	4.4	3.7	2,123
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	3.1	1.6	6,272
A G C	16.8	12.2	28,609
日本山村硝子	2.4	3.2	2,572
日本電気硝子	7.2	5.1	6,696
住友大阪セメント	3.4	2.3	7,256
太平洋セメント	10.5	7.6	13,079
日本ヒューム	5.8	6.4	3,782
東海カーボン	15.1	11.6	9,662
東洋炭素	2.7	3.4	4,647
T O T O	12.9	8.8	27,808
日本碍子	20.5	14.8	18,396
日本特殊陶業	14.1	10.4	14,008
ニチアス	4.4	3.1	5,849
ニチハ	2.7	1.6	2,884
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	76.5	54.9	49,887
神戸製鋼所	30.2	22.3	7,582
合同製鐵	2.3	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	44.5	32.9	23,490
東京製鐵	9.3	4.1	2,800
共英製鋼	2.2	1.4	1,744
大和工業	3.4	2.3	4,087
大阪製鐵	3	1.6	1,643
淀川製鋼所	3.2	2.3	3,967
丸一鋼管	5.8	4.2	11,079

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大同特殊鋼	2.7	2	6,520
山陽特殊製鋼	3	0.1	89
愛知製鋼	1	0.6	1,609
日立金属	18.1	12.9	13,196
大太平洋金属	1.3	0.9	1,342
新日本電工	26.8	12.7	1,714
三菱製鋼	3.2	3.8	2,679
シンニッタン	12	8.3	1,792
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	46.3	36.6	5,599
三井金属鉱業	4.2	3.3	5,293
東邦亜鉛	1.4	1.9	2,283
三菱マテリアル	10.8	7.7	16,277
住友金属鉱山	22.5	15.6	31,519
DOWAホールディングス	4	2.6	6,435
古河機械金属	4.5	3.6	3,657
UACJ	2.9	2.5	3,507
古河電気工業	4.7	3.2	5,625
住友電気工業	61.5	45.6	47,606
フジクラ	19	12.9	3,728
タツタ電線	11.6	7.1	3,145
リョービ	2.9	2.4	2,724
アサヒホールディングス	3.7	—	—
金属製品 (0.6%)			
トーカロ	6.4	3.2	2,569
SUMCO	18.1	13.9	15,526
東洋製織グループホールディングス	10.4	7.5	8,295
コロナ	4.1	3.8	3,613
横河ブリッジホールディングス	4.4	2.9	4,982
駒井ハルテック	1.8	1.8	2,678
三和ホールディングス	16.5	12.1	8,397
文化シヤッター	7.7	3.3	2,550
三協立山	6	4.7	4,845
LIXILグループ	24.6	18	20,232
ノーリツ	4.2	6.9	7,182
長府製作所	2.8	2.2	5,167
リンナイ	3	2	14,000
日東精工	8	9.1	3,985

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東プレ	3.3	2.7	2,967
高周波熱錬	7.8	3.8	2,371
パイオラックス	2.8	2.8	3,847
日本発條	16.8	12.2	7,869
三益半導体工業	4.6	4.2	6,140
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	5.2	3.6	3,711
三浦工業	7	5	17,175
タクマ	5.9	4.5	5,035
オークマ	2.1	1.1	3,235
東芝機械	3	0.4	772
アマダホールディングス	26	16.3	13,072
アイダエンジニアリング	7.6	5.7	3,716
F U J I	5	4.1	6,424
牧野フライス製作所	1.9	1.3	3,325
オーエスジー	8.1	5.9	7,504
旭ダイヤモンド工業	9.2	4.8	2,140
DMG森精機	10.3	7.4	6,327
ディスコ	2.2	1.5	27,810
日東工器	2.9	2.6	4,342
島精機製作所	2.6	1.6	2,176
日阪製作所	7	4.6	3,164
ナプテスコ	8.9	7.3	16,403
SMC	4.9	3.8	152,152
ユニオンツール	1.8	1.8	4,181
オイレス工業	3.2	2.2	2,789
サトーホールディングス	2.9	0.1	190
小松製作所	75.3	56.2	89,498
住友重機械工業	9.4	6.7	12,106
日立建機	6.6	4.6	8,758
巴工業	2.6	2.4	4,221
井関農機	3.3	2.8	2,965
タカキタ	6	6	2,664
クボタ	89.2	65.8	80,506
月島機械	4.8	4.1	4,854
帝国電機製作所	4.6	3.9	3,997
新東工業	6	4.9	3,542
小森コーポレーション	6.5	4.5	3,208

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鶴見製作所	4.1	3.2	6,304
荏原製作所	7.2	5.2	9,063
西島製作所	6.4	5.9	4,478
ダイキン工業	22.7	15.7	197,035
栗田工業	8.9	6.3	14,464
椿本チエイン	2.1	1.3	2,975
ダイフク	9.1	6.3	37,170
タダノ	8.1	5.8	4,176
フジテック	6.3	4.9	6,502
CKD	5.1	3.7	4,029
平和	4.7	3.2	6,220
SANKYO	4.2	3	9,015
日本金銭機械	5.8	4.3	2,399
フクシマガリレイ	1.4	1	3,285
竹内製作所	4	1.3	1,561
アマノ	4.8	3.3	7,408
グローリー	4.7	4	9,076
大和冷機工業	7.1	4.7	3,858
セガサミーホールディングス	16.8	12.3	15,227
リケン	1.2	0.7	1,731
ホシザキ	4.9	3.6	29,160
大豊工業	4.8	3.7	1,850
日本精工	34.6	25.9	16,472
NTN	38.4	30.5	5,459
ジェイテクト	16.6	12.1	7,865
不二越	1.5	1.2	2,839
日本トムソン	9.5	5	1,665
THK	10.5	7.7	15,261
ユーシン精機	5.2	4	2,776
キッツ	7.8	7.1	4,096
マキタ	20.2	16	44,656
日立造船	16	10.7	3,498
三菱重工業	27.9	20.8	55,702
I H I	12.9	9.4	11,176
スター精密	4.1	5.2	5,142
電気機器 (13.8%)			
日清紡ホールディングス	9.2	7.1	4,181
イビデン	10.1	7.3	13,840

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コニカミノルタ	37	27.3	11,466
ブラザー工業	21.4	15.3	22,338
ミネベアミツミ	30.5	22.9	31,716
日立製作所	74.9	59.4	156,489
三菱電機	166	123.2	145,068
富士電機	10.8	7.9	15,997
安川電機	19.4	13.4	34,036
明電舎	4.7	3.3	4,603
東芝テック	3.1	2.4	7,488
マブチモーター	4.5	3.3	10,131
日本電産	20	14.9	153,172
東光高岳	3.4	3.2	2,864
ダイヘン	2.5	1.6	4,168
日新電機	6.5	3	2,388
オムロン	17.8	11.1	55,000
日東工業	4	2.5	3,927
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.8	4.4	5,460
メルコホールディングス	2.2	1.6	3,136
テクノメディカ	2.5	1.8	3,231
日本電気	21.7	15	52,875
富士通	16	11.9	100,376
神電気工業	6.9	5.2	5,127
サンケン電気	2.5	2.4	4,288
アイホン	3.1	2.8	4,009
ルネサスエレクトロニクス	17.1	58.8	20,050
セイコーエプソン	21	15.5	16,554
ワコム	16.7	4.7	1,363
アルパック	3.7	2.6	6,089
E I Z O	1.8	1.2	3,171
日本信号	6.7	5.3	5,363
能美防災	2.8	2.1	3,437
ホーチキ	2.9	3.5	4,424
エレコム	—	1.3	4,582
パナソニック	190.2	140.5	101,244
シャープ	16.5	11.6	10,938
アンリツ	11.1	8	15,336
富士通ゼネラル	5.8	4	6,880
ソニー	111.5	77.9	456,961

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T D K	8.7	6	44,100
アルプスアルパイン	17.9	10.8	9,720
日本トリム	0.9	0.1	255
フォスター電機	5.6	3.4	2,988
ヨコオ	3.9	2.4	5,037
ホシデン	6.7	4.2	3,003
ヒロセ電機	2.4	1.6	17,504
日本航空電子工業	5.2	3.5	3,703
アイコム	2.6	2.2	5,533
船井電機	8.3	6.2	2,306
横河電機	16.9	12.6	13,633
アズビル	10.5	8	21,688
日本光電工業	7.2	5.3	17,066
堀場製作所	3.2	2.4	11,292
アドバンテスト	11.1	9.1	34,125
キーエンス	8.2	11.2	364,784
日置電機	2.2	1.2	3,352
シスメックス	13	8.8	59,998
OBARA GROUP	1.8	0.8	1,840
コーセル	6.3	3.6	3,236
イリソ電子工業	1.6	1.1	3,228
オブテックスグループ	3.4	3.5	3,199
千代田インテグレ	2.3	2.6	3,970
レーザーテック	3.5	5.4	24,462
スタンレー電気	11.6	8.3	16,102
ウシオ電機	10.4	7.1	7,426
日本セラミック	2.6	1.3	2,286
図研	4.9	2.7	5,130
日本電子	—	2.5	4,797
カシオ計算機	14.5	10.5	14,217
ファナック	15.8	11.9	156,663
ローム	8	5.5	30,580
浜松ホトニクス	12	8.8	36,256
三井ハイテック	5	3.5	3,500
新光電気工業	8.6	6.1	4,849
京セラ	25.2	17.4	99,893
太陽誘電	7.7	5	12,490
村田製作所	17.4	36.2	176,475

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
双葉電子工業	3.8	3	2,964
ニチコン	6.3	1.8	1,080
日本ケミコン	2.1	1.7	1,909
K O A	4.1	3.3	2,696
小糸製作所	10	7.5	23,137
ミツバ	8.5	7.8	2,940
S C R E E Nホールディングス	3	2.1	7,003
キャノン電子	4.3	2.6	3,564
キャノン	89.6	66.4	148,005
リコー	50.6	32.1	23,786
象印マホービン	—	3.5	5,019
東京エレクトロン	11.1	8.2	140,302
輸送用機器 (7.5%)			
トヨタ紡織	5.5	3.9	4,481
ユニプレス	3.7	2.3	2,116
豊田自動織機	13.4	10	45,700
モリタホールディングス	3.8	2.6	3,806
デンソー	36.9	27.2	85,462
東海理化電機製作所	4.5	2.5	3,090
三井E&Sホールディングス	6.9	—	—
川崎重工業	13.1	9.5	13,775
日産自動車	196.4	144.6	52,836
いすゞ自動車	52.3	38.4	24,368
トヨタ自動車	185.4	137.9	851,118
日野自動車	20.4	14.9	7,733
三菱自動車工業	62.3	45.6	13,132
武蔵精密工業	4	2.9	2,018
日産車体	8.4	3.3	2,461
新明和工業	7.6	5	5,675
極東開発工業	4.8	3	3,213
日信工業	4.9	4	8,440
トビー工業	2.2	1.3	1,671
ティラド	2.1	2.4	2,942
N O K	8.8	6.2	6,503
フタバ産業	11.7	2.8	1,136
K Y B	2.7	1.8	3,544
プレス工業	15.5	8.3	1,792
ケーヒン	4	2.9	7,000

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイシン精機	13.7	10.2	23,929
マツダ	52.6	37	21,497
今仙電機製作所	5	6	3,564
本田技研工業	140.3	97.2	215,492
スズキ	30.4	24.5	61,250
S U B A R U	51.6	38.5	74,074
ヤマハ発動機	23.7	16.2	19,099
ショーワ	5.9	3.5	7,525
エクセディ	2.1	4.6	6,711
豊田合成	5.6	3.8	6,410
愛三工業	8.4	7.2	3,038
ヨロズ	4.1	3	2,952
エフ・シー・シー	2.8	2.4	3,374
シマノ	6.7	4.6	69,828
テイ・エス テック	3.9	2.7	6,544
精密機器 (2.5%)			
テルモ	23.5	35.1	109,863
クリエートメディック	4.4	4.4	4,404
島津製作所	21.2	14.9	38,844
ブイ・テクノロジー	0.5	0.8	2,488
東京精密	2.9	2.2	5,592
マニー	2	4.6	12,052
ニコン	29.3	21.9	20,388
トプコン	8.6	6.1	4,257
オリンパス	24.9	68.4	90,288
理研計器	2.7	2.1	4,552
タムロン	4.8	1.8	2,876
H O Y A	33.5	24.7	209,950
朝日インテック	6.1	10.4	28,662
シチズン時計	19.4	15.3	5,171
メニコン	—	1.4	5,775
セイコーホールディングス	3.1	2	3,370
ニプロ	11.9	8.3	8,349
その他製品 (2.5%)			
パラマウントベッドホールディングス	2	1.3	5,330
バンダイナムコホールディングス	17.3	12.8	62,937
アイフィスジャパン	6.1	5	2,810
パイロットコーポレーション	2.8	1.9	5,785

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トッパン・フォームズ	6.7	5.2	3,723
フジシールインターナショナル	3.8	2.8	4,958
タカラトミー	7.6	5.9	4,448
タカノ	4.9	4.5	2,997
大建工業	4.1	5.6	8,372
凸版印刷	23.6	17.5	26,950
大日本印刷	23.3	16.2	32,772
N I S S H A	4.5	4	2,460
アシックス	16.4	12.1	9,486
小松ウオール工業	2.3	2.2	3,942
ヤマハ	9.8	7.3	27,375
クリナップ	6.8	5.7	2,713
ビジョン	10.1	7.5	27,750
キングジム	5.8	5.8	4,669
リンテック	3.8	2.5	5,450
イトーキ	9.9	9.7	3,045
任天堂	10.2	7.6	287,356
三菱鉛筆	2.9	3	3,585
タカラスタンダード	4.1	2.7	4,195
コクヨ	7.6	5.5	7,381
オカムラ	5.8	4.2	3,271
美津濃	2.5	2.5	3,872
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	132.4	98.6	33,622
中部電力	50.7	37.9	53,097
関西電力	67.8	47.7	48,868
中国電力	22.9	17.6	25,766
北陸電力	16.5	12.2	8,637
東北電力	38.6	30.4	29,488
四国電力	15.3	11.2	8,769
九州電力	34.3	25.4	21,869
北海道電力	16.1	12.8	5,376
沖縄電力	3.2	2.1	3,933
電源開発	13.3	9.7	19,846
東京瓦斯	32.6	23.9	55,459
大阪瓦斯	32.5	23.9	44,549
東邦瓦斯	8.2	6	29,940
北海道瓦斯	2.7	3.5	5,243

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	2.8	2.2	5,836
静岡ガス	7.9	5.9	4,873
陸運業 (4.9%)			
東武鉄道	17.7	13	48,360
相鉄ホールディングス	5.7	4.1	11,627
東急	45.5	31.4	52,438
京浜急行電鉄	22.9	16	30,064
小田急電鉄	26.9	18.5	44,585
京王電鉄	9.3	6.4	39,616
京成電鉄	12.4	8.6	26,144
富士急行	2.3	1.8	4,779
東日本旅客鉄道	29.6	21.7	179,632
西日本旅客鉄道	14.9	11	78,562
東海旅客鉄道	14.9	10.3	185,915
西武ホールディングス	21.5	16.2	19,893
西日本鉄道	4.5	3	7,830
近鉄グループホールディングス	15.8	11.7	62,010
阪急阪神ホールディングス	21.1	15.7	57,697
南海電気鉄道	7	5	11,490
京阪ホールディングス	7.1	5.2	24,570
名古屋鉄道	12.6	9.6	29,760
日本通運	6.2	4.5	21,712
ヤマトホールディングス	27.8	20.4	28,437
山九	4.4	3.2	11,760
丸運	17.5	15.6	3,432
センコーグループホールディングス	9.6	7.4	5,942
トナミホールディングス	1	3.7	13,301
ニッコンホールディングス	5.8	4.2	8,496
日本石油輸送	1.6	1	2,540
福山通運	2.2	1.5	5,340
セイノーホールディングス	11.9	8.6	9,563
日立物流	3.5	2.5	5,157
C&Fロジホールディングス	5	4	4,560
九州旅客鉄道	13.3	10.4	33,124
S Gホールディングス	15.1	12.2	29,402
海運業 (0.1%)			
日本郵船	13.4	9.8	12,112
商船三井	9.4	6.8	11,002

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	6.1	1.5	1,093
飯野海運	13.5	8.2	2,287
空運業 (0.4%)			
日本航空	28.9	21.2	41,371
A N Aホールディングス	28.8	21.4	58,892
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	5.3	3.8	7,121
三井倉庫ホールディングス	2.8	2.3	2,964
住友倉庫	5.8	4.4	4,624
東陽倉庫	16.7	15.4	5,097
安田倉庫	6	5.8	4,761
上組	9.8	7.1	12,055
キムラユニティー	3.9	3.9	3,537
キューソー流通システム	1.9	1.8	2,739
近鉄エクスプレス	4.3	3.5	4,998
エーアイティー	5.3	4.7	2,824
情報・通信業 (9.5%)			
N E C ネットエスアイ	3.7	2.5	8,650
システナ	5.8	4.6	6,053
デジタルアーツ	0.9	0.6	2,286
日鉄ソリューションズ	3.5	1.6	4,080
T I S	5.5	4	17,360
ネオス	4.9	0.6	268
電算システム	3.2	0.9	1,559
グリー	11.9	9.1	3,448
コーエーテクモホールディングス	4.1	2.9	7,313
ブレインパッド	1.2	0.2	768
K L a b	6.9	3.1	1,915
ネクソン	41.9	34.3	52,856
エイチーム	3.1	0.9	497
コロプラ	7.7	4.4	3,273
サイバーリンクス	2.8	2.8	2,181
C A R T A H O L D I N G S	3.5	0.3	207
ティーガイア	2.5	2.2	4,188
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	42.3	3	4,497
G M O ペイメントゲートウェイ	2.6	1.8	13,320
ザッパラス	11.6	7.9	2,433
インターネットイニシアティブ	3.1	2.2	6,721

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
L I N E	4.9	3.5	17,535
フェイス	3	3	1,653
野村総合研究所	10.5	17.3	37,714
C E ホールディングス	7.2	3.8	1,523
インテージホールディングス	7.2	6.4	4,691
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3.9	2.8	1,842
フジ・メディア・ホールディングス	17.2	12.8	12,403
オービック	5.6	4.2	54,390
ジャストシステム	—	2	8,630
Zホールディングス	108.2	167.9	49,026
トレンドマイクロ	8.7	5.3	23,293
日本オラクル	2.7	2.3	18,745
フューチャー	4.7	6.4	8,268
C A C H o l d i n g s	7.3	3.6	3,013
S B テクノロジー	3	2	3,750
オービックビジネスコンサルタント	1.6	1.1	4,933
伊藤忠テクノソリューションズ	7.5	5.3	13,917
大塚商会	8.8	6.5	26,780
サイボウズ	12.8	0.9	1,263
電通国際情報サービス	2.9	2.4	7,488
デジタルガレージ	3.2	2.2	5,805
ウェザーニューズ	1.5	1.3	4,361
日本エンタープライズ	18.9	0.1	18
ネットワンシステムズ	5.6	4.2	8,156
アルゴグラフィックス	2.1	2.5	8,175
エイバックス	4.4	4	3,544
日本ユニシス	5.1	3.7	8,931
兼松エレクトロニクス	2.4	1.4	4,459
東京放送ホールディングス	10.8	7.8	10,701
日本テレビホールディングス	15.2	11.3	13,616
テレビ朝日ホールディングス	4.2	3.2	4,876
スカパー J S A T ホールディングス	13.4	12.2	4,257
テレビ東京ホールディングス	1.4	2.9	6,536
日本電信電話	111.7	162	405,000
K D D I	143.8	90.4	263,832
ソフトバンク	128.5	110.4	156,105
光通信	1.9	1.2	19,800
N T T ドコモ	117.2	89.5	287,653

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
GMOインターネット	5.5	4.6	7,488
KADOKAWA	5	3.5	3,790
ゼンリン	3.3	2.7	2,492
松竹	1.1	0.6	7,140
東宝	10.8	7.2	24,876
東映	0.7	0.4	5,360
エヌ・ティ・ティ・データ	44	32.3	30,297
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	1.3	2,745
D T S	2.4	3	5,130
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7.6	5.2	22,152
カプコン	7.1	5.2	15,038
S C S K	4.2	3.2	12,784
アイネス	7.3	6.1	7,082
T K C	2.2	1.9	8,160
富士ソフト	2.4	1.9	6,422
N S D	3.8	4	5,216
コナミホールディングス	6.7	5	13,965
ソフトバンクグループ	68.3	96.1	306,270
卸売業 (5.3%)			
伊藤忠食品	1.2	0.9	3,582
エレマテック	2.1	4.8	3,710
J A L U X	1.7	2	2,590
双日	92.5	69	16,146
アルフレッサ ホールディングス	18.4	13.4	24,857
横浜冷凍	7	8.9	7,849
神戸物産	2.4	4.1	16,215
あい ホールディングス	4	3	3,417
ダイワボウホールディングス	1.5	1	4,630
マクニカ・富士エレホールディングス	5.3	3.7	4,791
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4.9	3.7	4,044
レスターホールディングス	3.1	2.4	3,578
O C H I ホールディングス	3.7	3.1	4,637
T O K A I ホールディングス	8.7	6.7	6,123
シップヘルスケアホールディングス	3.5	2.5	9,487
明治電機工業	2.8	2.8	3,446
コメダホールディングス	3.6	2.7	4,514
エコートレーディング	8.7	7.4	3,307
ナガイレーベン	2.5	1.8	4,660

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱食品	2.9	2.1	5,338
松田産業	3.9	4.5	5,233
第一興商	2.4	1.8	5,247
メディバルホールディングス	17.5	13.1	24,339
アズワン	1.2	0.7	6,160
尾家産業	3.3	3.2	3,664
ドウシシャ	4.7	3.2	3,718
丸文	8.2	5.2	2,376
橋本総業ホールディングス	3.1	2.7	4,382
日本ライフライン	4.9	3.1	3,521
進和	3.3	3.5	5,477
オーハシテクニカ	3.4	3.1	3,986
白銅	3	2.4	2,899
伊藤忠商事	114.7	84.9	178,332
丸紅	161.9	127.2	68,484
長瀬産業	9.6	7	8,736
豊田通商	18.4	13.5	29,889
兼松	6.8	5.3	5,575
三井物産	135.2	107.2	157,423
日本紙パルプ商事	1.6	1.1	3,235
日立ハイテク	5.1	4.2	33,096
山善	7.6	5	4,490
住友商事	97	77.1	92,404
内田洋行	2.4	1	2,985
三菱商事	115	85.3	194,398
キャノンマーケティングジャパン	4.5	2.9	5,611
西華産業	3.6	3.9	3,510
菱洋エレクトロ	5.3	3.2	6,374
東京産業	7.6	2.4	1,068
阪和興業	2.9	1.8	2,865
岩谷産業	3.5	2.6	9,321
イワキ	8.6	1.2	450
三菱石油	6.6	5.5	4,675
稲畑産業	4.8	3.9	4,356
ワキタ	6.6	2.3	2,035
東邦ホールディングス	4.8	3.3	7,316
サンゲツ	5.3	3.9	5,795
シナネンホールディングス	2.3	2.7	6,498

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠エネクス	6.7	5.4	4,379
サンリオ	5	3.6	5,130
リョーサン	2.7	1.9	4,409
三信電気	4.8	2.3	2,787
モスフードサービス	2.8	2.2	5,537
加賀電子	3.4	2.9	4,532
立花エレテック	3.7	3.3	4,326
フオーバル	6.8	5.2	5,122
PALTAC	2.9	2	10,000
日鉄物産	1.4	1.3	4,309
トラスコ中山	3.5	2.6	5,837
オートバックスセブン	6.3	4.8	5,899
加藤産業	2.5	1.7	6,035
イノテック	5.6	4.6	3,624
杉本商事	3.1	2.9	4,825
因幡電機産業	2.5	3.2	7,059
ミスミグループ本社	20.3	15.2	29,883
スズケン	7.5	5.4	19,548
ジェコス	4.8	5.3	3,916
小売業 (4.8%)			
ローソン	4.2	2.9	16,269
サンエー	1.3	1	4,300
エービーシー・マート	2.5	1.9	9,804
ハードオフコーポレーション	4.5	4.5	3,154
アスクル	2	2.3	6,046
ゲオホールディングス	3.6	2.9	3,770
アダストリア	3.8	1.7	2,210
ジーフット	5.2	4.1	1,734
エディオン	7	5.3	4,552
あみやき亭	1.7	1.5	4,597
ハニーズホールディングス	5.6	0.2	219
ジンズホールディングス	1.2	0.5	2,895
ビックカメラ	8.7	6.6	5,372
DCMホールディングス	8.9	6.4	6,022
MonotaRO	10.3	8.6	25,344
J. フロント リテイリング	21	15.6	12,901
ドトール・日レスホールディングス	3.8	2.9	4,753
マツモトキヨシホールディングス	6.6	4.9	18,399

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
Z O Z O	17.6	8.7	11,257
トレジャー・ファクトリー	3.8	0.1	58
ココカラファイン	1.9	1.1	5,285
三越伊勢丹ホールディングス	30.6	22.9	14,587
ウエルシアホールディングス	4.3	3.6	25,740
クリエイトSDホールディングス	2.6	2	5,334
シュッピン	4.1	2	1,088
ジョイフル本田	5	3.6	3,938
すかいらーくホールディングス	15.3	13.7	24,098
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5.5	3.6	3,247
ゴルフダイジェスト・オンライン	7.2	5.6	2,419
あさひ	4	3.5	3,930
コスモス薬品	0.8	0.5	11,360
トーエル	3.6	3.6	2,394
セブン&アイ・ホールディングス	68.6	47.7	154,166
薬王堂	1.5	—	—
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	—	7	4,669
ツルハホールディングス	3.5	2.6	33,670
サンマルクホールディングス	3.1	2.3	4,061
トリドールホールディングス	3.1	1.8	4,402
クスリのアオキホールディングス	1.3	1.1	9,306
スシローグローバルホールディングス	1.8	1.1	7,194
カッパ・クリエイト	5.9	3.6	5,122
ライトオン	5.4	0.2	101
良品計画	2.3	17.5	17,692
三城ホールディングス	10.3	6.9	1,559
アドヴァン	6.8	3.9	3,962
G-7ホールディングス	1.8	3.1	6,128
エコス	2.1	2.1	3,198
マルシェ	5.2	4.2	2,595
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	10.7	27.2	48,035
西松屋チェーン	5.1	3.9	2,683
ゼンショーホールディングス	7.9	5.8	11,791
サイゼリヤ	4.4	3.4	7,034
魚力	2.9	2.9	4,210
ユナイテッドアローズ	1.8	1.3	2,046
ハイデイ日高	3.6	2.3	3,339
京都きもの友禅	4.9	3.6	882

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロワイド	5.4	3.8	6,980
壳番屋	1.8	1.2	5,172
スギホールディングス	3.5	2.5	13,200
薬王堂ホールディングス	—	1.3	3,143
スクロール	9	4.4	1,267
ファミリーマート	18.4	9.6	15,264
木曽路	3.2	2.2	5,484
千趣会	12.8	15.6	4,820
ケーヨー	10.4	7.8	3,517
上新電機	2.9	2	3,582
日本瓦斯	2.9	1.9	7,163
ロイヤルホールディングス	3.2	1.8	3,378
いなげや	4.3	2.6	3,949
島忠	3.5	2.4	6,112
チヨダ	2.6	1.9	2,031
ライフコーポレーション	2.1	1.5	3,816
AOKIホールディングス	4.6	2.5	1,852
コメリ	2.7	1.8	3,231
青山商事	3	5	4,730
しまむら	1.9	1.2	8,352
高島屋	12.9	9.4	9,183
松屋	4.4	3.5	2,229
エイチ・ツー・オー リテイリング	8.1	6.3	5,021
パルコ	5	—	—
丸井グループ	13.9	10.9	20,066
アクシアル リテイリング	1.8	0.7	2,495
イオン	63	46.9	100,061
イズミ	3.3	2.2	5,170
平和堂	3.2	3.1	5,059
フジ	2.9	2.3	3,914
ヤオコー	1.8	1.2	7,332
ゼビオホールディングス	4.9	4.2	3,725
ケーズホールディングス	16.6	12.1	13,648
Genky Drug Stores	1.7	1.4	2,536
ブックオフグループホールディングス	4.5	1.1	949
アインホールディングス	2.2	1.7	10,302
ヤマダ電機	50	37	16,835
ニトリホールディングス	7.1	5.3	72,080

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
吉野家ホールディングス	5.7	4.3	8,987
王将フードサービス	1.2	0.9	5,013
ブレナス	4.6	3.2	5,862
ミニストップ	3	2.6	3,621
アークス	2.9	2	3,494
パローホールディングス	3.4	2.4	4,053
ファーストリテイリング	2.2	1.6	65,200
サンドラッグ	6	4.3	12,900
ヤマザワ	2.9	2.4	3,568
ペルーナ	5.8	1.7	731
銀行業 (5.5%)			
めぶきフィナンシャルグループ	86.3	64	13,568
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.8	2.4	2,724
九州フィナンシャルグループ	26.5	19.5	7,780
ゆうちょ銀行	46.7	34.4	34,296
コンソルディア・フィナンシャルグループ	103.1	74	23,532
西日本フィナンシャルホールディングス	10.1	7.3	4,117
関西みらいフィナンシャルグループ	7.5	1.7	637
三十三フィナンシャルグループ	2.5	2.1	2,811
第四北越フィナンシャルグループ	2.7	2	4,310
新生銀行	12.1	8.8	11,334
あおぞら銀行	9.1	6.4	12,652
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,124.2	832.1	330,676
りそなホールディングス	180.1	133.8	41,825
三井住友トラスト・ホールディングス	32.3	23	66,861
三井住友フィナンシャルグループ	115.7	84.4	222,267
千葉銀行	58.6	40.9	19,386
群馬銀行	33.6	25.2	8,089
武蔵野銀行	2.5	2.6	3,231
千葉興業銀行	7.4	—	—
七十七銀行	4.9	3.5	4,291
青森銀行	1	0.4	948
秋田銀行	1.8	1.3	1,865
山形銀行	2.3	1.6	1,880
岩手銀行	1.5	1	2,434
東邦銀行	17.4	8.4	1,932
東北銀行	1.3	0.9	792
ふくおかフィナンシャルグループ	13.2	10.4	14,237

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡銀行	41.6	30.5	20,130
十六銀行	2.7	2.6	4,563
スルガ銀行	—	12.4	4,402
八十二銀行	29.1	27.2	9,792
山梨中央銀行	2.5	1.9	1,307
大垣共立銀行	2.7	2.6	5,348
福井銀行	2.5	2.1	2,866
北國銀行	1.8	1.9	5,766
滋賀銀行	3.1	2.3	5,354
南都銀行	2.4	1.6	3,185
百五銀行	16	15.5	4,154
京都銀行	5.9	4.2	14,427
紀陽銀行	5.7	4	6,052
ほくほくフィナンシャルグループ	10.8	7.6	7,014
広島銀行	24.1	17.7	7,982
山陰合同銀行	9	3.6	1,983
中国銀行	10.8	9.6	8,851
鳥取銀行	0.9	0.9	1,087
伊予銀行	22.4	15.8	7,789
百十四銀行	2.2	2.2	3,949
四国銀行	3.6	5.7	4,354
阿波銀行	2.5	1.3	2,674
大分銀行	0.9	0.6	1,113
宮崎銀行	1.6	1	2,241
佐賀銀行	1.5	2.4	2,688
十八銀行	1.3	—	—
沖縄銀行	1.9	1.3	3,876
琉球銀行	4.1	3.2	3,081
セブン銀行	56.9	42.3	12,055
みずほフィナンシャルグループ	2,231.1	1,650.7	201,385
山口フィナンシャルグループ	20.4	15	8,340
長野銀行	0.9	0.9	1,020
名古屋銀行	1.8	1.1	2,673
北洋銀行	24.1	17.8	3,328
中京銀行	1	1.8	3,526
愛媛銀行	3.8	2.8	3,150
トマト銀行	1.7	1.7	1,671
京業銀行	8.8	4	2,056

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栃木銀行	17	14.3	2,044
トモニホールディングス	14.2	13.2	4,567
フィデアホールディングス	27.9	17	1,666
池田泉州ホールディングス	20.1	10.4	1,612
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	6.1	5.7	2,867
S B I ホールディングス	19.4	13.7	19,522
ジャフコ	2.7	1.9	5,207
大和証券グループ本社	132.5	98	40,768
野村ホールディングス	300.7	213.4	87,344
岡三証券グループ	15	10.2	3,478
丸三証券	6.3	5.1	2,131
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18.8	11	2,497
水戸証券	9.6	7.3	1,197
いちよし証券	5.1	4	1,816
松井証券	8	6.1	4,892
だいこう証券ビジネス	7.7	6.9	3,180
マネックスグループ	17.1	4.2	735
カブドットコム証券	14.8	—	—
極東証券	4.4	3.6	2,102
藍澤証券	5.6	4.9	3,621
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	6.1	4.7	5,654
S O M P O ホールディングス	29	23	65,619
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	42.9	31.8	89,596
ソニーフィナンシャルホールディングス	13.5	9.8	15,464
第一生命ホールディングス	92.8	68.9	80,096
東京海上ホールディングス	59.5	43.6	202,609
T & D ホールディングス	51.1	36.7	28,405
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	4.5	3.1	9,238
クレディセゾン	11.2	8.1	9,258
芙蓉総合リース	1.8	1.3	6,630
みずほリース	3	2.1	4,029
東京センチュリー	3.2	2.4	8,268
日本証券金融	9	4.8	2,308
アイフル	28.4	21	4,746
リコーリース	1.7	1.4	3,703

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イオンフィナンシャルサービス	10.7	8	8,528
アコム	33.9	25.3	10,929
オリエントコーポレーション	51	28.9	3,150
日立キャピタル	3.9	2.9	5,391
オリックス	109.5	76.3	92,132
三菱UFJリース	37.6	27.3	13,431
日本取引所グループ	44.3	35.2	66,563
アサックス	7.4	6.1	3,775
NECキャピタルソリューション	3.2	1.5	2,638
不動産業 (2.0%)			
いちご	23.7	18.1	3,837
ヒューリック	34.8	25.9	24,397
野村不動産ホールディングス	11	8.1	13,089
ユニゾホールディングス	—	1.4	8,232
オープンハウス	2.7	3.1	5,787
東急不動産ホールディングス	43.4	31.9	14,131
飯田グループホールディングス	13.6	9.9	13,325
パーク24	9.5	7	11,165
三井不動産	87	60.2	97,644
三菱地所	115.1	85	115,515
平和不動産	3.7	2.9	7,351
東京建物	18.3	13.6	12,879
ダイビル	6.2	5.2	4,264
京阪神ビルディング	8.1	2.5	2,872
住友不動産	36.9	27.4	64,033
テアオーシー	9.6	6.2	3,273
スターツコーポレーション	2.6	1.9	3,395
空港施設	8	6.1	2,397
ゴールドクレスト	3.8	3.4	5,314
エスリード	3.6	3.5	4,910
A V A N T I A	5.2	4.6	2,359
イオンモール	8.6	6.3	8,360
カチタス	2.8	1.7	5,542
日本空港ビルデング	5.3	3.9	15,327
サービス業 (4.9%)			
日本M&Aセンター	11.7	8.8	22,237
パソナグループ	4.4	5.2	3,920
G C A	6.2	7.3	3,744

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エス・エム・エス	5.8	4.2	8,017
パーソルホールディングス	15.7	12	10,596
クックパッド	15.3	11.6	2,969
学情	2.8	0.9	1,054
スタジオアリス	2.9	1.7	2,465
シミックホールディングス	2.9	1.7	2,337
N J S	3.3	2.5	4,117
総合警備保障	6.4	4.7	22,724
カカココム	12.2	8.7	17,661
アイロムグループ	3.1	1.5	1,843
ディップ	4.1	3.9	6,314
キャリアデザインセンター	2.4	2.5	1,670
ベネフィット・ワン	4.4	3.3	4,247
エムスリー	33.8	25.9	72,079
アウトソーシング	8	4.4	1,685
ディー・エヌ・エー	8.3	6.1	7,069
博報堂DYホールディングス	22.4	16.4	16,022
ぐるなび	9.2	0.2	108
ファンコミュニケーションズ	11.8	10.5	4,074
WDBホールディングス	2.5	2.3	4,381
インフォマート	8.2	12.2	8,381
E P Sホールディングス	3.4	2.8	2,839
クイック	4.5	1.7	1,538
ケネディクス	16.9	11.1	4,417
電通グループ	19.3	12.4	25,916
みらかホールディングス	4.6	3.1	6,634
ダイオーズ	4.4	3.8	3,940
日本空調サービス	7.7	7.6	4,879
オリエンタルランド	18.8	12.4	175,460
ダスキン	4.2	3	8,553
ラウンドワン	6.7	3.8	2,139
リゾートトラスト	6.7	5	5,095
ビー・エム・エル	2.5	2	5,330
りらいあコミュニケーションズ	6.3	5.2	4,570
リソー教育	20.8	4.2	1,087
早稲田アカデミー	3	4.6	3,900
ユー・エス・エス	19.7	14.8	21,608
サイバーエージェント	9.8	6.7	22,847

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
楽天	74.4	55	40,040
テー・オー・ダブリュー	6.7	5.6	2,828
エン・ジャパン	—	1.4	2,553
テクノプロ・ホールディングス	2.9	2.4	11,172
インターワークス	4	4	1,800
ジャパンマテリアル	—	3.2	3,571
キャリアリンク	9.1	0.1	32
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.4	0.7	783
リクルートホールディングス	113.9	85.1	220,409
エラン	4.6	1.3	1,454
日本郵政	130.5	96.2	74,478
MS－J a p a n	2.9	0.9	540
リログループ	8.5	6.6	12,639
エイチ・アイ・エス	2.7	1.8	2,496
共立メンテナンス	2.4	1.5	2,878
建設技術研究所	3.9	6.5	9,938
よみうりランド	1.7	0.9	3,172
東京都競馬	2.2	1.4	3,474
カナモト	2.7	1.9	3,566
東京ドーム	8.1	6.4	4,160
トランス・コスモス	3.8	3.4	5,147
乃村工藝社	3.9	5.5	3,850
日本管財	2.2	3.5	6,055
白洋舎	1.6	1.4	3,346
セコム	16.9	12.5	97,087
セントラル警備保障	1.5	0.8	2,636
メイテック	2.2	1.4	5,523
応用地質	5.6	5.1	5,625
船井総研ホールディングス	3.3	2.5	5,007
ベネッセホールディングス	5.7	4.2	10,143
イオンディライト	2	1.5	4,605
ニチイ学館	7.2	4.7	4,986
ダイセキ	3.4	1.8	3,555
ステップ	3.7	3	3,936
合 計	株 数 ・ 金 額	19,188	14,335
	銘柄数<比率>	1,084	1,083
			<92.3%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	T O P I X	百万円 1, 271	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2020年3月23日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 22, 466, 504	% 92. 0
コール・ローン等、その他	1, 962, 624	8. 0
投資信託財産総額	24, 429, 128	100. 0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	24,879,928,066
コール・ローン等	343,758,053
株式(評価額)	22,466,504,600
未収入金	1,546,972,450
未収配当金	53,864,963
差入委託証拠金	468,828,000
(B) 負債	540,340,692
未払金	35,459,950
未払解約金	54,080,120
未払利息	622
差入委託証拠金代用有価証券	450,800,000
(C) 純資産総額(A-B)	24,339,587,374
元本	22,566,115,300
次期繰越損益金	1,773,472,074
(D) 受益権総口数	22,566,115,300口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,786円

(注) 当親ファンドの期首元本額は30,954,355,870円、期中追加設定元本額は8,734,082,542円、期中一部解約元本額は17,122,323,112円です。

(元本の内訳)

東京海上セレクション・日本株TOPIX	15,903,316,092円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	4,411,796,343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>	514,917,790円
円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>	396,422,471円
円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	351,537,501円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	346,557,059円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	284,691,792円
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	102,306,626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>	75,064,964円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	54,852,689円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	53,833,707円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	39,996,132円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	12,684,638円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	7,043,159円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	4,890,001円
ターゲット・イヤー・ファンド2065(愛称:年金コンパス)	1,989,036円
ターゲット・イヤー・ファンド2055(愛称:年金コンパス)	1,623,919円
ターゲット・イヤー・ファンド2035(愛称:年金コンパス)	1,441,770円
ターゲット・イヤー・ファンド2045(愛称:年金コンパス)	1,149,611円

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

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

(注) 2020年3月23日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。
・株式 551,260,000円

○損益の状況 (2019年3月21日～2020年3月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	867,113,342
受取配当金	867,891,287
受取利息	2,560
その他収益金	528,367
支払利息	△ 1,308,872
(B) 有価証券売買損益	△5,715,855,942
売買益	1,404,028,310
売買損	△7,119,884,252
(C) 先物取引等取引損益	△ 209,158,460
取引益	389,592,060
取引損	△ 598,750,520
(D) 当期損益金(A+B+C)	△5,057,901,060
(E) 前期繰越損益金	9,644,309,171
(F) 追加信託差損益金	2,827,032,863
(G) 解約差損益金	△5,639,968,900
(H) 計(D+E+F+G)	1,773,472,074
次期繰越損益金(H)	1,773,472,074

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

○お知らせ

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2020年11月10日）

（計算期間 2019年11月12日～2020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	債 組	入 比	券 率	純 資	産 額
		期 騰	落 率							
	円		%		%			%		百万円
11期(2016年11月10日)	12,834		4.9	384.198	4.9			99.5		71,744
12期(2017年11月10日)	12,715		△0.9	380.302	△1.0			99.2		21,910
13期(2018年11月12日)	12,710		△0.0	379.669	△0.2			99.5		5,155
14期(2019年11月11日)	13,072		2.8	390.121	2.8			99.5		12,937
15期(2020年11月10日)	12,957		△0.9	386.816	△0.8			99.4		18,955

○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	債 組	入 比	券 率
		騰 落	率					
(期 首)	円		%					%
2019年11月11日	13,072		—	390.121				99.5
11月末	13,110		0.3	391.325				99.4
12月末	13,068		△0.0	390.136				99.9
2020年1月末	13,124		0.4	391.771				99.8
2月末	13,226		1.2	394.745				99.7
3月末	13,017		△0.4	388.450				99.6
4月末	13,061		△0.1	389.790				99.8
5月末	13,003		△0.5	388.127				99.8
6月末	12,951		△0.9	386.558				99.9
7月末	12,995		△0.6	387.913				100.1
8月末	12,935		△1.0	386.087				99.9
9月末	12,972		△0.8	387.219				100.1
10月末	12,950		△0.9	386.633				100.0
(期 末) 2020年11月10日	12,957		△0.9	386.816				99.4

(注) 騰落率は期首比です。

当ファンドのベンチマークはNOMURA-BPI（野村ボンド・パフォーマンス・インデックス）（総合）であり、NOMURA-BPI（総合）とは、野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。

○運用経過

(2019年11月12日～2020年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：13,072円

期 末：12,957円

騰落率：△0.9%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・日銀による追加金融緩和期待の後退などを背景とした10年国債利回りの上昇（債券価格の下落）

■投資環境

10年国債利回りは上昇しました。

期初、-0.06%程度であった10年国債利回りは、日銀による追加金融緩和に対する期待の後退などから2019年末にかけて上昇基調で推移しました。2020年1月下旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした市場の流動性低下により、3月中旬にかけて大きく上下する展開となりました。その後、主要各国で大規模な財政・金融政策が実施されたことを受けて市場のボラティリティ（変動性）が低下すると、10年国債利回りは期末にかけて-0.05%から+0.05%程度の狭いレンジ圏で推移し、0.04%程度の水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標に、ファンドとベンチマークのリスク特性値が近似するよう調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は前期末対比0.9%下落しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率△0.8%に対し、基準価額の騰落率は△0.9%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

（主な差異要因）

プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・リバランスなどに伴う取引コスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、10月末現在、推定値で0.05%となっています。

※2020年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。



(注) ベンチマークは、期首（2019年11月11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、NOMURA-BPI（総合）です。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年11月12日～2020年11月10日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2019年11月12日～2020年11月10日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	12,675,006	7,558,451
	地方債証券	513,027	—
	特殊債券	305,699	—
	社債券（投資法人債券を含む）	514,615	—
			(121,972)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ()内は償還による減少分です。

(注) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年11月12日～2020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

(2020年11月10日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	15,689,000	16,550,487	87.3	—	56.5	20.8	10.0
地方債証券	920,000	940,526	5.0	—	2.3	2.1	0.5
	(920,000)	(940,526)	(5.0)	(—)	(2.3)	(2.1)	(0.5)
特殊債券	400,000	405,081	2.1	—	0.5	1.1	0.5
(除く金融債)	(400,000)	(405,081)	(2.1)	(—)	(0.5)	(1.1)	(0.5)
普通社債券	888,827	952,890	5.0	—	3.4	1.6	—
(含む投資法人債券)	(888,827)	(952,890)	(5.0)	(—)	(3.4)	(1.6)	(—)
合 計	17,897,827	18,848,986	99.4	—	62.8	25.6	11.0
	(2,208,827)	(2,298,498)	(12.1)	(—)	(6.2)	(4.8)	(1.1)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		当期末				銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日			利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円		国債証券		%	千円	千円	
第406回利付国債 (2年)	0.1	10,000	10,023	2021/11/1		第3回利付国債 (30年)	2.3	20,000	24,344	2030/5/20	
第413回利付国債 (2年)	0.1	80,000	80,329	2022/6/1		第5回利付国債 (30年)	2.2	10,000	12,243	2031/5/20	
第414回利付国債 (2年)	0.1	110,000	110,468	2022/7/1		第22回利付国債 (30年)	2.5	10,000	13,356	2036/3/20	
第415回利付国債 (2年)	0.1	75,000	75,329	2022/8/1		第28回利付国債 (30年)	2.5	20,000	27,302	2038/3/20	
第129回利付国債 (5年)	0.1	170,000	170,334	2021/9/20		第29回利付国債 (30年)	2.4	60,000	81,218	2038/9/20	
第130回利付国債 (5年)	0.1	270,000	270,685	2021/12/20		第31回利付国債 (30年)	2.2	72,000	95,816	2039/9/20	
第131回利付国債 (5年)	0.1	400,000	401,272	2022/3/20		第32回利付国債 (30年)	2.3	65,000	88,053	2040/3/20	
第132回利付国債 (5年)	0.1	120,000	120,463	2022/6/20		第33回利付国債 (30年)	2.0	38,000	49,549	2040/9/20	
第133回利付国債 (5年)	0.1	440,000	442,046	2022/9/20		第34回利付国債 (30年)	2.2	60,000	80,859	2041/3/20	
第134回利付国債 (5年)	0.1	250,000	251,320	2022/12/20		第35回利付国債 (30年)	2.0	40,000	52,522	2041/9/20	
第135回利付国債 (5年)	0.1	350,000	352,023	2023/3/20		第36回利付国債 (30年)	2.0	87,000	114,610	2042/3/20	
第136回利付国債 (5年)	0.1	380,000	382,382	2023/6/20		第37回利付国債 (30年)	1.9	100,000	130,019	2042/9/20	
第137回利付国債 (5年)	0.1	250,000	251,720	2023/9/20		第38回利付国債 (30年)	1.8	23,000	29,516	2043/3/20	
第138回利付国債 (5年)	0.1	160,000	161,172	2023/12/20		第39回利付国債 (30年)	1.9	30,000	39,166	2043/6/20	
第139回利付国債 (5年)	0.1	230,000	231,780	2024/3/20		第40回利付国債 (30年)	1.8	25,000	32,128	2043/9/20	
第140回利付国債 (5年)	0.1	255,000	257,124	2024/6/20		第42回利付国債 (30年)	1.7	114,000	144,418	2044/3/20	
第141回利付国債 (5年)	0.1	250,000	252,227	2024/9/20		第44回利付国債 (30年)	1.7	21,000	26,655	2044/9/20	
第142回利付国債 (5年)	0.1	210,000	211,948	2024/12/20		第45回利付国債 (30年)	1.5	26,000	31,867	2044/12/20	
第143回利付国債 (5年)	0.1	300,000	302,886	2025/3/20		第46回利付国債 (30年)	1.5	93,000	114,056	2045/3/20	
第144回利付国債 (5年)	0.1	270,000	272,686	2025/6/20		第47回利付国債 (30年)	1.6	51,000	63,780	2045/6/20	
第5回利付国債 (40年)	2.0	34,000	47,057	2052/3/20		第48回利付国債 (30年)	1.4	83,000	99,957	2045/9/20	
第7回利付国債 (40年)	1.7	45,000	59,167	2054/3/20		第49回利付国債 (30年)	1.4	30,000	36,143	2045/12/20	
第8回利付国債 (40年)	1.4	36,000	44,265	2055/3/20		第50回利付国債 (30年)	0.8	35,000	37,195	2046/3/20	
第9回利付国債 (40年)	0.4	86,000	79,023	2056/3/20		第51回利付国債 (30年)	0.3	54,000	50,912	2046/6/20	
第10回利付国債 (40年)	0.9	64,000	68,906	2057/3/20		第52回利付国債 (30年)	0.5	107,000	105,788	2046/9/20	
第11回利付国債 (40年)	0.8	73,000	76,290	2058/3/20		第53回利付国債 (30年)	0.6	65,000	65,741	2046/12/20	
第12回利付国債 (40年)	0.5	88,000	83,181	2059/3/20		第54回利付国債 (30年)	0.8	35,000	37,056	2047/3/20	
第13回利付国債 (40年)	0.5	46,000	43,429	2060/3/20		第55回利付国債 (30年)	0.8	55,000	58,191	2047/6/20	
第320回利付国債 (10年)	1.0	50,000	50,626	2021/12/20		第56回利付国債 (30年)	0.8	38,000	40,175	2047/9/20	
第324回利付国債 (10年)	0.8	50,000	50,756	2022/6/20		第57回利付国債 (30年)	0.8	52,000	54,936	2047/12/20	
第327回利付国債 (10年)	0.8	205,000	209,071	2022/12/20		第58回利付国債 (30年)	0.8	80,000	84,453	2048/3/20	
第330回利付国債 (10年)	0.8	103,000	105,762	2023/9/20		第59回利付国債 (30年)	0.7	40,000	41,190	2048/6/20	
第335回利付国債 (10年)	0.5	100,000	102,422	2024/9/20		第60回利付国債 (30年)	0.9	9,000	9,713	2048/9/20	
第339回利付国債 (10年)	0.4	90,000	92,145	2025/6/20		第62回利付国債 (30年)	0.5	102,000	99,287	2049/3/20	
第340回利付国債 (10年)	0.4	110,000	112,711	2025/9/20		第63回利付国債 (30年)	0.4	50,000	47,269	2049/6/20	
第341回利付国債 (10年)	0.3	165,000	168,430	2025/12/20		第64回利付国債 (30年)	0.4	110,000	103,821	2049/9/20	
第342回利付国債 (10年)	0.1	230,000	232,474	2026/3/20		第65回利付国債 (30年)	0.4	59,000	55,593	2049/12/20	
第343回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,028	2026/6/20		第66回利付国債 (30年)	0.4	62,000	58,322	2050/3/20	
第344回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,120	2026/9/20		第67回利付国債 (30年)	0.6	48,000	47,580	2050/6/20	
第345回利付国債 (10年)	0.1	235,000	237,885	2026/12/20		第68回利付国債 (30年)	0.6	14,000	13,842	2050/9/20	
第346回利付国債 (10年)	0.1	195,000	197,492	2027/3/20		第51回利付国債 (20年)	2.0	90,000	91,166	2021/6/21	
第347回利付国債 (10年)	0.1	210,000	212,721	2027/6/20		第53回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,494	2021/12/20	
第348回利付国債 (10年)	0.1	210,000	212,753	2027/9/20		第60回利付国債 (20年)	1.4	20,000	20,650	2022/12/20	
第349回利付国債 (10年)	0.1	45,000	45,594	2027/12/20		第66回利付国債 (20年)	1.8	60,000	63,602	2023/12/20	
第350回利付国債 (10年)	0.1	165,000	167,196	2028/3/20		第67回利付国債 (20年)	1.9	30,000	32,405	2024/3/20	
第351回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,338	2028/6/20		第70回利付国債 (20年)	2.4	40,000	43,658	2024/6/20	
第352回利付国債 (10年)	0.1	180,000	182,273	2028/9/20		第71回利付国債 (20年)	2.2	60,000	65,052	2024/6/20	
第353回利付国債 (10年)	0.1	207,000	209,525	2028/12/20		第74回利付国債 (20年)	2.1	40,000	43,655	2024/12/20	
第354回利付国債 (10年)	0.1	185,000	187,170	2029/3/20		第75回利付国債 (20年)	2.1	30,000	32,907	2025/3/20	
第355回利付国債 (10年)	0.1	130,000	131,457	2029/6/20		第76回利付国債 (20年)	1.9	10,000	10,881	2025/3/20	
第356回利付国債 (10年)	0.1	190,000	192,021	2029/9/20		第80回利付国債 (20年)	2.1	40,000	44,091	2025/6/20	
第357回利付国債 (10年)	0.1	186,000	187,778	2029/12/20		第82回利付国債 (20年)	2.1	30,000	33,291	2025/9/20	
第358回利付国債 (10年)	0.1	185,000	186,642	2030/3/20		第84回利付国債 (20年)	2.0	60,000	66,467	2025/12/20	
第359回利付国債 (10年)	0.1	271,000	273,075	2030/6/20		第85回利付国債 (20年)	2.1	20,000	22,368	2026/3/20	
第360回利付国債 (10年)	0.1	65,000	65,446	2030/9/20		第90回利付国債 (20年)	2.2	65,000	73,808	2026/9/20	

銘 柄	当 期 末				銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第99回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,116	2027/12/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	36,000	35,423	2039/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	20,000	23,364	2028/3/20	第172回利付国債 (20年)	0.4	109,000	109,097	2040/3/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,401	2028/9/20	第173回利付国債 (20年)	0.4	81,000	81,000	2040/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,762	2029/9/20	第174回利付国債 (20年)	0.4	25,000	24,977	2040/9/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	50,000	60,260	2030/3/20	小 計		15,689,000	16,550,487	
第117回利付国債 (20年)	2.1	92,000	110,019	2030/3/20	地方債証券				
第123回利付国債 (20年)	2.1	125,000	150,920	2030/12/20	第781回東京都公募債	0.16	100,000	100,604	2028/6/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	40,000	47,891	2030/12/20	平成30年度第11回北海道公募債 (5年)	0.03	100,000	99,956	2023/9/28
第126回利付国債 (20年)	2.0	31,000	37,226	2031/3/20	第26回神奈川県公募債 (20年)	1.477	20,000	23,137	2034/6/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	59,527	2031/3/20	第6回大阪府公募債 (20年)	1.98	50,000	59,022	2030/9/13
第130回利付国債 (20年)	1.8	55,000	65,217	2031/9/20	平成28年度第2回京都府公募債 (15年)	0.21	50,000	50,171	2031/4/22
第132回利付国債 (20年)	1.7	64,000	75,372	2031/12/20	平成31年度第1回愛知県公募債 (10年)	0.09	100,000	99,974	2029/4/26
第133回利付国債 (20年)	1.8	90,000	106,983	2031/12/20	平成29年度第7回広島県公募債	0.2	100,000	100,878	2028/3/23
第135回利付国債 (20年)	1.7	60,000	70,816	2032/3/20	平成25年度第8回埼玉県公募債	0.703	100,000	102,084	2023/12/25
第136回利付国債 (20年)	1.6	77,000	90,016	2032/3/20	平成27年度第3回福岡県公募債	0.529	200,000	204,724	2025/8/25
第139回利付国債 (20年)	1.6	50,000	58,570	2032/6/20	平成29年度第1回広島市公募債 (5年)	0.01	100,000	99,975	2022/6/24
第140回利付国債 (20年)	1.7	32,000	37,933	2032/9/20	小 計		920,000	940,526	
第141回利付国債 (20年)	1.7	50,000	59,392	2032/12/20	特殊債券 (除く金融債)				
第143回利付国債 (20年)	1.6	60,000	70,680	2033/3/20	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	100,570	2021/2/26
第144回利付国債 (20年)	1.5	75,000	87,438	2033/3/20	第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,791	2028/5/31
第145回利付国債 (20年)	1.7	105,000	125,211	2033/6/20	第42回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	101,632	2022/11/14
第146回利付国債 (20年)	1.7	90,000	107,528	2033/9/20	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	102,088	2024/3/15
第147回利付国債 (20年)	1.6	82,000	97,096	2033/12/20	小 計		400,000	405,081	
第148回利付国債 (20年)	1.5	95,000	111,424	2034/3/20	普通社債券 (含む投資法人債券)				
第150回利付国債 (20年)	1.4	126,000	146,485	2034/9/20	第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,017	2025/3/25
第151回利付国債 (20年)	1.2	100,000	113,641	2034/12/20	第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.02	100,000	99,873	2024/6/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	91,000	103,479	2035/3/20	第33回道路債券	2.91	100,000	134,136	2034/6/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	112,000	129,025	2035/6/20	第101回都市再生債券	0.935	100,000	106,989	2029/11/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	122,000	138,900	2035/9/20	第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	36,868	39,016	2046/11/10
第155回利付国債 (20年)	1.0	44,000	48,839	2035/12/20	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	41,062	43,453	2046/12/10
第156回利付国債 (20年)	0.4	131,000	133,608	2036/3/20	第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	38,824	41,016	2047/1/10
第157回利付国債 (20年)	0.2	100,000	98,803	2036/6/20	第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	40,111	42,455	2047/4/10
第158回利付国債 (20年)	0.5	119,000	122,974	2036/9/20	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	31,962	32,285	2039/2/10
第159回利付国債 (20年)	0.6	92,000	96,462	2036/12/20	第16回成田国際空港株式会社社債	0.57	100,000	101,957	2024/10/28
第160回利付国債 (20年)	0.7	90,000	95,760	2037/3/20	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	100,000	109,023	2026/12/22
第161回利付国債 (20年)	0.6	93,000	97,412	2037/6/20	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	100,669	2028/6/6
第162回利付国債 (20年)	0.6	120,000	125,574	2037/9/20	小 計		888,827	952,890	
第163回利付国債 (20年)	0.6	48,000	50,179	2037/12/20	合 計		17,897,827	18,848,986	
第164回利付国債 (20年)	0.5	80,000	82,232	2038/3/20					
第165回利付国債 (20年)	0.5	90,000	92,391	2038/6/20					
第166回利付国債 (20年)	0.7	80,000	84,776	2038/9/20					
第167回利付国債 (20年)	0.5	48,000	49,141	2038/12/20					
第168回利付国債 (20年)	0.4	68,000	68,350	2039/3/20					
第169回利付国債 (20年)	0.3	104,000	102,553	2039/6/20					
第170回利付国債 (20年)	0.3	65,000	64,028	2039/9/20					

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。
(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

(2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 18,848,986	% 99.4
コール・ローン等、その他	123,204	0.6
投資信託財産総額	18,972,190	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	18,972,190,750
コール・ローン等	96,034,962
公社債(評価額)	18,848,986,241
未収利息	25,385,015
前払費用	1,784,532
(B) 負債	16,870,037
未払解約金	16,869,932
未払利息	105
(C) 純資産総額(A－B)	18,955,320,713
元本	14,629,174,482
次期繰越損益金	4,326,146,231
(D) 受益権総口数	14,629,174,482口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,957円

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,896,990,636円、期中追加設定元本額は6,742,056,009円、期中一部解約元本額は2,009,872,163円です。

<元本の内訳>

円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>	3,150,939,841円
東京海上セレクション・日本債券インデックス	2,850,820,440円
円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	2,794,325,015円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	2,262,875,071円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	1,053,362,829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>	860,958,541円
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	813,239,276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>	263,740,705円
TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	148,780,261円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	141,025,420円
L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	61,387,928円
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	47,541,512円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	47,321,895円
L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)	38,842,647円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	35,576,412円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	25,587,340円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	17,336,209円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	6,873,993円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	5,092,891円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	3,546,256円

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

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

○損益の状況 (2019年11月12日～2020年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	106,683,973
受取利息	106,750,933
支払利息	△ 66,960
(B) 有価証券売買損益	△ 250,774,420
売買益	17,081,000
売買損	△ 267,855,420
(C) 当期損益金(A+B)	△ 144,090,447
(D) 前期繰越損益金	3,040,491,972
(E) 追加信託差損益金	2,046,578,512
(F) 解約差損益金	△ 616,833,806
(G) 計(C+D+E+F)	4,326,146,231
次期繰越損益金(G)	4,326,146,231

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (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) (F)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。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2020年11月10日）

（計算期間 2019年11月12日～2020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
	円	騰 落 率	円	騰 落 率				
11期(2016年11月10日)	17,807	△11.3	829,736	△11.2	93.4	3.8	2.5	百万円 77,257
12期(2017年11月10日)	23,462	31.8	1,093,435	31.8	89.0	8.2	2.4	29,547
13期(2018年11月12日)	24,465	4.3	1,147,119	4.9	92.4	5.1	2.3	8,378
14期(2019年11月11日)	26,489	8.3	1,242,639	8.3	95.6	1.7	2.6	14,331
15期(2020年11月10日)	28,804	8.7	1,357,341	9.2	94.8	2.8	2.2	27,743

（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)	円	%		%	%	%	%
2019年11月11日	26,489	—	1,242,639	—	95.6	1.7	2.6
11月末	27,040	2.1	1,268,769	2.1	93.7	3.7	2.6
12月末	27,871	5.2	1,307,005	5.2	94.4	6.3	2.6
2020年1月末	27,903	5.3	1,309,283	5.4	98.4	1.6	2.7
2月末	25,716	△ 2.9	1,206,797	△ 2.9	98.6	1.6	2.8
3月末	21,882	△17.4	1,027,165	△17.3	98.8	3.4	2.7
4月末	24,021	△ 9.3	1,126,486	△ 9.3	94.8	6.4	2.5
5月末	25,029	△ 5.5	1,175,147	△ 5.4	93.2	7.7	2.5
6月末	25,493	△ 3.8	1,198,230	△ 3.6	97.9	2.9	2.5
7月末	26,338	△ 0.6	1,236,614	△ 0.5	97.9	2.7	2.5
8月末	28,356	7.0	1,333,631	7.3	97.6	3.1	2.3
9月末	27,215	2.7	1,281,404	3.1	97.8	3.1	2.3
10月末	26,456	△ 0.1	1,245,786	0.3	97.9	2.8	2.3
(期 末)							
2020年11月10日	28,804	8.7	1,357,341	9.2	94.8	2.8	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2019年11月12日～2020年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：26,489円

期 末：28,804円

騰落率： 8.7%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・各国中央銀行の金融緩和策などによる世界経済回復への期待
- ・次期米国大統領候補のバイデン氏が掲げる大規模な経済政策への期待
- ・新型コロナウイルスワクチンの大規模治験で有効性が確認されたこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気後退懸念の高まり

■投資環境

期初から2020年2月中旬にかけて、米中貿易協議の進展に対する期待感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が、2月下旬に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への影響が懸念され、大幅な下落に転じました。

3月下旬以降は、各国中央銀行による金融緩和策や各国の財政出動などを受けた世界経済回復への期待から、上昇基調で推移しました。

9月に入ると、米国大統領選挙を巡る不透明感や欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大が相場の重石となったものの、次期米国大統領候補のバイデン氏が掲げる大規模な経済政策への期待が高まったことや、新型コロナウイルスワクチンの大規模治験で有効性が確認されたことから、期末にかけて再び上昇基調に転じました。

以上のような経過を経て、外国株式市場は前期末対比で上昇しました。



(注) ベンチマークは、期首(2019年11月11日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

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

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークである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1,016銘柄に対して、当期末には1,027銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は8.7%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+9.2%に対して基準価額は+8.7%となり、ベンチマークにほぼ連動しました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・ 特にありません

マイナス要因

- ・ 配当課税の影響
- ・ 売買コストの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、過去1年で0.24%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

(2019年11月12日～2020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 6	% 0.021	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 *売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(5)	(0.017)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	6	0.022	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 *有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(6)	(0.021)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	18	0.067	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 *その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(18)	(0.067)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	30	0.110	
期中の平均基準価額は、26,110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

(2019年11月12日～2020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 7,696 (1,153)	千米ドル 69,891 (1,570)	百株 625 (171)	千米ドル 1,241 (1,882)
	カナダ	992 (0.73)	千カナダドル 4,840 (56)	118 (17)	千カナダドル 97 (56)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	661 (20)	2,884 (39)	32 (-)	34 (56)
	イタリア	990	575	40	62
	フランス	693	3,177	37	123
	オランダ	567 (0.88)	1,536 (-)	-	-
	スペイン	1,143 (920)	757 (24)	905 (-)	30 (4)
	ベルギー	60	330	-	-
	オーストリア	26	68	-	-
	ルクセンブルク	166	128	-	-
	フィンランド	219	296	7	16
	アイルランド	29 (0.07)	194 (-)	-	-
	ポルトガル	121 (180)	61 (1)	180 (-)	1 (1)
	イギリス	7,428 (4)	千英ポンド 3,884 (6)	1,238 (-)	千英ポンド 140 (6)
	スイス	439 (0.02)	千スイスフラン 3,351 (1)	- (-)	千スイスフラン - (18)
	スウェーデン	710 (32)	千スウェーデンクローナ 10,656 (84)	42 (-)	千スウェーデンクローナ 332 (84)
	ノルウェー	189	千ノルウェークローネ 2,213	39	千ノルウェークローネ 609
	デンマーク	112	千デンマーククローネ 5,591	-	千デンマーククローネ -
	オーストラリア	2,482 (34)	千豪ドル 3,404 (2)	599 (-)	千豪ドル 129 (2)
	ニュージーランド	174	千ニュージーランドドル 238	-	千ニュージーランドドル -
	香港	2,424 (24)	千香港ドル 8,611 (-)	375	千香港ドル 284

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	シンガポール	百株 1,514 (324)	千シンガポールドル 537 (14)	百株 757 (ー)	千シンガポールドル 73 (14)
	イスラエル	113 (1)	千イスラエルシェケル 379 (2)	1 (ー)	千イスラエルシェケル 1 (2)

(注) 金額は受渡代金です。

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

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	0.757	118	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	1	264	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.195	31	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	0.404	37	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.212	20	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	1	165	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.89	124	—	—
	DUKE REALTY CORP	0.822	27	—	—
	EQUINIX INC	0.238	164	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	0.527	33	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	0.692	37	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.136	30	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.339	33	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.162	17	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	60	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	2	33	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	0.823	23	—	—
	KIMCO REALTY CORP	0.508	10	2	26
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.094 (△0.863)	5 (△ 50)	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4	91	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.336	40	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.648	26	—	—
	PROLOGIS INC	1 (0.582)	153 (50)	—	—

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
	PUBLIC STORAGE	0.379	80	—	—
	REALTY INCOME CORP	1	61	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	0.494	24	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.256	75	—	—
	SL GREEN REALTY CORP	0.099	9	0.445	18
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.95	72	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	0.761	116	—	—
	UDR INC	0.814	32	—	—
	VENTAS INC	1	56	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	0.546	25	—	—
	WP CAREY INC	0.6	41	—	—
	WELLTOWER INC	1	64	—	—
	WEYERHAEUSER CO	2	56	—	—
	小 計	31 (△0.281)	2,271 (—)	2	45
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	20	—	—
	小 計	1	20	—	—
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	0.44	7	— (—)	— (1)
	GEICINA SA	0.077	12	—	—
	COVIVIO	0.051	5	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.801	43	—	—
	小 計	1	69	— (—)	— (1)
	ユ ー ロ 計	1	69	— (—)	— (1)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	1	8	—	—
	SEGRO PLC	2	24	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1	12	—	—
	小 計	6	45	—	—
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	12	35	—	—
	GPT GROUP	6	24	—	—
	STOCKLAND	9	40	—	—
	DEXUS	2	22	—	—
	GOODMAN GROUP	4	66	—	—
	SCENTRE GROUP	17	45	—	—
	小 計	53	233	—	—

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	9	589	—	—
	小 計	9	589	—	—
	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	30	56	—	—
	小 計	30	56	—	—

(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、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 8,071	百万円 7,650	百万円 —	百万円 —

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2019年11月12日～2020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	10,909,336千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,591,851千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.58

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年11月12日～2020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

(2020年11月10日現在)

外国株式

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	
AFLAC INC	22	30	125	13,156	保険
AT&T INC	241	405	1,148	120,836	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	59	105	1,158	121,890	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	49	104	990	104,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	2	3	92	9,707	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	25	47	357	37,630	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	1	—	—	—	資本財
ADOBE INC	16	28	1,365	143,649	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	2	4	77	8,124	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	37	71	591	62,273	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11	18	211	22,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6	12	394	41,481	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	7	11	115	12,188	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	4	7	92	9,775	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8	14	176	18,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	2	4	231	24,389	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	0.73	0.84	52	5,522	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	—	19	107	11,350	公益事業
ALLSTATE CORP	10	13	130	13,730	保険
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	9	122	12,889	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	10	17	3,120	328,308	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	9	17	3,135	329,867	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	61	105	401	42,194	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	13	24	7,834	824,236	小売
AMEREN CORPORATION	7	14	116	12,231	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	14	26	238	25,136	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	23	38	453	47,763	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	7	65	6,869	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29	51	194	20,412	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5	10	174	18,376	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	7	11	120	12,711	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4	7	132	13,915	各種金融
AMETEK INC	6	10	118	12,481	資本財
AMGEN INC	20	34	819	86,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	10	15	190	20,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES	13	21	295	31,137	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	3	5	179	18,903	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	8	14	481	50,643	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	17	—	—	—	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	16	72	7,605	各種金融
APPLE INC	151	1,016	11,826	1,244,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	30	53	378	39,840	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	11	23	83	8,797	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15	28	139	14,686	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数	期首(前期末)	当期期末		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	
ARISTA NETWORKS INC	2	3	102	10,764	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	3	5	72	7,626	保険
ATMOS ENERGY CORP	5	8	87	9,218	公益事業
AUTODESK INC	7	13	355	37,382	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	4	6	55	5,794	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14	24	409	43,076	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	0.82	1	155	16,353	小売
AVERY DENNISON CORP	3	5	90	9,569	素材
BB&T CORPORATION	23	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	26	48	85	9,005	エネルギー
BALL CORP	12	19	184	19,427	素材
BANK OF AMERICA CORP	296	452	1,255	132,138	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	27	43	171	17,996	各種金融
BAXTER INTL INC	16	28	230	24,253	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	9	17	413	43,461	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	7	10	69	7,289	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	42	79	1,764	185,686	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	8	14	158	16,641	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8	15	115	12,166	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	6	9	221	23,290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	3	8	588	61,873	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	39	219	23,100	各種金融
H&R BLOCK INC	8	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	17	32	585	61,555	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	1	2	497	52,372	小売
BORGWARNER INC	9	19	73	7,770	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	47	83	317	33,418	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	54	135	870	91,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5	8	120	12,625	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	13	24	914	96,208	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9	18	139	14,716	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B	15	—	—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4	8	73	7,724	各種金融
CBRE GROUP INC - A	12	22	128	13,526	不動産
CDK GLOBAL INC	5	11	54	5,713	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	5	9	135	14,296	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8	17	50	5,362	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5	9	89	9,407	運輸
CIGNA CORP	13	22	469	49,351	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	11	20	337	35,558	各種金融
CMS ENERGY CORP	11	16	111	11,718	公益事業
CSX CORP	24	40	360	37,906	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	43	75	507	53,421	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	15	24	40	4,276	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	—	18	218	23,028	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	8	13	63	6,715	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15	28	246	25,925	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	11	21	121	12,743	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	7	12	122	12,924	小売
CARNIVAL CORP	15	—	—	—	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	—	53	206	21,684	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	
CATERPILLAR INC		18	31	538	56,683	資本財
CELANESE CORP-SERIES A		5	8	113	11,927	素材
CELGENE CORP		24	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP		16	36	252	26,601	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC		23	38	91	9,661	公益事業
CERNER CORP		9	14	110	11,618	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		5	9	557	58,643	メディア・娯楽
CHEVRONTXACO CORP		62	110	876	92,166	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A		0.99	1	233	24,608	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		8	16	138	14,529	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO		5	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP		5	10	86	9,064	保険
CISCO SYSTEMS INC		138	237	907	95,431	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP		2	5	194	20,496	商業・専門サービス
CITIGROUP INC		76	119	571	60,126	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP		16	34	112	11,884	銀行
CITRIX SYSTEMS INC		5	8	94	9,927	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY		4	8	156	16,425	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY		130	233	1,226	129,057	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP		7	11	80	8,453	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		17	31	229	24,134	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		25	43	356	37,470	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A		152	265	1,253	131,853	メディア・娯楽
COMERICA INC		7	15	85	9,021	銀行
CONAGRA BRANDS INC		20	29	100	10,623	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC		7	14	69	7,342	エネルギー
CONOCOPHILLIPS		35	60	201	21,229	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC		10	18	145	15,297	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A		5	9	195	20,571	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE		2	3	129	13,581	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC		7	12	152	16,058	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH		—	8	103	10,851	ソフトウェア・サービス
CORNING INC		25	43	156	16,434	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC		24	43	152	16,002	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		14	25	932	98,077	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC		1	2	220	23,218	商業・専門サービス
COUPA SOFTWARE INC		—	5	142	15,021	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A		—	10	132	13,980	ソフトウェア・サービス
CUMMINS INC		4	7	178	18,766	資本財
DR HORTON INC		12	22	147	15,484	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY		4	10	137	14,473	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO		13	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP		21	38	902	94,940	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC		5	11	133	14,065	消費者サービス
DAVITA INC		6	6	69	7,364	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO		10	17	445	46,868	資本財
DENTSPLY SIRONA INC		10	18	95	9,999	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION		18	—	—	—	エネルギー
DEXCOM INC		—	6	214	22,609	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO		59	107	1,528	160,865	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		10	23	176	18,540	各種金融
DISCOVERY INC-A		11	14	31	3,272	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	
DISCOVERY INC-C	13	30	60	6,360	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION	11	20	58	6,190	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD	1	3	72	7,654	保険
DOCUSIGN INC	—	11	233	24,614	ソフトウェア・サービス
Dollar General Corp	8	15	321	33,860	小売
DOLLAR TREE INC	8	14	138	14,574	小売
DOMINION ENERGY INC	25	48	404	42,572	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	1	2	106	11,251	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	—	45	191	20,135	半導体・半導体製造装置
DOVER CORP	5	9	114	12,079	資本財
DOW INC	24	45	237	25,032	素材
DUKE ENERGY CORP	21	41	400	42,145	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	24	45	279	29,361	素材
EOG RESOURCES INC	18	33	134	14,152	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORP	11	—	—	—	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	—	4	71	7,545	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6	—	—	—	消費者サービス
EAST WEST BANCORP INC	8	8	37	3,936	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5	10	93	9,884	素材
EBAY INC	28	43	208	21,971	小売
ECOLAB INC	8	13	295	31,058	素材
BUNGE LIMITED	5	12	73	7,721	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	12	22	135	14,306	公益事業
Edwards Lifesciences Corp	7	36	306	32,195	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	9	17	204	21,511	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	18	30	236	24,833	資本財
ENTERGY CORP	6	12	133	14,021	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	—	4	139	14,678	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	4	7	114	12,033	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	35	86	9,061	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	19	89	9,387	公益事業
EVERGY INC	8	18	107	11,348	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	8	19	186	19,592	公益事業
EXELON CORP	30	51	223	23,504	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	5	10	132	13,940	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	6	10	94	9,975	運輸
EXXON MOBIL CORPORATION	136	236	873	91,874	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	6	9	36	3,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	80	142	3,961	416,829	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	2	89	9,429	各種金融
FASTENAL CO	18	31	146	15,391	資本財
FEDEX CORP	8	15	402	42,338	運輸
F5 NETWORKS INC	2	4	73	7,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	20	37	525	55,320	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11	17	58	6,118	保険
FIFTH THIRD BANCORP	23	50	135	14,212	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5	9	130	13,731	銀行
FISERV INC	19	34	375	39,543	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	17	42	125	13,184	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2	4	134	14,128	ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	13	—	—	—	資本財
FLOWSERVE CORP	7	—	—	—	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	
FORD MOTOR CO	127	231	189	19,972	自動車・自動車部品
FORTINET INC	6	9	109	11,557	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	9	17	126	13,267	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7	11	91	9,652	資本財
FOX CORP-CLASS A	11	26	69	7,285	メディア・娯楽
FOX CORP-CLASS B	11	15	39	4,149	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	11	17	35	3,759	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	—	105	209	22,012	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6	11	122	12,890	保険
GARTNER INC	4	7	121	12,822	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	7	12	189	19,937	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	295	523	456	47,988	資本財
GENERAL MILS INC	19	34	203	21,453	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	41	76	297	31,344	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	6	10	107	11,263	小売
GILEAD SCIENCES INC	43	74	439	46,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	10	18	358	37,734	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	5	6	57	6,082	保険
GODADDY INC - CLASS A	8	14	104	10,960	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10	18	395	41,584	各種金融
WW GRAINGER INC	1	2	103	10,864	資本財
HCA HEALTHCARE INC	9	16	244	25,729	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7	12	56	5,974	資本財
HP INC	47	83	163	17,239	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	25	60	87	9,157	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	7	—	—	—	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8	22	102	10,768	保険
HASBRO INC	5	9	83	8,832	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE	5	—	—	—	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3	5	88	9,291	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE	—	7	116	12,270	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	11	20	87	9,248	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	44	82	80	8,482	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10	18	194	20,487	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	7	—	—	—	エネルギー
HOME DEPOT INC	35	62	1,698	178,715	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	23	39	773	81,367	資本財
HORMEL FOODS CORP	12	19	98	10,335	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	4	8	341	35,958	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3	5	74	7,821	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	44	91	109	11,526	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1	2	43	4,594	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	—	7	101	10,650	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	3	—	—	—	メディア・娯楽
IDEX CORP	—	5	100	10,571	資本財
IDEX LABORATORIES INC	3	5	233	24,566	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	10	16	356	37,490	資本財
ILLUMINA INC	5	9	280	29,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	8	13	111	11,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	24	104	11,000	資本財
INGREDION INC	3	5	42	4,501	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	148	246	1,124	118,279	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額	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	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	18	31	310	32,716	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	28	50	577	60,798	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4	5	66	6,987	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	12	21	101	10,697	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	20	37	78	8,291	メディア・娯楽
INTUIT INC	8	15	557	58,692	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	3	7	543	57,206	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	6	12	220	23,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	106	175	2,055	216,254	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6	8	89	9,460	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	16	—	—	—	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	86	153	2,237	235,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	14	19	41	4,396	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	5	9	225	23,758	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	—	6	124	13,089	運輸
KELLOGG CO	9	13	87	9,240	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	—	32	88	9,359	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	41	77	117	12,332	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7	11	129	13,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	11	19	258	27,244	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	69	101	125	13,160	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7	10	41	4,404	運輸
KOHL'S CORP	6	—	—	—	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	26	37	116	12,206	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	26	45	139	14,691	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	15	23	83	8,788	小売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7	12	234	24,676	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	—	6	122	12,867	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	4	9	375	39,548	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	—	11	84	8,932	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	13	23	136	14,368	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7	13	328	34,555	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	2	4	58	6,111	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	8	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	6	10	98	10,314	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	11	19	135	14,243	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	2	66	6,969	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	5	8	129	13,674	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	9	18	75	7,917	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	29	52	748	78,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	9	17	75	7,992	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	8	14	523	55,101	資本財
LOEWS CORP	12	17	75	7,995	保険
LOWE'S COMPANIES	26	45	700	73,715	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	3	7	254	26,797	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	3	6	79	8,409	銀行
MSCI INC	3	5	213	22,429	各種金融
MANPOWERGROUP	2	—	—	—	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	43	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	23	42	155	16,326	エネルギー
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	2	133	14,011	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	15	28	318	33,541	保険

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	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A		10	20	237	24,967	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS		2	4	115	12,102	素材
MASCO CORP		13	17	94	9,990	資本財
MASIMO CORP		—	4	108	11,390	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A		30	52	1,801	189,484	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC		—	16	230	24,210	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		11	15	128	13,510	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		4	7	140	14,746	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP		25	44	943	99,243	消費者サービス
MCKESSON CORP		6	9	173	18,292	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC		1	2	375	39,481	小売
MERCK & CO. INC.		85	148	1,193	125,575	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC		24	40	183	19,262	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC		1	1	176	18,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP		239	423	9,240	972,194	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		9	16	202	21,349	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC		39	66	373	39,281	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP		2	—	—	—	資本財
MODERNA INC		—	19	151	15,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC		2	4	55	5,825	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B		9	12	50	5,365	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC		46	78	436	45,966	食品・飲料・タバコ
MONSTER BEVERAGE CORP		12	21	176	18,555	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP		6	10	280	29,530	各種金融
MORGAN STANLEY		40	83	466	49,036	各種金融
MOSAIC CO/THE		17	41	69	7,358	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC		5	9	159	16,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC		—	16	51	5,470	公益事業
NVR INC		—	0.26	103	10,873	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC		—	8	111	11,774	各種金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		15	33	38	4,064	エネルギー
NETAPP INC		10	12	62	6,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC		14	26	1,242	130,683	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		—	7	81	8,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC		19	31	61	6,429	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION		25	52	346	36,481	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I		23	38	60	6,379	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC		15	116	882	92,838	公益事業
NIKE INC -CL B		41	73	945	99,512	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC		17	32	78	8,259	公益事業
NOBLE ENERGY INC		21	—	—	—	エネルギー
NORDSON CORP		—	4	88	9,298	資本財
NORDSTROM INC		6	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP		8	14	330	34,812	運輸
NORTHERN TRUST CORP		6	13	121	12,810	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		5	8	270	28,464	資本財
NORTONLIFELOCK INC		25	39	75	7,990	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP		12	23	118	12,475	素材
NVIDIA CORP		19	36	2,000	210,524	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP		10	17	58	6,106	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		2	4	200	21,064	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		28	—	—	—	エネルギー

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	
OKTA INC		—	8	183	19,349	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC		2	6	119	12,601	運輸
ONEOK INC		13	29	91	9,621	エネルギー
ORACLE CORPORATION		77	119	677	71,259	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP		—	22	141	14,878	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		13	22	283	29,851	銀行
PPG INDUSTRIES INC		6	12	180	18,986	素材
PPL CORPORATION		20	43	125	13,154	公益事業
PVH CORP		3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PACCAR INC		11	19	177	18,663	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA		3	6	82	8,710	素材
PALO ALTO NETWORKS INC		3	6	169	17,878	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP		4	7	191	20,106	資本財
PAYCHEX INC		8	15	143	15,116	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC		—	3	140	14,830	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		37	67	1,240	130,521	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		23	29	38	4,027	銀行
PEPSICO INC		45	78	1,088	114,535	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC		—	9	120	12,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC		182	325	1,276	134,322	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		51	89	640	67,358	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66		14	22	126	13,356	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL		5	8	77	8,188	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		5	11	101	10,701	エネルギー
POLARIS INC		2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC		6	12	177	18,713	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		10	21	100	10,535	保険
PROCTER & GAMBLE CO		82	144	1,991	209,493	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP		19	33	301	31,772	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		13	19	146	15,362	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		15	28	171	18,022	公益事業
PULTE HOMES INC		12	19	79	8,380	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC		40	66	951	100,151	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS		5	8	106	11,228	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC-A		24	—	—	—	小売
RPM INTERNATIONAL INC		—	9	86	9,098	素材
RALPH LAUREN CORP		2	3	31	3,345	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		5	8	70	7,465	各種金融
RAYTHEON COMPANY		9	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP		—	88	572	60,232	資本財
Regeneron Pharmaceuticals Inc		3	6	362	38,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP		42	74	113	11,921	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		—	4	58	6,149	保険
REPUBLIC SERVICES INC		5	9	94	9,972	商業・専門サービス
RESMED INC		5	8	196	20,678	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A		—	5	143	15,113	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC		4	7	43	4,619	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		3	6	157	16,589	資本財
ROLLINS INC		7	12	70	7,404	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		3	6	234	24,714	資本財
ROSS STORES INC		11	21	234	24,695	小売
S&P GLOBAL INC		8	14	491	51,680	各種金融

銘柄	株数	期首(前期末)	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	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5	7	42	4,430	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10	19	124	13,139	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	2	3	127	13,414	銀行
SALESFORCE.COM INC	28	54	1,403	147,687	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	44	84	154	16,211	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	40	92	413	43,546	各種金融
SEAGEN INC	—	8	150	15,880	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	6	14	62	6,535	素材
SEATTLE GENETICS INC	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	8	16	218	23,033	公益事業
SERVICENOW INC	6	11	596	62,739	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2	4	341	35,901	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	10	156	16,504	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	6	9	51	5,377	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4	8	94	9,890	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	2	3	54	5,735	資本財
SNAP INC - A	—	61	251	26,468	メディア・娯楽
SOUTHERN CO	33	59	370	38,972	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	6	15	66	7,037	運輸
SPLUNK INC	5	10	209	22,080	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	12	23	430	45,318	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	5	9	166	17,545	資本財
STARBUCKS CORP	41	68	658	69,331	消費者サービス
STATE STREET CORP	12	20	144	15,185	各種金融
STRYKER CORP	11	19	464	48,892	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	15	—	—	—	銀行
SYNOPSIS INC	5	10	239	25,187	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	20	43	129	13,667	各種金融
SYSCO CORP	16	30	217	22,853	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	13	—	—	—	各種金融
TJX COMPANIES INC	38	70	429	45,209	小売
T-MOBILE US INC	12	34	426	44,850	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4	7	125	13,163	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	13	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	17	29	458	48,242	小売
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	3	111	11,684	資本財
TELEFLEX INC	2	3	132	13,900	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC	4	44	1,858	195,498	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	31	52	817	85,992	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	10	15	66	7,031	資本財
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	3	229	24,191	ソフトウェア・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13	23	1,151	121,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	18	32	528	55,624	資本財
TIFFANY & CO	4	6	91	9,645	小売
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5	9	121	12,803	小売
TRANSDIGM GROUP INC	1	3	205	21,585	資本財
TRANSUNION	8	13	133	14,019	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	8	13	176	18,563	保険
TRIMBLE INC	12	20	118	12,446	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	7	—	—	—	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	—	78	382	40,210	銀行
TWILIO INC - A	—	8	226	23,840	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期末				業種等
		期首(前期末)	当	期	末	
			株数	評価	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	
TWITTER INC	29	52		227	23,915	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	10	18		113	11,911	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	47	77		342	36,081	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	61		296	31,220	運輸
ULTA BEAUTY INC	2	3		95	10,091	小売
UNION PACIFIC CORP	23	39		775	81,638	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	22	41		676	71,213	運輸
UNITED RENTALS INC	3	6		124	13,057	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	27	—		—	—	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	31	55		1,953	205,511	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	3	5		68	7,255	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	10	—		—	—	保険
VF CORP	11	18		143	15,136	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	1	2		79	8,346	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	14	25		128	13,541	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3	6		114	12,084	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4	9		245	25,786	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	4	6		141	14,877	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	134	235		1,411	148,554	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	4	8		162	17,080	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9	16		376	39,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	18	—		—	—	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B	—	45		133	14,050	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	57	97		2,075	218,367	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	3	6		87	9,203	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	7	12		66	7,037	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	4	7		108	11,405	素材
WABCO HOLDINGS INC	2	—		—	—	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	11	18		191	20,154	公益事業
WABTEC CORP/DE	7	13		91	9,658	資本財
WALMART INC	46	82		1,189	125,133	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	25	39		156	16,508	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	8	15		164	17,285	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	12	21		260	27,386	商業・専門サービス
WATERS CORP	2	4		99	10,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & COMPANY	139	222		538	56,704	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	—	5		155	16,309	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	11	20		83	8,789	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	19	27		59	6,241	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO	10	19		78	8,220	素材
WHIRLPOOL CORP	2	4		86	9,086	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	44	77		150	15,875	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	6	11		264	27,781	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	18	29		219	23,068	公益事業
XILINX INC	9	14		190	20,091	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	7	11		105	11,070	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	9	—		—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	10	16		173	18,218	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2	3		118	12,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7	12		192	20,230	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	17	29		484	50,942	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		406	42,737	ソフトウェア・サービス

銘柄		期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円		
INVESCO LTD		19	35	52	5,472	各種金融	
CHUBB LTD		15	25	372	39,231	保険	
LyondellBasell Industries NV		8	16	128	13,522	素材	
GARMIN LTD		6	9	111	11,739	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A		20	36	872	91,768	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV		10	18	263	27,707	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY		10	13	73	7,708	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC		7	—	—	—	保険	
TE CONNECTIVITY LTD		10	18	197	20,827	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND PLC		7	—	—	—	資本財	
APTIV PLC		8	17	185	19,475	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC		13	22	251	26,450	資本財	
IHS MARKIT LTD		15	23	214	22,593	商業・専門サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC		4	7	145	15,321	保険	
TECHNIPFMC PLC		21	—	—	—	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		8	15	72	7,600	資本財	
STERIS PLC		—	6	132	13,896	ヘルスケア機器・サービス	
PERRIGO CO PLC		6	11	52	5,525	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMCOR PLC		55	104	125	13,246	素材	
CAPRI HOLDINGS LTD		7	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
TRANE TECHNOLOGIES PLC		—	13	196	20,659	資本財	
AON PLC		—	13	252	26,526	保険	
PENTAIR PLC		7	12	67	7,103	資本財	
MEDTRONIC PLC		43	77	873	91,900	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV		24	34	51	5,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC		18	—	—	—	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		29	42	188	19,876	資本財	
ALLERGAN PLC		11	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		10	15	59	6,268	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC		18	30	787	82,812	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		7	11	47	4,948	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	9,576 488	17,628 495	179,647 —	18,900,729 <68.1%>		
(カナダ)				千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD		10	18	184	14,920	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		30	52	234	18,988	食品・生活必需品小売り	
BCE INC		8	15	86	7,005	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL		19	35	304	24,599	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA		36	62	373	30,151	銀行	
BARRICK GOLD CORP		60	117	410	33,143	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		32	84	394	31,904	各種金融	
CAE INC		14	27	76	6,156	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B		8	13	75	6,114	素材	
CGI INC		8	13	126	10,244	ソフトウェア・サービス	
CAMECO CORP		22	35	44	3,595	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		14	23	244	19,735	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO		21	39	560	45,322	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES		40	75	197	15,959	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		4	7	326	26,357	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A		2	5	93	7,553	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A		9	17	54	4,434	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC		51	113	63	5,171	エネルギー	

銘柄		期首(前期末)	当		期		業	種	等
		株	株	期					
				評	価				
		数	数	外貨建金額	邦貨換算金額	額			
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円				
CONSTELLATION SOFTWARE INC		0.75	1	188	15,262		ソフトウェア・サービス		
DOLLARAMA INC		13	21	104	8,442		小売		
EMERA INC		—	22	123	10,003		公益事業		
ENCANA CORP		59	—	—	—		エネルギー		
ENBRIDGE INC		69	117	444	35,907		エネルギー		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		—	2	81	6,620		保険		
FIRST CAPITAL REALTY INC		15	—	—	—		不動産		
FORTIS INC		17	30	167	13,533		公益事業		
FRANCO-NEVADA CORP		6	13	243	19,706		素材		
GILDAN ACTIVEWEAR INC		13	17	52	4,270		耐久消費財・アパレル		
GREAT-WEST LIFECO INC		16	25	72	5,865		保険		
HUSKY ENERGY INC		28	—	—	—		エネルギー		
HYDRO ONE LTD		17	34	102	8,290		公益事業		
IGM FINANCIAL INC		8	14	46	3,798		各種金融		
IMPERIAL OIL LTD		10	27	60	4,874		エネルギー		
INTACT FINANCIAL CORP		5	10	142	11,519		保険		
INTER PIPELINE LTD		22	52	64	5,217		エネルギー		
KEYERA CORP		13	27	53	4,322		エネルギー		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		—	22	130	10,541		素材		
LOBLAW COMPANIES LTD		8	15	101	8,242		食品・生活必需品小売り		
MAGNA INTERNATIONAL INC		9	19	150	12,190		自動車・自動車部品		
MANULIFE FINANCIAL CORP		71	104	218	17,626		保険		
METRO INC		11	22	138	11,223		食品・生活必需品小売り		
NATIONAL BANK OF CANADA		13	21	145	11,775		銀行		
NUTRIEN LTD		20	34	183	14,791		素材		
OPEN TEXT CORP		12	25	132	10,747		ソフトウェア・サービス		
PEMBINA PIPELINE CORP		20	44	125	10,168		エネルギー		
POWER CORP OF CANADA		17	47	130	10,587		保険		
POWER FINANCIAL CORP		14	—	—	—		保険		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		14	—	—	—		エネルギー		
RESTAURANT BRANDS INTERN		10	23	178	14,389		消費者サービス		
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B		11	28	160	12,951		電気通信サービス		
ROYAL BANK OF CANADA		44	78	763	61,712		銀行		
SAPUTO INC		9	19	65	5,283		食品・飲料・タバコ		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		22	45	103	8,372		メディア・娯楽		
SHOPIFY INC - CLASS A		3	6	779	62,984		ソフトウェア・サービス		
SUN LIFE FINANCIAL INC		16	29	176	14,282		保険		
SUNCOR ENERGY INC		49	98	186	15,104		エネルギー		
TC ENERGY CORP		31	54	289	23,411		エネルギー		
TELUS CORP		8	16	38	3,107		電気通信サービス		
THOMSON REUTERS CORP		9	13	149	12,100		商業・専門サービス		
TORONTO-DOMINION BANK		56	98	618	50,030		銀行		
WESTON (GEORGE) LTD		4	5	58	4,721		食品・生活必需品小売り		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		20	33	205	16,615		素材		
小計		株数・金額	1,229	2,086	11,034	891,957			
銘柄数<比率>			59	57	—	<3.2%>			
(ユーロ…ドイツ)					千ユーロ				
ADIDAS AG		5	10	322	40,028		耐久消費財・アパレル		
Fresenius SE & CO KG		12	23	88	10,974		ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		8	12	35	4,431		電気通信サービス		
FUCHS PETROLUB SE -PREF		4	6	28	3,549		素材		
HANNOVER RUECK SE		2	4	64	8,001		保険		

銘柄		期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
GEA GROUP AG		8	14	41	5,128	資本財
CONTINENTAL AG		3	7	77	9,569	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG		29	54	220	27,364	運輸
MERCK KGAA		5	8	107	13,379	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG		19	37	123	15,374	公益事業
SAP SE		32	61	609	75,724	ソフトウェア・サービス
E.ON SE		64	120	112	14,018	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		4	9	80	9,967	家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG		4	7	63	7,918	耐久消費財・アパレル
BAYER AG		30	58	271	33,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG		3	6	60	7,555	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE		27	47	265	32,993	素材
BEIERSDORF AG		4	7	71	8,869	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		5	10	61	7,676	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co		9	12	88	11,037	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE		13	22	417	51,891	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		16	—	—	—	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		4	7	174	21,661	保険
VOLKSWAGEN AG		2	3	55	6,882	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD		5	8	116	14,431	自動車・自動車部品
DAIMLER AG		29	51	259	32,308	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		24	43	510	63,472	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG		82	139	124	15,414	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		9	17	120	14,993	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		97	169	249	31,006	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		—	2	104	13,040	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		45	78	215	26,765	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG		6	10	135	16,837	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		6	11	61	7,588	自動車・自動車部品
WIRECARD AG		4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS		5	7	38	4,802	素材
MTU AERO ENGINES AG		2	4	82	10,256	資本財
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		—	19	83	10,379	不動産
SYMRISE AG		5	8	87	10,814	素材
BRENNTAG AG		6	10	64	8,040	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		9	11	27	3,410	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		93	117	26	3,345	電気通信サービス
COMMERZBANK AG		60	93	42	5,327	銀行
LEG IMMOBILIEN AG		—	5	58	7,248	不動産
VONOVIA SE		18	29	168	20,878	不動産
METRO AG		12	22	19	2,391	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG		—	13	47	5,841	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG		—	33	71	8,886	資本財
ZALANDO SE		—	12	98	12,202	小売
SCOUT24 AG		—	9	66	8,283	メディア・娯楽
COVESTRO AG		6	13	61	7,610	素材
UNIPER SE		11	15	44	5,521	公益事業
DELIVERY HERO SE		7	10	110	13,686	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	879	1,529	6,538	812,568	
	銘 柄 数 < 比 率 >	46	51	—	<2.9%>	

銘柄		期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI		34	68	90	11,231	保険
INTESA SANPAOLO		566	957	169	21,021	銀行
MEDIOBANCA SPA		36	80	57	7,188	銀行
ENEL SPA		293	491	395	49,196	公益事業
ENI SPA		79	158	116	14,493	エネルギー
ATLANTIA S. P. A		24	—	—	—	運輸
TERNA SPA		68	128	80	9,981	公益事業
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		7	11	54	6,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONCLER SPA		9	15	60	7,509	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA		36	54	66	8,310	銀行
UNICREDIT SPA		81	163	126	15,704	銀行
POSTE ITALIANE SPA		33	68	53	6,662	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		38	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	1,309	2,198	1,272	158,096	
	銘 柄 数 < 比 率 >	13	11	—	<0.6%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		10	15	50	6,305	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		23	37	68	8,473	公益事業
L' OREAL		7	13	424	52,793	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		9	16	750	93,222	耐久消費財・アパレル
THALES SA		4	7	51	6,420	資本財
CAPGEMINI		5	10	117	14,560	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)-B		4	7	76	9,446	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		6	10	171	21,265	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		7	—	—	—	自動車・自動車部品
SCHNEIDER ELECTRIC SE		16	30	361	44,880	資本財
VIVENDI SA		33	43	111	13,860	メディア・娯楽
ORANGE		56	92	89	11,177	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		0.79	1	134	16,674	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		4	8	127	15,836	ソフトウェア・サービス
KERING		2	4	265	33,049	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES		12	25	29	3,694	保険
CARREFOUR SA		22	39	56	7,015	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		3	7	50	6,255	ソフトウェア・サービス
SANOFI		36	66	568	70,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA		10	19	54	6,771	消費者サービス
SOCIETE GENERALE-A		23	63	98	12,198	銀行
EUROFINS SCIENTIFIC		—	1	76	9,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEPERFORMANCE		2	3	107	13,345	商業・専門サービス
SODEXO		3	8	59	7,355	消費者サービス
AXA SA		56	89	155	19,368	保険
PEUGEOT SA		23	38	67	8,435	自動車・自動車部品
ESSILORLUXOTTICA		9	16	194	24,228	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA		49	81	68	8,560	銀行
BNP PARIBAS		33	62	246	30,683	銀行
ORPEA		—	5	52	6,488	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		15	30	119	14,790	資本財
Wendel		2	3	33	4,157	各種金融
Iliad SA		1	—	—	—	電気通信サービス
SAFRAN SA		11	19	224	27,888	資本財
ENGIE		58	106	125	15,555	公益事業
ALSTOM		9	15	64	8,024	資本財

銘柄		期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
Eutelsat Communications		11	—	—	—	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE		30	45	49	6,131	公益事業
Legrand SA		7	13	96	11,998	資本財
Eiffage SA		4	6	55	6,835	資本財
TOTAL SE		75	139	445	55,308	エネルギー
Aeroports de Paris		1	2	31	3,942	運輸
Natixis		57	92	20	2,608	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		3	7	59	7,375	メディア・娯楽
SCOR SE		7	12	34	4,317	保険
VINCI S.A.		16	27	243	30,237	資本財
DANONE		19	30	159	19,851	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE		14	25	360	44,763	素材
Bureau Veritas SA		12	23	49	6,095	商業・専門サービス
GETLINK SE		22	40	56	6,970	運輸
SUEZ		21	36	58	7,281	公益事業
EDENRED		10	19	87	10,857	ソフトウェア・サービス
VALEO SA		10	19	56	7,059	自動車・自動車部品
WORLDLINE SA		5	16	127	15,791	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	2	82	10,226	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	911	1,566	7,327	910,576	
	銘 柄 数 < 比 率 >	52	52	—	<3.3%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE		19	36	301	37,472	資本財
RANDSTAD NV		6	11	56	7,082	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER		7	12	95	11,851	商業・専門サービス
Koninklijke Vopak NV		5	5	25	3,227	エネルギー
AEGON NV		99	152	41	5,171	保険
KONIKLIJKE KPN NV		177	285	65	8,117	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		30	41	126	15,722	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV		32	53	238	29,632	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV		8	12	115	14,371	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		5	7	60	7,501	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		6	9	140	17,400	素材
UNILEVER NV		46	82	432	53,764	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV		14	25	909	112,973	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		40	61	142	17,749	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV		—	6	123	15,398	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV		—	91	74	9,310	資本財
AKZO NOBEL		6	10	95	11,832	素材
PROSUS NV		16	30	292	36,299	小売
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		—	67	64	8,004	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV		—	24	82	10,272	保険
QIAGEN N V		14	18	73	9,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV /WI		0.59	1	199	24,770	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA		129	247	171	21,285	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	668	1,297	3,929	488,361	
	銘 柄 数 < 比 率 >	19	23	—	<1.8%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA		14	23	55	6,908	公益事業
Bankinter SA		37	80	31	3,927	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		199	360	104	13,005	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		15	19	36	4,495	公益事業

銘	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ 千円	
REPSOL SA		37	97	66	8,247 エネルギー
BANCO SANTANDER S.A		510	873	186	23,122 銀行
TELEFONICA SA		138	259	82	10,254 電気通信サービス
ENAGAS SA		10	13	26	3,269 公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		10	22	55	6,957 資本財
FERROVIAL SA		22	37	84	10,514 資本財
MAPFRE S.A.		67	109	16	2,079 保険
CaixaBank SA		149	253	46	5,832 銀行
IBERDROLA SA		181	324	358	44,562 公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		14	27	148	18,435 ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		16	25	40	5,080 公益事業
FERROVIAL SA-RTS		22	—	—	資本財
FERROVIAL SA-RTS		—	37	0.84195	104 資本財
INDITEX		36	54	145	18,046 小売
AENA SME SA		2	4	59	7,387 運輸
CELLNEX TELECOM SAU		12	24	127	15,836 電気通信サービス
GRIFOLS SA		14	24	65	8,115 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	1,515	2,673	1,739	216,182
	銘 柄 数 < 比 率 >	20	20	—	<0.8%>
(ユーロ…ベルギー)					
KBC GROEP NV		6	18	92	11,498 銀行
SOLVAY SA		2	6	53	6,592 素材
UCB SA		5	10	98	12,299 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		3	6	29	3,637 食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		4	8	70	8,812 各種金融
AGEAS		8	13	50	6,292 保険
UMICORE		7	15	51	6,402 素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		25	46	247	30,763 食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	65	125	694	86,298
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.3%>
(ユーロ…オーストリア)					
OMV AG		6	21	50	6,251 エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		14	25	51	6,378 銀行
ANDRITZ AG		5	6	21	2,716 資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	26	53	123	15,346
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)					
TENARIS SA		23	42	23	2,922 エネルギー
SES SA		17	42	32	4,066 メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		—	93	44	5,505 不動産
ARCELORMITTAL		32	61	83	10,402 素材
小 計	株 数 ・ 金 額	73	240	184	22,896
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)					
WARTSILA		17	32	26	3,246 資本財
UPM-KYMMENE OYJ		16	26	69	8,666 素材
STORA ENSO OYJ-R SHS		22	41	55	6,926 素材
SAMPO OYJ-A SHS		11	24	90	11,250 保険
FORTUM OYJ		17	28	50	6,223 公益事業
ELISA OYJ		6	10	48	6,000 電気通信サービス
NOKIA OYJ		195	318	98	12,218 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ		15	25	129	16,129 エネルギー

銘	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等
		株 数	株 数	価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円
NOKIAN RENKAAT OYJ		7	—	—	—
KONE OYJ-B		9	18	134	16,763
ORION OYJ		6	10	39	4,951
小 計		株 数 ・ 金 額	324	536	743
銘 柄 数 < 比 率 >		11	10	—	<0.3%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC(DUBLIN)		29	39	126	15,751
KINGSPAN GROUP PLC		—	11	90	11,273
KERRY GROUP PLC-A		5	8	96	11,943
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		4	10	150	18,644
小 計		株 数 ・ 金 額	39	69	463
銘 柄 数 < 比 率 >		3	4	—	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		111	218	96	12,026
Galp Energia SGPS SA		17	26	22	2,748
JERONIMO MARTINS		14	18	26	3,284
小 計		株 数 ・ 金 額	142	264	145
銘 柄 数 < 比 率 >		3	3	—	<0.1%>
ユーロ計		株 数 ・ 金 額	5,956	10,556	23,162
銘 柄 数 < 比 率 >		181	189	—	<10.4%>
(イギリス)				千英ポンド	
ASHTREAD GROUP PLC		21	31	99	13,777
AVIVA PLC		108	229	69	9,669
DIAGEO PLC		76	130	379	52,547
SCHRODERS PLC		7	12	38	5,264
BAE SYSTEMS PLC		103	179	79	11,004
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		76	132	340	47,155
HALMA PLC		—	29	74	10,277
STANDARD CHARTERED PLC		95	171	72	10,072
IMPERIAL BRANDS PLC		30	57	73	10,118
HSBC HOLDINGS PLC		647	1,179	441	61,091
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		203	418	92	12,879
MEGGITT PLC		47	—	—	—
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS		118	193	31	4,391
Associated British Foods PLC		13	21	42	5,927
PERSIMMON PLC		13	21	60	8,425
PRUDENTIAL PLC		84	146	180	25,063
RIO TINTO PLC		40	66	306	42,483
ST JAMES'S PLACE PLC		—	50	54	7,524
SSE PLC		36	68	92	12,782
BP PLC		656	1,153	265	36,756
LLOYDS BANKING GROUP PLC		2,385	3,755	115	16,012
TESCO PLC		330	495	108	15,023
SMITH & NEPHEW PLC		30	50	80	11,137
GLAXOSMITHKLINE PLC		166	289	413	57,263
WEIR GROUP PLC/THE		16	—	—	—
ASTRAZENECA PLC		44	79	659	91,309
BT GROUP PLC		273	572	60	8,398
CARNIVAL PLC		7	—	—	—
MARKS & SPENCER GROUP PLC		103	—	—	—
BARCLAYS PLC		577	1,030	132	18,341
INTERTEK GROUP PLC		5	11	69	9,675

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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BURBERRY GROUP PLC	15	23	36	5,086	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	5	9	63	8,728	小売
KINGFISHER PLC	84	187	52	7,272	小売
ITV PLC	180	—	—	—	メディア・娯楽
G4S PLC	84	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	10	16	45	6,286	保険
CENTRICA PLC	273	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	137	214	242	33,655	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	125	220	241	33,383	エネルギー
BUNZL PLC	15	24	59	8,181	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	86	142	77	10,773	商業・専門サービス
London Stock Exchange Group PLC	11	19	162	22,575	各種金融
UNILEVER PLC	35	66	313	43,460	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC	27	52	156	21,672	商業・専門サービス
MONDI PLC	18	32	54	7,546	素材
SEVERN TRENT PLC	12	19	48	6,710	公益事業
Whitbread PLC	6	20	56	7,772	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12	21	33	4,669	各種金融
SMITHS GROUP PLC	19	30	44	6,105	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	42	80	164	22,748	素材
3I GROUP PLC	42	73	77	10,723	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23	43	293	40,677	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	60	96	176	24,480	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	405	659	118	16,449	素材
NATWEST GROUP PLC	220	393	54	7,509	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	42	83	57	7,938	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	44	114	82	11,462	メディア・娯楽
COMPASS GROUP PLC	53	103	142	19,707	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	103	195	183	25,443	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	110	192	49	6,866	各種金融
BHP GROUP PLC	74	119	194	26,922	素材
VODAFONE GROUP PLC	907	1,534	172	23,826	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8	16	77	10,776	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	6	9	60	8,386	素材
FERGUSON PLC	7	12	105	14,636	資本財
M&G PLC	144	220	38	5,396	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	43	55	35	4,962	保険
INFORMA PLC	—	151	84	11,697	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	5	66	9,247	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	65	81	23	3,294	保険
MELROSE INDUSTRIES PLC	227	382	55	7,747	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	7	13	30	4,276	素材
小計	株数・金額	10,124	16,320	8,471	1,173,432
	銘柄数<比率>	69	66	—	<4.2%>
(スイス)			千スイスフラン		
SGS SA	0.16	0.33	81	9,337	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.15	0.24	47	5,491	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM AG-REG	1	1	88	10,162	電気通信サービス
Lindt & Spruengli AG	0.06	0.11	83	9,583	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	0.25	0.52	194	22,408	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4	7	257	29,699	保険
NOVARTIS AG-REG SHS	70	128	991	114,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
ABB LTD		57	95	238	27,433	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS		22	41	1,285	147,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG(REG)		5	13	70	8,157	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		14	23	104	11,992	素材
CLARIANT AG-REG		14	21	37	4,339	素材
NESTLE SA-REGISTERED		99	171	1,804	207,857	食品・飲料・タバコ
Baloise Holding AG		2	4	58	6,714	保険
TEMENOS GROUP AG-REG		3	5	62	7,181	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG		2	4	102	11,780	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG		0.47	0.91	98	11,359	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG		95	146	150	17,311	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B		1	2	55	6,425	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG		2	4	306	35,271	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG		1	2	84	9,731	保険
SWISS PRIME SITE		—	6	54	6,285	不動産
PARTNERS GROUP HOLDING AG		0.82	1	112	12,958	各種金融
Schindler Holding AG		1	1	45	5,277	資本財
Schindler Holding AG		1	2	56	6,551	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		2	4	79	9,142	運輸
Logitech International SA		—	13	101	11,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEBERIT AG-REG		1	1	85	9,807	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD		10	19	93	10,819	各種金融
SWISS RE AG		9	16	126	14,599	保険
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		16	27	213	24,630	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG		4	8	205	23,662	素材
ALCON INC		12	29	178	20,557	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG		121	210	258	29,791	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	581	1,020	7,817	900,264	
	銘 柄 数 < 比 率 >	32	34	—	< 3.2% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		61	108	957	11,670	銀行
Swedbank AB		34	56	861	10,507	銀行
SWEDISH MATCH AB		7	12	798	9,738	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS		13	26	372	4,534	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS		11	20	1,195	14,570	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B		26	55	940	11,463	小売
ERICSSON LM-B SHS		97	174	1,868	22,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA COMPANY AB		101	189	674	8,217	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		15	22	471	5,745	資本財
LUNDIN ENERGY AB		11	15	313	3,825	エネルギー
ALFA LAVAL AB		10	20	406	4,953	資本財
Millicom International Cellular SA		3	—	—	—	電気通信サービス
Husqvarna AB		24	49	450	5,496	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES		15	24	501	6,117	資本財
VOLVO AB-B SHS		33	80	1,598	19,489	資本財
SANDVIK AB		30	57	1,024	12,482	資本財
Industrivarden AB		10	15	393	4,792	各種金融
HEXAGON AB-B SHS		8	17	1,213	14,791	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS		26	48	527	6,429	電気通信サービス
KINNEVIK AB-B		14	—	—	—	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		15	30	1,313	16,013	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		18	32	1,211	14,766	資本財

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		評 価 額
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
EPIROC AB-A		24	32	477	5,823	資本財
EPIROC AB-B		22	34	490	5,981	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		19	33	907	11,064	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB		16	27	739	9,014	素材
EVOLUTION GAMING GROUP		—	10	710	8,666	消費者サービス
KINNEVIK AB-B		—	21	836	10,200	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		60	97	791	9,651	銀行
ASSA ABLOY AB-B		28	48	1,037	12,650	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	29	733	8,936	資本財
NORDEA BANK ABP		87	157	1,197	14,602	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	853	1,552	25,018	304,974	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	30	—	<1.1%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		32	—	—	—	銀行
TELENOR ASA		30	51	807	9,388	電気通信サービス
EQUINOR ASA		26	62	837	9,734	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		6	9	337	3,926	素材
MOWI ASA		—	30	546	6,354	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		89	149	467	5,430	素材
ORKLA ASA		32	56	509	5,915	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		15	15	307	3,576	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		8	16	545	6,342	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	242	392	4,360	50,666	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		4	7	659	11,013	食品・飲料・タバコ
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.27	0.48	516	8,628	運輸
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.2	0.2	197	3,296	運輸
DANSKE BANK A/S		27	48	455	7,608	銀行
GENMAB A/S		—	4	1,149	19,186	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		6	12	1,425	23,785	資本財
H LUNDBECK A/S		5	12	246	4,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A/S		7	13	1,395	23,288	運輸
PANDORA A/S		4	7	427	7,128	耐久消費財・アパレル
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		4	7	493	8,232	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		7	13	499	8,343	素材
COLOPLAST-B		5	7	688	11,492	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B		58	99	4,278	71,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S		7	12	1,333	22,251	公益事業
DEMANT A/S		7	11	268	4,485	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	146	259	14,035	234,253	
	銘 柄 数 < 比 率 >	14	15	—	<0.8%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD		87	155	299	22,931	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION		107	203	360	27,619	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		—	115	203	15,580	素材
TELSTRA CORP LTD		179	286	81	6,262	電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED		35	51	65	5,004	食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE		9	15	127	9,771	各種金融
BHP GROUP LIMITED		102	168	604	46,291	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		12	—	—	—	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED		27	47	62	4,815	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	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		
CSL LIMITED	15	27	829	63,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	97	175	253	19,375	運輸	
COCHLEAR LIMITED	2	6	137	10,555	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	68	134	58	4,444	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	56	100	706	54,087	銀行	
RIO TINTO LIMITED	13	20	198	15,220	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	88	131	66	5,061	保険	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5	—	—	—	消費者サービス	
ORICA LTD	20	31	50	3,876	素材	
LENDLEASE GROUP	28	51	66	5,079	不動産	
SUNCORP GROUP LTD	55	103	88	6,761	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	91	188	372	28,554	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	29	49	151	11,635	素材	
INCITEC PIVOT LTD	86	—	—	—	素材	
AMP LIMITED	154	365	62	4,791	各種金融	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	55	105	97	7,471	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	62	105	8,113	素材	
SANTOS LTD	83	151	75	5,813	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	24	40	149	11,468	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	118	284	113	8,667	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	33	59	288	22,071	小売	
ALUMINA LTD	189	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	25	58	107	8,257	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	38	70	276	21,175	食品・生活必需品小売り	
SEEK LTD	18	41	96	7,367	メディア・娯楽	
BRAMBLES LTD	52	107	113	8,707	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	11	20	284	21,800	各種金融	
CROWN RESORTS LIMITED	33	—	—	—	消費者サービス	
EVOLUTION MINING LTD	—	163	105	8,058	素材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	31	56	50	3,893	食品・飲料・タバコ	
SYDNEY AIRPORT	63	100	60	4,647	運輸	
AFTERPAY LTD	—	17	182	13,940	ソフトウェア・サービス	
AMPOL LTD	—	18	49	3,813	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	25	30	39	3,010	公益事業	
SOUTH32 LTD	234	469	103	7,905	素材	
COLES GROUP LTD	40	83	155	11,914	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,453	4,371	7,305	559,295	
	銘柄 数 < 比 率 >	40	40	—	< 2.0% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	27	46	69	5,008	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	29	53	82	5,935	食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	38	141	10,183	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	85	112	52	3,760	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	40	84	60	4,325	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	93	114	67	4,861	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	276	451	474	34,075	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	18	40	317	4,309	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	116	174	254	3,459	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	50	105	766	10,401	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	40	78	3,024	41,047	各種金融	

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
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
MTR CORPORATION		80	125	496	6,734	運輸
HANG SENG BANK		24	44	556	7,547	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		84	154	455	6,176	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED		50	90	363	4,927	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS		309	773	891	12,095	公益事業
Galaxy Entertainment Group Limited		100	180	1,059	14,374	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		155	270	618	8,390	銀行
NWS HOLDINGS LTD		145	—	—	—	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		60	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SINO LAND CO		218	358	334	4,542	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		60	65	644	8,749	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A		30	70	264	3,595	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		65	100	1,108	15,035	資本財
AIA GROUP LTD		408	718	5,909	80,187	保険
HKT Trust / HKT Ltd		230	370	367	4,990	電気通信サービス
Sands China Ltd		112	240	732	9,933	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		88	126	272	3,701	不動産
WH Group Limited		375	655	421	5,715	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		93	143	722	9,799	資本財
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)		45	70	268	3,647	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		98	178	679	9,217	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,054	5,127	20,529	278,579	
(シンガポール)		25	23	—	<1.0%>	
SINGAPORE TECH ENGINEERING		113	194	70	5,485	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD		55	89	204	15,954	銀行
CITY DEVELOPMENTS		39	86	57	4,473	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		138	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		43	215	73	5,760	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		31	56	115	9,032	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		49	71	46	3,638	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		165	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		217	579	124	9,723	電気通信サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		79	130	118	9,240	銀行
KEPPEL CORP LTD		84	159	74	5,849	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		341	856	59	4,613	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,354	2,435	944	73,771	
(イスラエル)		12	10	—	<0.3%>	
BANK HAPOLIM BM		37	86	185	5,798	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		51	102	176	5,525	銀行
ICL GROUP LTD		35	35	45	1,417	素材
NICE LTD		2	4	382	11,938	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		7	18	132	4,134	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	133	246	922	28,815	
(イスラエル)		5	5	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	35,982	62,448	—	26,309,192	
		967	978	—	<94.8%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

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

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 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	116	12,270	0.0
AMERICAN TOWER CORP		1	2	618	65,073	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		0.412	0.607	99	10,517	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		0.42	0.824	73	7,695	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		0.448	0.66	65	6,846	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP		1	2	400	42,126	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC		0.705	1	220	23,194	0.1
DUKE REALTY CORP		1	2	93	9,826	0.0
EQUINIX INC		0.297	0.535	397	41,833	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC		0.841	1	79	8,373	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		1	1	113	11,924	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.245	0.381	96	10,199	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		0.591	0.93	99	10,461	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST		0.34	0.502	45	4,838	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		1	3	107	11,331	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		2	5	74	7,805	0.0
IRON MOUNTAIN INC		1	2	54	5,747	0.0
KIMCO REALTY CORP		1	—	—	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST		0.769	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		—	4	85	9,022	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC		0.498	0.834	104	11,021	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		0.819	1	56	5,942	0.0
PROLOGIS INC		2	4	424	44,613	0.2
PUBLIC STORAGE		0.463	0.842	186	19,673	0.1
REALTY INCOME CORP		0.909	1	120	12,663	0.0
REGENCY CENTERS CORP		0.832	1	60	6,411	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		0.43	0.686	204	21,469	0.1
SL GREEN REALTY CORP		0.346	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC		0.894	1	145	15,345	0.1
SUN COMMUNITIES INC		—	0.761	103	10,848	0.0
UDR INC		1	2	79	8,332	0.0
VENTAS INC		1	2	127	13,377	0.0
VORNADO REALTY TRUST		0.624	1	45	4,762	0.0
WP CAREY INC		0.771	1	91	9,623	0.0
WELLTOWER INC		1	2	168	17,701	0.1
WEYERHAEUSER CO		2	4	130	13,698	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	32	61	4,890	514,578	
	銘 柄 数 < 比 率 >	33	33	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		1	2	37	3,061	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1	2	37	3,061	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE	1	1	22	2,766	0.0
GECINA SA	0.19	0.267	34	4,290	0.0
COVIVIO	0.315	0.366	22	2,763	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.387	1	50	6,312	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	3	129	16,132
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	4	6	30	4,255	0.0
SEGRO PLC	5	7	71	9,849	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	4	30	4,283	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	13	19	132	18,387
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千豪ドル		
MIRVAC GROUP	16	28	67	5,177	0.0
GPT GROUP	8	14	63	4,895	0.0
STOCKLAND	10	19	87	6,663	0.0
DEXUS	4	7	65	4,982	0.0
GOODMAN GROUP	5	10	207	15,865	0.1
SCENTRE GROUP	17	35	84	6,503	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	63	116	575	44,088
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<0.2%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	6	15	1,001	13,593	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6	15	1,001	13,593
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	17	47	90	7,079	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	17	47	90	7,079
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	136	266	—	616,921
	銘 柄 数 < 比 率 >	49	49	—	<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		百万円	百万円
		S&P 500 EMIN	559	—
		DJ EU STX 50	126	—
		FTSE 100 IDX	102	—

(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

(2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	26,309,192	94.4
投資証券	616,921	2.2
コール・ローン等、その他	946,600	3.4
投資信託財産総額	27,872,713	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産（27,707,241千円）の投資信託財産総額（27,872,713千円）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=105.21円、1カナダドル=80.83円、1ユーロ=124.27円、1英ポンド=138.52円、1スイスフラン=115.16円、1スウェーデンクローナ=12.19円、1ノルウェークローネ=11.62円、1デンマーククローネ=16.69円、1豪ドル=76.56円、1ニュージーランドドル=71.81円、1香港ドル=13.57円、1シンガポールドル=78.11円、1イスラエルシェケル=31.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末 円
(A) 資産	27,872,713,349
コール・ローン等	516,432,101
株式(評価額)	26,309,192,624
投資証券(評価額)	616,921,338
未収入金	39,659,716
未収配当金	20,274,280
差入委託証拠金	370,233,290
(B) 負債	129,583,633
未払解約金	129,583,452
未払利息	181
(C) 純資産総額(A－B)	27,743,129,716
元本	9,631,640,362
次期繰越損益金	18,111,489,354
(D) 受益権総口数	9,631,640,362口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,804円

(注) 当親ファンドの期首元本額は5,410,289,257円、期中追加設定元本額は5,689,619,244円、期中一部解約元本額は1,468,268,139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	8,504,508,009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>	806,265,359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>	102,870,450円
TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	72,154,992円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	68,978,866円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	18,861,257円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	17,789,669円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	12,641,435円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	9,390,477円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	5,886,369円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	4,220,755円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	3,066,669円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	2,681,751円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	2,324,304円

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

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

○損益の状況 (2019年11月12日～2020年11月10日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	354,097,089
受取配当金	351,790,667
受取利息	386,715
その他収益金	1,962,216
支払利息	△ 42,509
(B) 有価証券売買損益	2,150,357,217
売買益	4,074,243,949
売買損	△ 1,923,886,732
(C) 先物取引等取引損益	126,326,334
取引益	303,848,413
取引損	△ 177,522,079
(D) 保管費用等	△ 12,646,522
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,618,134,118
(F) 前期繰越損益金	8,920,807,923
(G) 追加信託差損益金	8,894,718,959
(H) 解約差損益金	△ 2,322,171,646
(I) 計(E+F+G+H)	18,111,489,354
次期繰越損益金(I)	18,111,489,354

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

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

○お知らせ

2020年10月24日付で、ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないことを明確にするため、所要の約款変更を行いました。

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2020年11月10日）

（計算期間 2019年11月12日～2020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		債 組 入 比	純 資 産 額
	騰 落	中 率	騰 落	中 率		
	円	%		%	%	百万円
11期(2016年11月10日)	14,050	△11.0	243.067	△10.6	98.6	103,516
12期(2017年11月10日)	15,662	11.5	269.321	10.8	98.6	46,126
13期(2018年11月12日)	15,274	△2.5	262.755	△2.4	98.9	4,169
14期(2019年11月11日)	15,809	3.5	272.101	3.6	97.7	4,542
15期(2020年11月10日)	16,671	5.5	287.164	5.5	98.8	6,878

○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		債 組 入 比	券 率
	騰 落	率	騰 落	率		
(期 首)	円	%		%		%
2019年11月11日	15,809	—	272.101	—	97.7	
11月末	15,989	1.1	275.243	1.2	96.6	
12月末	16,061	1.6	276.470	1.6	98.7	
2020年1月末	16,197	2.5	278.723	2.4	98.4	
2月末	16,387	3.7	281.924	3.6	97.6	
3月末	16,394	3.7	282.047	3.7	98.7	
4月末	16,094	1.8	277.083	1.8	98.2	
5月末	16,330	3.3	281.271	3.4	97.7	
6月末	16,591	4.9	285.877	5.1	97.5	
7月末	16,754	6.0	288.729	6.1	98.7	
8月末	16,735	5.9	288.410	6.0	98.5	
9月末	16,809	6.3	289.800	6.5	98.4	
10月末	16,559	4.7	285.441	4.9	98.0	
(期 末)						
2020年11月10日	16,671	5.5	287.164	5.5	98.8	

(注) 騰落率は期首比です。

ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、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を用いて計算しているため、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

○運用経過

(2019年11月12日～2020年11月10日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：15,809円

期 末：16,671円

騰落率： 5.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国債を中心に世界的に国債利回りが低下したこと（債券価格は上昇）
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・世界的な景気減速懸念の高まりなどによる円高の進行

■投資環境

【外国債券市場動向】

米国債利回りは低下しました。期前半は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による緊急利下げや無制限での量的緩和により米国債利回りは大きく低下しました。期後半も、2020年7月に米国で新型コロナウイルスの感染拡大ペースが加速したことに加えて、FRBが2%以上の物価上昇率を許容することや2023年までゼロ金利政策の維持を明確にしたことで、米国債利回りは一段と低下しました。期末にかけては、米国の経済指標の改善や米国大統領選挙後の次期政権の財政拡大に対する期待から米国債利回りは上昇基調に転じましたが、期を通してみると低下しました。

ドイツ国債利回りは低下しました。欧州において新型コロナウイルスの感染が拡大し、ユーロ圏の経済指標が悪化したことで、ドイツ国債利回りは大きく低下しました。その後、欧州各国で経済活動が段階的に再開されたことによりドイツ国債利回りは上昇基調で推移する場面もありましたが、欧州での新型コロナウイルスの感染再拡大や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念が高まるなか、ドイツ国債利回りは低下傾向が続き、前期末対比低下した水準で期を終えました。

【外国為替市場動向】

当期、米ドル円相場は円高米ドル安、ユーロ円相場は円安ユーロ高となりました。

期初、米ドル円相場は米中貿易協議の進展に伴い円安米ドル高傾向で推移しましたが、新型コロナウイルスの感染拡大を受けてFRBが緊急利下げや大規模な資産購入を発表すると円高米ドル安が大きく進行しました。また、FRBによる2023年までのゼロ金利政策維持の表明や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大により米ドル安傾向が続き、前期末対比円高米ドル安の水準で期を終えました。

ユーロ円相場は、欧州復興基金の設立などが好感されたほか、対米ドルでユーロ高が進行したこともあり前期末対比円安ユーロ高の水準で期を終えました。



(注) ベンチマークは、期首(2019年11月11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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は5.5%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+5.5%に対して、基準価額の騰落率は+5.5%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

（主な差異要因）

プラス要因

・保有債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

マイナス要因

・取引や保管などに係るコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^(※)は、10月末現在、推定値で0.10%となっています。

※2020年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するように運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

（2019年11月12日～2020年11月10日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.018	(a)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 ）	(3)	(0.018)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	3	0.018	
期中の平均基準価額は、16,408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。

公社債

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(2019年11月12日～2020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

(2020年11月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うち80格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	25,850	27,995	2,945,442	42.8	—	18.9	16.6	7.3
カナダ	千カナダドル 1,600	千カナダドル 1,732	140,031	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 9,700	千メキシコペソ 10,906	56,275	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	3,500	4,208	523,009	7.6	—	4.8	1.9	0.9
イタリア	4,300	5,188	644,811	9.4	—	6.3	2.1	1.0
フランス	4,700	5,769	716,979	10.4	—	7.9	2.0	0.6
オランダ	800	1,064	132,288	1.9	—	1.3	0.4	0.2
スペイン	2,800	3,431	426,418	6.2	—	4.4	1.4	0.4
ベルギー	1,100	1,458	181,249	2.6	—	2.1	0.4	0.2
オーストリア	600	767	95,352	1.4	—	1.0	0.2	0.2
フィンランド	300	348	43,259	0.6	—	0.4	0.2	—
アイルランド	400	463	57,646	0.8	—	0.6	0.2	—
イギリス	千英ポンド 2,340	千英ポンド 3,185	441,268	6.4	—	5.4	0.6	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,600	千スウェーデンクローナ 1,759	21,452	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 1,100	千ノルウェークローネ 1,172	13,618	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,600	千デンマーククローネ 2,039	34,034	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 1,400	千ポーランドズロチ 1,512	41,881	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル 2,100	千豪ドル 2,388	182,864	2.7	—	1.9	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 400	千シンガポールドル 461	36,043	0.5	—	0.5	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 1,300	千マレーシアリンギット 1,415	36,203	0.5	—	0.4	0.1	0.0
イスラエル	千イスラエルシェケル 700	千イスラエルシェケル 834	26,057	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	6,796,189	98.8	—	58.4	28.2	12.2

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 0 1/2 04/30/27	0.5	100	99	10,423	2027/4/30
T 0 1/2 05/31/27	0.5	200	197	20,826	2027/5/31
T 0 1/2 06/30/27	0.5	100	98	10,404	2027/6/30
T 0 1/2 08/31/27	0.5	200	197	20,774	2027/8/31
T 0 1/4 04/15/23	0.25	100	100	10,528	2023/4/15
T 0 1/4 05/31/25	0.25	200	198	20,895	2025/5/31
T 0 1/4 06/15/23	0.25	200	200	21,048	2023/6/15
T 0 1/4 06/30/25	0.25	300	297	31,321	2025/6/30
T 0 1/4 07/31/25	0.25	100	99	10,435	2025/7/31
T 0 1/4 08/31/25	0.25	300	297	31,289	2025/8/31
T 0 1/4 09/30/25	0.25	200	198	20,846	2025/9/30
T 0 1/8 04/30/22	0.125	100	99	10,512	2022/4/30
T 0 1/8 05/15/23	0.125	200	199	20,991	2023/5/15
T 0 1/8 05/31/22	0.125	100	99	10,510	2022/5/31
T 0 1/8 06/30/22	0.125	200	199	21,018	2022/6/30
T 0 1/8 07/15/23	0.125	200	199	20,977	2023/7/15
T 0 1/8 07/31/22	0.125	300	299	31,528	2022/7/31
T 0 1/8 08/15/23	0.125	100	99	10,486	2023/8/15
T 0 1/8 09/15/23	0.125	100	99	10,482	2023/9/15
T 0 1/8 09/30/22	0.125	200	199	21,015	2022/9/30
T 0 1/8 10/15/23	0.125	300	298	31,449	2023/10/15
T 0 3/8 03/31/22	0.375	300	300	31,649	2022/3/31
T 0 3/8 04/30/25	0.375	100	99	10,511	2025/4/30
T 0 3/8 07/31/27	0.375	200	196	20,622	2027/7/31
T 0 3/8 09/30/27	0.375	200	195	20,581	2027/9/30
T 0 5/8 05/15/30	0.625	300	291	30,677	2030/5/15
T 0 5/8 08/15/30	0.625	200	193	20,392	2030/8/15
T 1 1/2 01/31/27	1.5	200	210	22,181	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	300	315	33,227	2030/2/15
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	102	10,830	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	103	10,841	2023/3/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	200	204	21,548	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/24	1.5	100	104	10,994	2024/9/30
T 1 1/2 10/31/24	1.5	300	313	33,000	2024/10/31
T 1 1/2 11/30/24	1.5	200	209	22,013	2024/11/30
T 1 1/4 05/15/50	1.25	200	176	18,610	2050/5/15
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	102	10,811	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	100	103	10,887	2024/8/31
T 1 1/8 02/28/22	1.125	100	101	10,651	2022/2/28
T 1 1/8 05/15/40	1.125	100	93	9,850	2040/5/15
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	310	32,643	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	510	53,685	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	409	43,080	2022/5/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	519	54,610	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	315	33,229	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	205	21,658	2022/9/30
T 1 3/4 11/15/29	1.75	300	322	33,947	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/24	1.75	200	211	22,242	2024/12/31
T 1 3/4 12/31/26	1.75	300	320	33,757	2026/12/31
T 1 3/8 01/31/22	1.375	300	304	32,026	2022/1/31
T 1 3/8 01/31/25	1.375	100	104	10,964	2025/1/31
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	205	21,591	2023/2/15
T 1 3/8 08/15/50	1.375	200	182	19,218	2050/8/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	102	10,760	2022/10/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	635	66,854	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	211	22,301	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	512	53,940	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	212	22,398	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	212	22,330	2026/9/30
T 1 5/8 11/15/22	1.625	100	102	10,822	2022/11/15
T 1 5/8 11/30/26	1.625	200	212	22,335	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	102	10,834	2022/12/15
T 1 5/8 12/31/21	1.625	500	508	53,480	2021/12/31
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	204	21,507	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	107	11,307	2026/7/31
T 2 02/15/22	2.0	500	511	53,825	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	312	32,832	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	213	22,483	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	100	106	11,181	2050/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	106	11,164	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	859	90,388	2025/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	214	22,551	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	117	12,351	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	538	56,636	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	117	12,362	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	318	33,530	2023/8/15
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	110	11,616	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	224	23,593	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	100	112	11,787	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	860	90,546	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	442	46,542	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	323	34,004	2025/5/15
T 2 11/15/26	2.0	100	108	11,402	2026/11/15
T 2 11/30/22	2.0	400	414	43,635	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	685	72,165	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	106	11,239	2023/7/31

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	645	67,880	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	244	25,709	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	111	11,685	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	112	11,846	2029/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	215	22,661	2024/8/15
T 2 3/8 11/15/49	2.375	100	115	12,101	2049/11/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	111	11,687	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	114	12,036	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	109	11,543	2025/3/31
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	115	12,152	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	124	13,119	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	222	23,387	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	111	11,728	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	115	12,182	2028/8/15
T 2 7/8 08/15/45	2.875	100	125	13,165	2045/8/15
T 3 02/15/47	3.0	300	385	40,583	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	200	257	27,126	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	517	54,485	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	128	13,535	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	129	13,589	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	129	13,622	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	131	13,873	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	389	40,985	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/28	3.125	200	236	24,836	2028/11/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	129	13,588	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	383	40,371	2045/11/15
T 3 3/8 11/15/48	3.375	100	137	14,517	2048/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	139	14,695	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	139	14,665	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	200	283	29,845	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	148	15,654	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	158	16,638	2041/2/15
T 4 3/8 05/15/40	4.375	100	150	15,834	2040/5/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	149	15,776	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	77	8,201	2037/5/15
T 5 3/8 02/15/31	5.375	100	143	15,105	2031/2/15
小 計				2,945,442	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0 1/2 03/01/22	0.5	100	100	8,110	2022/3/1
CAN 0 1/2 09/01/25	0.5	100	100	8,089	2025/9/1
CAN 0 1/2 12/01/30	0.5	100	98	7,952	2030/12/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	103	8,386	2027/6/1
CAN 1 09/01/22	1.0	200	202	16,385	2022/9/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
国債証券					
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	103	8,335	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	105	8,525	2026/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	103	8,366	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	104	8,437	2030/6/1
CAN 2 09/01/23	2.0	100	104	8,464	2023/9/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	107	8,696	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	112	9,128	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	103	8,397	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	133	10,791	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	148	11,963	2045/12/1
小 計				140,031	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	267	1,377	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	714	3,687	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	410	2,119	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	619	3,196	2022/6/9
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	105	542	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	1,700	1,892	9,764	2027/6/3
MBONO 7 1/4 12/09/21	7.25	100	103	532	2021/12/9
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	339	1,752	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	437	2,256	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	225	1,161	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,445	7,458	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,777	9,174	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	400	471	2,431	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	400	450	2,326	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	1,500	1,646	8,494	2023/12/7
小 計				56,275	
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 0 03/11/22	—	200	201	25,090	2022/3/11
BKO 0 09/16/22	—	100	101	12,597	2022/9/16
DBR 0 02/15/30	—	100	105	13,071	2030/2/15
DBR 0 05/15/35	—	100	104	12,999	2035/5/15
DBR 0 08/15/26	—	100	104	12,951	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	105	13,073	2029/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	105	13,104	2025/2/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	106	13,250	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	106	13,183	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	107	13,331	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	300	321	39,902	2028/8/15
DBR 0 11/15/27	—	100	104	13,004	2027/11/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	108	13,482	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	105	13,071	2023/2/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	104	12,937	2022/9/4
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	137	17,140	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	104	12,939	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	165	20,513	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	169	21,027	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	177	22,058	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	172	21,384	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	172	21,474	2034/7/4
DBR 4.25 07/04/39	4.25	100	187	23,263	2039/7/4
DBR 5.5 01/04/31	5.5	100	163	20,263	2031/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	149	18,531	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	200	205	25,505	2024/4/5
OBL 0 04/11/25	—	100	103	12,838	2025/4/11
OBL 0 10/13/23	—	200	204	25,420	2023/10/13
OBL 0 10/18/24	—	200	205	25,595	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.3 08/15/23	0.3	200	202	25,224	2023/8/15
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	100	101	12,605	2025/2/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	200	206	25,684	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	102	12,781	2023/3/1
BTPS 0.95 08/01/30	0.95	100	102	12,752	2030/8/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	106	13,244	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	200	204	25,458	2022/4/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	106	13,173	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	215	26,772	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	108	13,544	2032/3/1
BTPS 1.65 12/01/30	1.65	100	109	13,552	2030/12/1
BTPS 1.85 07/01/25	1.85	100	108	13,437	2025/7/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	111	13,816	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	116	14,455	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	109	13,603	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	102	12,783	2021/12/15
BTPS 2.7 03/01/47	2.7	100	125	15,563	2047/3/1
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	127	15,807	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	200	241	29,983	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	125	15,648	2030/3/1
BTPS 3 1/4 09/01/46	3.25	100	136	17,007	2046/9/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	114	14,236	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	130	16,228	2035/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	141	17,571	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	115	14,339	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	111	13,903	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	113	14,136	2023/8/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	132	16,458	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	165	20,564	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	151	18,766	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	161	20,114	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	163	20,320	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	223	27,724	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	155	19,382	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	152	18,969	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	141	17,621	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	141	17,571	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	200	203	25,235	2023/2/25
FRTR 0 02/25/26	—	200	206	25,615	2026/2/25
FRTR 0 03/25/24	—	100	102	12,710	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	200	205	25,559	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	106	13,178	2026/5/25
FRTR 0 1/2 05/25/40	0.5	100	106	13,177	2040/5/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	206	25,604	2029/11/25
FRTR 0 11/25/30	—	100	101	12,674	2030/11/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	300	324	40,364	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	300	330	41,035	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	237	29,486	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	130	16,198	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	200	234	29,126	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	119	14,826	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	108	13,452	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	106	13,203	2023/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	129	16,032	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	219	27,299	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	141	17,564	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	200	254	31,654	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	317	39,441	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	245	30,505	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	170	21,135	2045/5/25
FRTR 4 04/25/55	4.0	100	213	26,469	2055/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	170	21,190	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	170	21,193	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	114	14,264	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	301	37,507	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	172	21,403	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	133	16,581	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	187	23,288	2041/4/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHER 0 01/15/22	—	100	100	12,532	2022/1/15
NETHER 0 01/15/27	—	100	102	12,704	2027/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	110	13,673	2024/7/15
NETHER 2 1/2 01/15/33	2.5	100	135	16,817	2033/1/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	184	22,870	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	169	21,057	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	144	17,952	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	118	14,681	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	200	203	25,241	2025/1/31
SPGB 0 04/30/23	—	100	101	12,581	2023/4/30
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	101	12,673	2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	104	12,994	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	200	213	26,483	2027/7/30
SPGB 1.2 10/31/40	1.2	100	110	13,747	2040/10/31
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	109	13,572	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	111	13,816	2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	110	13,765	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	119	14,791	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	112	13,954	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	234	29,178	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	112	14,005	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	112	14,015	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	124	15,464	2033/7/30
SPGB 2.9 10/31/46	2.9	100	145	18,101	2046/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	157	19,515	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	114	14,260	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	175	21,861	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	117	14,552	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	177	22,070	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	163	20,273	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	141	17,550	2028/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	107	13,403	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	149	18,543	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	103	12,905	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	12,749	2023/10/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	107	13,391	2027/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	108	13,537	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	113	14,077	2031/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	134	16,680	2047/6/22
BGB 3 3/4 06/22/45	3.75	100	180	22,443	2045/6/22

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	179	22,357	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	109	13,596	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	173	21,516	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	144	17,994	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	—	100	101	12,594	2022/9/20
RAGB 0 1/2 02/20/29	0.5	100	108	13,422	2029/2/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	108	13,435	2026/10/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	107	13,337	2023/10/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	172	21,442	2044/6/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	169	21,119	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	108	13,427	2028/9/15
RFBG 1 1/8 04/15/34	1.125	100	118	14,675	2034/4/15
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	121	15,157	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 0.2 10/18/30	0.2	100	104	12,956	2030/10/18
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	117	14,643	2033/5/15
IRISH 1.35 03/18/31	1.35	100	115	14,369	2031/3/18
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	126	15,676	2025/3/13
ユ ー ロ 計				2,821,015	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 1/8 01/30/26	0.125	100	100	13,868	2026/1/30
UKT 0 5/8 10/22/50	0.625	100	90	12,601	2050/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	103	14,335	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	112	15,577	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	107	14,857	2027/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	200	206	28,587	2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	114	15,928	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	111	15,375	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	109	15,169	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	106	14,741	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	154	21,467	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	200	27,802	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	148	20,520	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	176	24,448	2052/7/22
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	171	23,794	2042/12/7
UKT 4 1/4 03/07/36	4.25	100	151	20,956	2036/3/7
UKT 4 1/4 09/07/39	4.25	100	159	22,111	2039/9/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	38	5,352	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	162	22,477	2040/12/7

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千英ポンド	千英ポンド	千円	
(イギリス) 国債証券	%				
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	175	24,358	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	183	25,411	2049/12/7
UKT 4 3/4 12/07/30	4.75	100	143	19,823	2030/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	142	19,679	2032/6/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,018	2028/12/7
小 計				441,268	
(スウェーデン) 国債証券		千クローナ	千クローナ		
SGB 0 1/8 05/12/31	0.125	100	101	1,231	2031/5/12
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	200	213	2,601	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	200	214	2,616	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	300	316	3,861	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	200	214	2,618	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	200	225	2,749	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	155	1,894	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	300	318	3,879	2022/6/1
小 計				21,452	
(ノルウェー) 国債証券		千クローネ	千クローネ		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	105	1,221	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	107	1,244	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	105	1,227	2025/3/13
NGB 1 3/4 09/06/29	1.75	100	108	1,261	2029/9/6
NGB 1 3/8 08/19/30	1.375	100	105	1,224	2030/8/19
NGB 2 04/26/28	2.0	100	109	1,274	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	300	312	3,636	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	200	217	2,528	2024/3/14
小 計				13,618	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク	千デンマーク		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	300	321	5,358	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	300	324	5,414	2029/11/15
DGB 0 1/4 11/15/22	0.25	200	203	3,397	2022/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	200	213	3,555	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	223	3,733	2025/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	400	753	12,574	2039/11/15
小 計				34,034	
(ポーランド) 国債証券		千ズロツ	千ズロツ		
POLGB 0 07/25/22	—	200	199	5,513	2022/7/25
POLGB 0 3/4 04/25/25	0.75	100	101	2,815	2025/4/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	200	210	5,835	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	107	2,984	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	110	3,064	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	111	3,078	2027/7/25

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
		千豪ドル	千豪ドル	千円	
(ポーランド) 国債証券	%				
POLGB 2 1/4 10/25/24	2.25	100	107	2,979	2024/10/25
POLGB 2 3/4 04/25/28	2.75	100	112	3,117	2028/4/25
POLGB 2 3/4 10/25/29	2.75	200	226	6,280	2029/10/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	113	3,146	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	110	3,064	2022/9/23
小 計				41,881	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 1 1/2 06/21/31	1.5	200	211	16,183	2031/6/21
ACGB 1 1/4 05/21/32	1.25	100	104	7,974	2032/5/21
ACGB 1 12/21/30	1.0	100	102	7,827	2030/12/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	115	8,808	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	112	8,577	2028/5/21
ACGB 2 12/21/21	2.0	100	102	7,812	2021/12/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	200	218	16,697	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	230	17,634	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/28	2.75	200	232	17,787	2028/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	116	8,953	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	124	9,546	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	113	8,675	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	121	9,324	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/21/33	4.5	100	140	10,738	2033/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	121	9,278	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	113	8,661	2023/4/21
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	109	8,384	2022/7/15
小 計				182,864	
(シンガポール) 国債証券		千シンガポール	千シンガポール		
SIGB 2 1/4 08/01/36	2.25	100	117	9,142	2036/8/1
SIGB 2 1/8 06/01/26	2.125	100	108	8,495	2026/6/1
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	235	18,405	2027/3/1
小 計				36,043	
(マレーシア) 国債証券		千マレーシア	千マレーシア		
MGS 2.632 04/15/31	2.632	100	99	2,542	2031/4/15
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	103	2,653	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	106	2,728	2027/5/31
MGS 3.828 07/05/34	3.828	100	108	2,771	2034/7/5
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	108	2,768	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	102	2,631	2022/3/10
MGS 3.885 08/15/29	3.885	100	109	2,789	2029/8/15
MGS 3.955 09/15/25	3.955	100	108	2,780	2025/9/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	107	2,753	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	110	2,825	2026/4/15
MGS 4.736 03/15/46	4.736	100	114	2,926	2046/3/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア) 国債証券	%	千円	千円	千円	
MGS 4.762 04/07/37	4.762	100	117	3,004	2037/4/7
MGS 5.248 09/28	5.248	100	118	3,026	2028/9/15
小 計				36,203	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	106	3,334	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	200	220	6,882	2027/3/31
ILGOV 2 1/4 09/28/28	—	100	111	3,492	2028/9/28
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	112	3,505	2023/3/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ILGOV 5 1/2 01/31/22	—	100	110	3,465	2022/1/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	172	5,377	2042/1/31
小 計				26,057	
合 計				6,796,189	

(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) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,796,189	98.4
コール・ローン等、その他	112,772	1.6
投資信託財産総額	6,908,961	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産 (6,867,158千円) の投資信託財産総額 (6,908,961千円) 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=105.21円、1カナダドル=80.83円、1メキシコペソ=5.16円、1ユーロ=124.27円、1英ポンド=138.52円、1スウェーデンクローナ=12.19円、1ノルウェークローネ=11.62円、1デンマーククローネ=16.69円、1ポーランドズロチ=27.69円、1豪ドル=76.56円、1シンガポールドル=78.11円、1マレーシアリンギット=25.58円、1イスラエルシェケル=31.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年11月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,908,961,580
コール・ローン等	69,569,760
公社債(評価額)	6,796,189,549
未収利息	40,325,109
前払費用	2,877,162
(B) 負債	30,232,462
未払解約金	30,232,417
未払利息	45
(C) 純資産総額(A－B)	6,878,729,118
元本	4,126,162,688
次期繰越損益金	2,752,566,430
(D) 受益権総口数	4,126,162,688口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,671円

(注) 当親ファンドの期首元本額は2,873,096,055円、期中追加設定元本額は2,083,380,530円、期中一部解約元本額は830,313,897円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国債券インデックス	2,934,373,285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>	671,465,206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>	205,686,377円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	113,758,392円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	110,288,088円
L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	26,530,967円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	24,672,262円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	13,691,530円
L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)	9,000,542円
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	6,373,645円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	4,842,031円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	2,687,879円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	1,531,889円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	1,260,595円

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

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

○損益の状況 (2019年11月12日～2020年11月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	115,871,550
受取利息	115,888,316
その他収益金	10,773
支払利息	△ 27,539
(B) 有価証券売買損益	166,732,775
売買益	315,128,638
売買損	△ 148,395,863
(C) 保管費用等	△ 1,019,425
(D) 当期損益金(A+B+C)	281,584,900
(E) 前期繰越損益金	1,668,989,368
(F) 追加信託差損益金	1,329,022,043
(G) 解約差損益金	△ 527,029,881
(H) 計(D+E+F+G)	2,752,566,430
次期繰越損益金(H)	2,752,566,430

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

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

○お知らせ

2020年10月24日付で、ヘッジ目的の場合等を除き、デリバティブ取引による運用を行っていないことを明確にするため、所要の約款変更を行いました。