

L P S 4 資産分散ファンド
(慎 重 型)
(安 定 重 視 型)
(バ ラ ン ス 型)
(成 長 重 視 型)
(積 極 型)
＜愛称 未来海図＞

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／インデックス型 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)				
信託期間	2009年9月2日から2021年5月28日				
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。				
主要投資対象	L P S 4 資産分散ファンド (慎 重 型) (安 定 重 視 型) (バ ラ ン ス 型) (成 長 重 視 型) (積 極 型)	「TMA日本株 T O P I X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」を主要投資対象とし ます。			
	TMA日本株 T O P I X マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式			
	TMA日本債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債			
	TMA外国株式インデックス マザーファンド	外国の株式			
	TMA外国債券インデックス マザーファンド	外国の公社債			
投資制限	(慎 重 型)	株 式 へ の 実 質 制 投 資 割 合	30%以下	外 債 建 外 資 へ 実 質 割 投 資 割	40%以下
	(安 定 重 視 型)		40%以下		60%以下
	(バ ラ ン ス 型)		60%以下		60%以下
	(成 長 重 視 型)		70%以下		70%以下
	(積 極 型)		制限なし		75%以下
分配方針	毎決算時に、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11期 運用報告書（全体版）

（決算日 2020年 5 月28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、「L P S 4 資産分散ファンド (慎
重型) (安定重視型) (バランス型) (成
長重視型) (積極型) ＜愛称 未来海
図＞」は、このたび、第11期の決算を
行いましたので、期中の運用状況をご
報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜ります
よう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内 1－8－2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の 9 時～17 時

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

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

○最近5期の運用実績

＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投資信託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
				期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月30日)	12,729	0	0.6	13,198	1.2	12.7	0.4	85.9	0.1	49
8期(2017年5月29日)	12,771	0	0.3	13,304	0.8	12.6	0.5	86.4	0.1	65
9期(2018年5月28日)	13,026	0	2.0	13,626	2.4	13.8	1.1	83.9	0.1	72
10期(2019年5月28日)	13,079	0	0.4	13,742	0.9	13.7	0.5	84.5	0.2	82
11期(2020年5月28日)	13,200	0	0.9	13,937	1.4	17.4	1.3	80.3	0.2	82

(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。

＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投資信託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
				期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月30日)	13,587	0	△3.2	13,977	△2.8	23.3	0.7	75.0	0.3	48
8期(2017年5月29日)	13,928	0	2.5	14,377	2.9	22.1	0.8	76.0	0.2	40
9期(2018年5月28日)	14,423	0	3.6	14,924	3.8	24.8	2.0	71.5	0.2	83
10期(2019年5月28日)	14,372	0	△0.4	14,926	0.0	24.8	0.9	72.9	0.3	87
11期(2020年5月28日)	14,627	0	1.8	15,236	2.1	28.8	2.1	68.0	0.3	91

(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。

ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）、NOMURA-BPI（総合）、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）を基本資産配分で組み合わせ合わせた合成指数です。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、MSCIコクサイ指数は、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、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）を使用しています。
各ファンドの決算日時点の基本資産配分は10ページをご参照ください。

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	投資信託 証券組入比率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 騰 落	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月30日)	14,536	0	△6.2	14,744	△5.9	38.8	1.1	59.1	0.4	118
8期(2017年5月29日)	15,354	0	5.6	15,593	5.8	38.4	1.5	59.1	0.4	130
9期(2018年5月28日)	16,134	0	5.1	16,404	5.2	36.7	2.9	58.4	0.4	161
10期(2019年5月28日)	15,927	0	△1.3	16,229	△1.1	37.0	1.4	60.2	0.4	184
11期(2020年5月28日)	16,339	0	2.6	16,665	2.7	41.0	3.0	54.9	0.4	195

(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。

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	投資信託 証券組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月30日)	15,351	0	△8.7	15,421	△8.6	53.3	1.5	44.2	0.6	118
8期(2017年5月29日)	16,639	0	8.4	16,705	8.3	52.6	2.0	44.2	0.5	117
9期(2018年5月28日)	17,799	0	7.0	17,858	6.9	50.5	4.0	43.8	0.5	161
10期(2019年5月28日)	17,375	0	△2.4	17,439	△2.3	51.3	2.0	45.4	0.6	177
11期(2020年5月28日)	17,894	0	3.0	17,937	2.9	52.0	3.8	43.0	0.5	218

(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。

＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	投資信託 証券組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	中 率 騰 落 率	期 中 騰 落 率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
7期(2016年5月30日)	16,135	0	△10.9	16,080	△10.9	66.7	1.9	30.4	0.7	121
8期(2017年5月29日)	17,878	0	10.8	17,777	10.6	64.9	2.5	31.3	0.6	131
9期(2018年5月28日)	19,419	0	8.6	19,268	8.4	62.3	5.0	31.1	0.6	184
10期(2019年5月28日)	18,734	0	△ 3.5	18,555	△ 3.7	65.7	2.5	30.5	0.7	162
11期(2020年5月28日)	19,322	0	3.1	19,067	2.8	65.6	4.8	28.4	0.7	181

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	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
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年5月28日	13,079	—	13,742	—	13.7	0.5	84.5	0.2
5月末	13,060	△0.1	13,725	△0.1	13.6	0.7	137.7	0.2
6月末	13,194	0.9	13,872	0.9	14.6	0.7	84.2	0.2
7月末	13,235	1.2	13,923	1.3	14.4	0.8	84.2	0.2
8月末	13,291	1.6	13,992	1.8	13.6	0.8	85.4	0.2
9月末	13,311	1.8	14,004	1.9	18.1	1.0	80.8	0.2
10月末	13,385	2.3	14,092	2.5	17.8	1.0	81.1	0.2
11月末	13,407	2.5	14,128	2.8	17.1	1.1	80.8	0.2
12月末	13,425	2.6	14,155	3.0	17.6	0.8	81.5	0.2
2020年1月末	13,441	2.8	14,178	3.2	17.3	0.4	82.0	0.2
2月末	13,298	1.7	14,034	2.1	15.9	0.6	83.1	0.2
3月末	12,914	△1.3	13,619	△0.9	16.0	1.0	83.0	0.2
4月末	13,066	△0.1	13,783	0.3	17.7	1.5	81.0	0.2
(期 末)								
2020年5月28日	13,200	0.9	13,937	1.4	17.4	1.3	80.3	0.2

(注) 騰落率は期首比です。

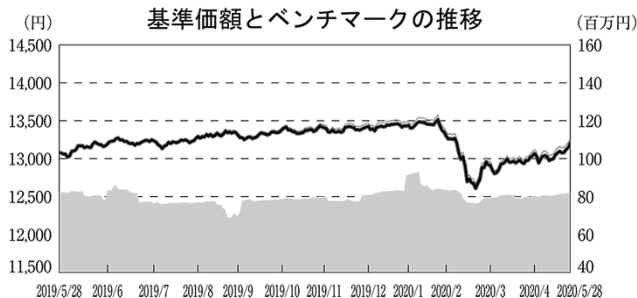
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。

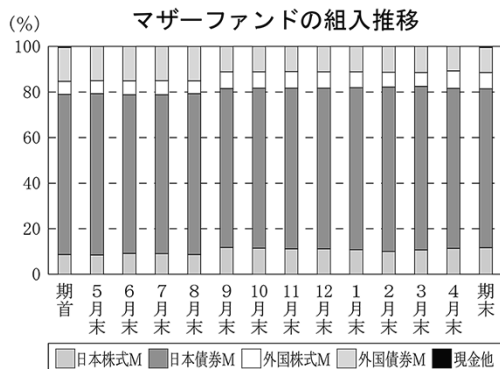


— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) — 純資産総額(右軸)

(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およびベンチマークは、期首(2019年5月28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。



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	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
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年5月28日	14,372	—	14,926	—	24.8	0.9	72.9	0.3
5月末	14,307	△0.5	14,860	△0.4	24.7	1.3	111.4	0.3
6月末	14,503	0.9	15,071	1.0	26.2	1.3	72.0	0.3
7月末	14,577	1.4	15,157	1.5	25.9	1.4	72.0	0.3
8月末	14,535	1.1	15,123	1.3	24.7	1.4	73.5	0.3
9月末	14,670	2.1	15,243	2.1	29.9	1.7	68.3	0.4
10月末	14,848	3.3	15,438	3.4	29.5	1.6	68.7	0.3
11月末	14,930	3.9	15,536	4.1	28.5	1.8	68.6	0.3
12月末	14,998	4.4	15,613	4.6	29.2	1.3	69.3	0.3
2020年1月末	14,989	4.3	15,611	4.6	28.9	0.7	70.1	0.3
2月末	14,652	1.9	15,267	2.3	26.9	1.0	71.8	0.3
3月末	14,095	△1.9	14,665	△1.7	26.8	1.7	71.6	0.3
4月末	14,357	△0.1	14,940	0.1	29.3	2.4	68.4	0.3
(期 末)								
2020年5月28日	14,627	1.8	15,236	2.1	28.8	2.1	68.0	0.3

(注) 騰落率は期首比です。

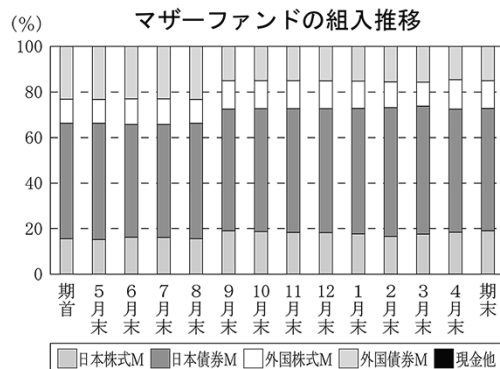
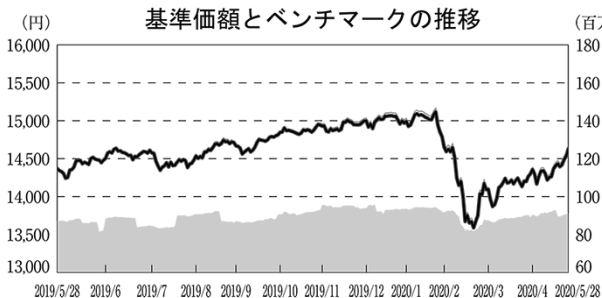
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。



(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およびベンチマークは、期首（2019年5月28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。

※比率は、純資産総額（一部の未払金の計上を除く）に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	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
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年5月28日	15,927	—	16,229	—	37.0	1.4	60.2	0.4
5月末	15,804	△0.8	16,107	△0.8	36.9	1.9	88.4	0.4
6月末	16,071	0.9	16,386	1.0	38.6	1.9	58.9	0.4
7月末	16,186	1.6	16,511	1.7	38.2	2.2	59.0	0.4
8月末	16,024	0.6	16,361	0.8	36.8	2.0	60.7	0.4
9月末	16,307	2.4	16,613	2.4	42.4	2.4	55.0	0.5
10月末	16,619	4.3	16,940	4.4	42.0	2.3	55.5	0.5
11月末	16,778	5.3	17,116	5.5	40.6	2.6	55.5	0.4
12月末	16,910	6.2	17,255	6.3	41.8	1.9	56.2	0.4
2020年1月末	16,865	5.9	17,217	6.1	41.5	1.1	57.1	0.5
2月末	16,265	2.1	16,614	2.4	39.1	1.5	59.1	0.5
3月末	15,490	△2.7	15,783	△2.8	38.9	2.5	58.9	0.4
4月末	15,893	△0.2	16,192	△0.2	41.6	3.5	55.1	0.5
(期 末)								
2020年5月28日	16,339	2.6	16,665	2.7	41.0	3.0	54.9	0.4

(注) 騰落率は期首比です。

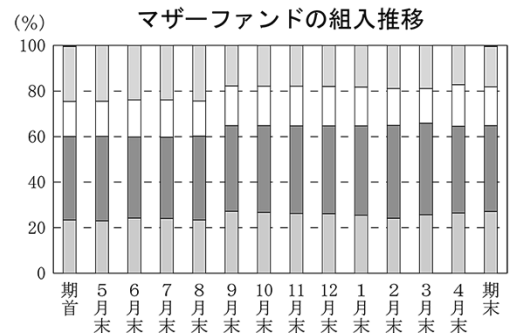
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 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およびベンチマークは、期首（2019年5月28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。

※比率は、純資産総額（一部の未払金の計上を除く）に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	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
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年5月28日	17,375	—	17,439	—	51.3	2.0	45.4	0.6
5月末	17,183	△1.1	17,248	△1.1	51.3	2.7	66.9	0.6
6月末	17,529	0.9	17,601	0.9	53.0	2.6	44.0	0.6
7月末	17,692	1.8	17,774	1.9	52.4	3.0	44.2	0.6
8月末	17,380	0.0	17,474	0.2	51.0	2.8	45.9	0.6
9月末	17,812	2.5	17,855	2.4	53.8	3.0	43.0	0.6
10月末	18,261	5.1	18,312	5.0	53.5	2.9	43.5	0.6
11月末	18,500	6.5	18,570	6.5	51.8	3.3	43.5	0.6
12月末	18,701	7.6	18,772	7.6	53.3	2.4	44.3	0.6
2020年1月末	18,615	7.1	18,695	7.2	53.2	1.4	45.1	0.6
2月末	17,729	2.0	17,814	2.2	50.7	1.9	47.2	0.6
3月末	16,711	△3.8	16,736	△4.0	50.2	3.2	47.0	0.5
4月末	17,272	△0.6	17,295	△0.8	52.8	4.4	43.0	0.6
(期 末)								
2020年5月28日	17,894	3.0	17,937	2.9	52.0	3.8	43.0	0.5

(注) 騰落率は期首比です。

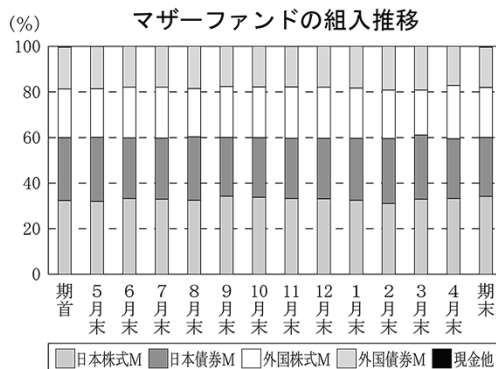
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。



(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およびベンチマークは、期首（2019年5月28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。

※比率は、純資産総額（一部の未払金の計上を除く）に占める割合です。

＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	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
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%
2019年5月28日	18,734	—	18,555	—	65.7	2.5	30.5	0.7
5月末	18,462	△1.5	18,288	△1.4	65.9	3.4	45.1	0.8
6月末	18,894	0.9	18,721	0.9	67.2	3.3	29.3	0.8
7月末	19,111	2.0	18,944	2.1	66.6	3.8	29.4	0.8
8月末	18,628	△0.6	18,480	△0.4	65.4	3.6	30.8	0.8
9月末	19,242	2.7	19,014	2.5	67.9	3.7	28.4	0.8
10月末	19,856	6.0	19,626	5.8	67.6	3.7	28.8	0.8
11月末	20,200	7.8	19,987	7.7	65.7	4.2	28.9	0.7
12月末	20,483	9.3	20,264	9.2	67.6	3.0	29.4	0.7
2020年1月末	20,333	8.5	20,126	8.5	68.0	1.8	30.2	0.8
2月末	19,052	1.7	18,870	1.7	65.6	2.4	32.0	0.8
3月末	17,714	△5.4	17,464	△5.9	64.8	4.1	31.8	0.7
4月末	18,491	△1.3	18,230	△1.8	66.5	5.5	28.4	0.8
(期 末)								
2020年5月28日	19,322	3.1	19,067	2.8	65.6	4.8	28.4	0.7

(注) 騰落率は期首比です。

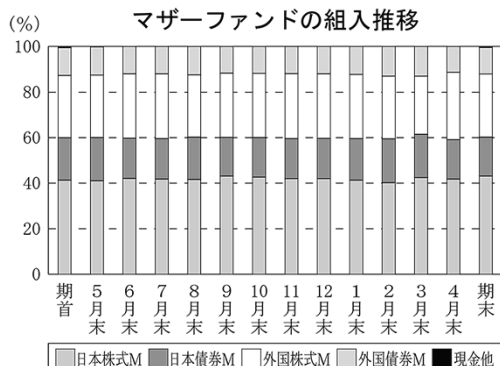
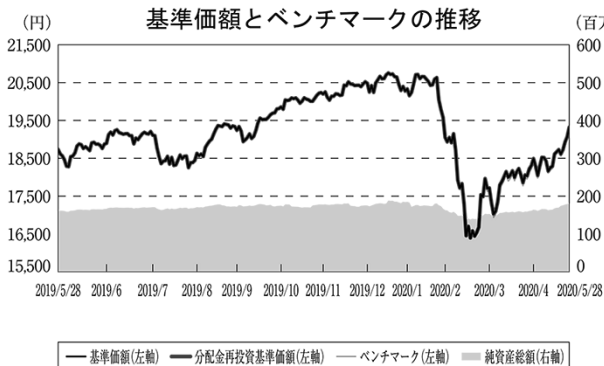
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。



(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およびベンチマークは、期首(2019年5月28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。

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

○運用経過

(2019年5月29日～2020年5月28日)

■期中の基準価額等の推移

	L P S 4 資産 分散ファンド (慎重型)	L P S 4 資産 分散ファンド (安定重視型)	L P S 4 資産 分散ファンド (バランス型)	L P S 4 資産 分散ファンド (成長重視型)	L P S 4 資産 分散ファンド (積極型)
前期末 (2019年5月28日)	13,079円	14,372円	15,927円	17,375円	18,734円
当期末 (2020年5月28日)	13,200円	14,627円	16,339円	17,894円	19,322円
基準価額の騰落率	0.9%	1.8%	2.6%	3.0%	3.1%
ベンチマークの騰落率	1.4%	2.1%	2.7%	2.9%	2.8%

◇基準価額の主な変動要因

【各マザーファンドのベンチマークの騰落率】

	日本株式 TOPIX (東証株価指数)	日本債券 NOMURA - BPI (総合)	外国株式 MSCIコクサイ指数 (円ヘッジなし・円ベース)	外国債券 FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
騰落率	1.7%	▲0.2%	2.7%	6.2%

プラス要因

- ・米中貿易協議の進展への期待などから国内外の株式市場が上昇したこと
- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けた主要中央銀行の大規模な金融緩和策により世界的に金利が低下（債券価格が上昇）したこと

マイナス要因

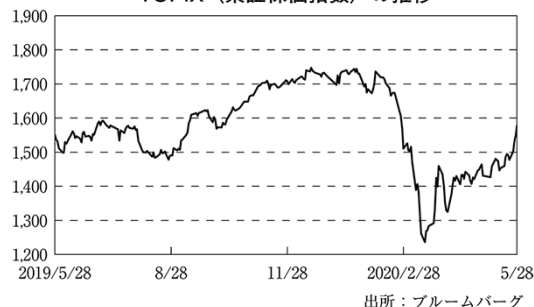
- ・期後半、新型コロナウイルスの感染拡大による景気後退への懸念が高まり、世界的に株式市場が下落したこと

■投資環境

【日本株式市況】

期初、米中貿易協議の進展への期待から国内株式市場は上昇して始まりましたが、米国による対中追加関税の発動や円高の進行が嫌気されて2019年8月にかけて下落しました。その後、米中貿易協議再開への期待やFRB（米連邦準備制度理事会）による利下げの実施などを受けて、国内株式市場は年末にかけて堅調に推移しました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速への懸念や原油価格の急落などから、国内株式市場は3月にかけて大きく下落しました。その後は、新型コロナウイルス感染拡大ペースの鈍化を受けて欧米各国で経済活動の再開への期待が高まり、国内株式市場は上昇に転じ、期初から上昇した水準で期を終えました。

TOPIX（東証株価指数）の推移



【日本債券市況】

期初、米中貿易摩擦の激化や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱への懸念、欧米の中央銀行による追加緩和期待などを背景に、10年国債利回りは2019年8月にかけて低下しました。その後、米中貿易協議再開への期待が高まるなか、10年国債利回りは上昇基調となりましたが、2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速への懸念から低下に転じました。3月中旬以降は金融市場が不安定化するなか、投資家のリスク回避姿勢の高まりから現金化に伴う債券売りの動きが広がり、10年国債利回りは上昇に転じ、期初から上昇した水準で期を終えました。

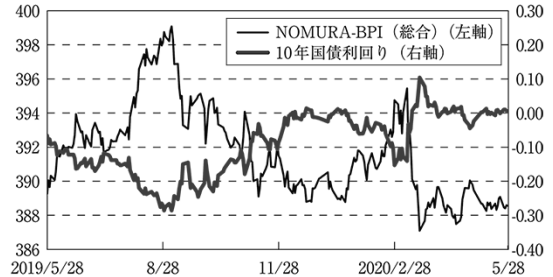
【外国株式市況】

期初、米中貿易協議の進展への期待やFRBによる利下げ観測の高まりなどを背景に、外国株式市場は上昇基調で推移したものの、2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による景気後退への懸念が高まり、外国株式市場は大きく下落しました。その後は、欧米で新型コロナウイルスの感染拡大ペースに鈍化の兆しが見られたことや、トランプ米大統領が経済活動の再開に向けた指針を発表したことが好感され、外国株式市場は上昇に転じ、期初から上昇した水準で期を終えました。

【外国債券市況】

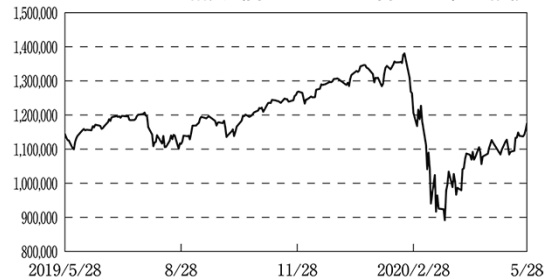
期初、主要国の国債利回りは米中貿易摩擦の激化やFRBの金融緩和姿勢が強まったことなどを背景に低下したものの、2019年12月に米中貿易協議の進展や英国の合意なきEU離脱の回避を受けて、緩やかな上昇に転じました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大やFRBの大規模な金融緩和により再び低下基調となり、前期末比で主要国の国債利回りは低下しました。

NOMURA-BPI（総合）・10年国債利回りの推移

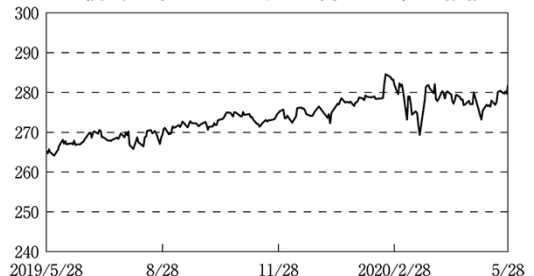


出所：ブルームバーグ

MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）の推移



(注) グラフの値は、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）です。

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) グラフの値は、FTSE世界国債インデックス（国内投信用）です。

出所：ブルームバーグ

【為替市況】

期初、米ドル円為替レートは米中貿易摩擦の激化を背景に円高が進行したものの、2019年9月以降は米中貿易協議の進展への期待や米国株式市場の堅調さから、おおむね円安傾向で推移しました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大に伴い急激な円高が進んだ後、米ドル需要の高まりから米ドル高が進むなど振れの大きい展開となりました。4月以降は原油価格の急落や米国債利回りの低下を受けて円高米ドル安となり、米ドル円為替レートは前期末比円高米ドル安で期を終えました。

■ポートフォリオについて

＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)(安定重視型)(バランス型)(成長重視型)(積極型)＞

当ファンドの運用は主要4資産のインデックスマザーファンドを以下の「基本資産配分」を基準に、一定の範囲(±5%)に変動幅を抑制するように運用しました。具体的には、毎月初に基本資産配分からの乖離分を戻すリバランスを行いました。

【基本資産配分】

	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
(慎重型)	11%	71%	7%	11%
(安定重視型)	18%	55%	12%	15%
(バランス型)	26%	39%	17%	18%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%

＜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の感染拡大による景気減速への懸念などを背景に4.4%上昇し、株式の受取配当金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0.2%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、新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速への懸念などを背景に2.6%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

＜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、米欧の金利が低下したことから6.0%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、各マザーファンドのベンチマークを基本資産配分で組み合わせた指数を合成ベンチマークとし、当該ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

グラフは期中の基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

各ファンドの騰落率は、次表の通りベンチマークにおおむね連動しました。

【各ファンドとベンチマークの騰落率】

	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
フ ァ ン ド	0.9%	1.8%	2.6%	3.0%	3.1%
ベ ン チ マ ー ク	1.4%	2.1%	2.7%	2.9%	2.8%

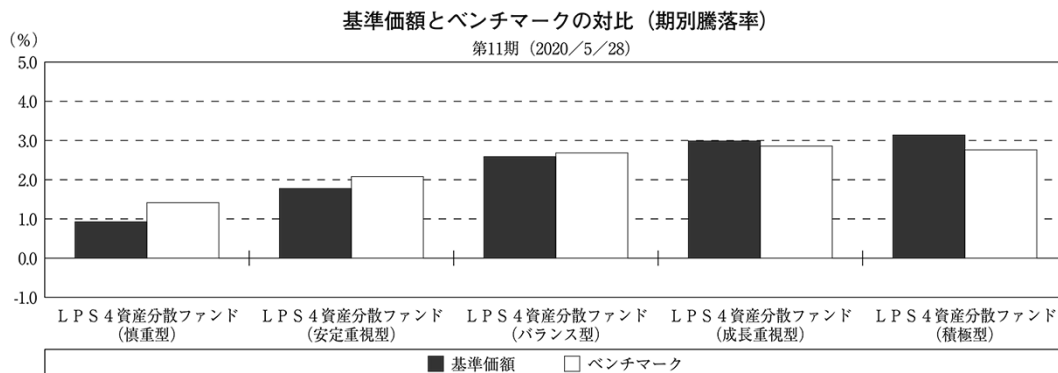
(主な差異要因)

プラス要因

- ・マザーファンドにおける配当金収入

マイナス要因

- ・信託報酬などのコスト
- ・マザーファンドにおける取引コストや配当課税の影響



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

■分配金

当期においては、市況動向や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11期				
	2019年5月29日～2020年5月28日				
	L P S 4 資産 分散ファンド (慎 重 型)	L P S 4 資産 分散ファンド (安 定 重 視 型)	L P S 4 資産 分散ファンド (バ ラ ン ス 型)	L P S 4 資産 分散ファンド (成 長 重 視 型)	L P S 4 資産 分散ファンド (積 極 型)
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	3,199	4,627	6,338	7,893	9,321

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)(安定重視型)(バランス型)(成長重視型)(積極型)>

主として、各マザーファンドへの投資を通じて、国内外の複数の資産に分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。資産配分は、「基本資産配分」を基準に、原則として一定の範囲(±5%)に変動幅を抑制します。各マザーファンドにおきましては、引き続き高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

なお、各市場の今後の見通しは以下の通りです。

【日本株式市場見通し】

国内では緊急事態宣言により景気的大幅な落ち込みは避けられませんが、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加ペースが鈍化するなど経済活動再開のめどが立ちつつあるなか、日本を含む主要各国が打ち出している大規模な金融・財政政策が中期的に経済を下支えすると考えます。

このような状況下、国内株式市場は緩やかな回復基調で推移すると予想します。

【日本債券市場見通し】

新型コロナウイルスの感染収束には時間を要するため、当面主要中央銀行は緩和的な金融政策を継続する可能性が高いと考えます。また、今年度の国債発行計画は想定内の結果となったことや、生命保険会社が国内債券投資に前向きな姿勢を示していることから、国内債券市場の需給不安は一旦後退したとみています。このような環境下、10年国債利回りの上昇余地は限定的で、狭いレンジ内ながら低下余地を探る展開を予想します。

【外国株式市場見通し】

外国株式市場は、新型コロナウイルス発生源を巡る米中対立への懸念や景気先行きに対する不透明感の高まり、11月に予定される米大統領選を控えて候補者の言動に注目が集まりやすいことを背景に、当面はボラティリティ(変動性)が高い展開を予想します。米国企業の業績も新型コロナウイルスの感染拡大を防止するため、経済活動の制限の影響を受けることが見込まれ、増益基調への回復時期が先送りになると考えています。しかし、FRBによる金融緩和政策のほか、トランプ米政権下の財政支出拡大も株価の下支え要因となり、海外株式市場は中長期的には緩やかな上昇基調に戻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の感染拡大が実体経済に悪影響を与えるなか、FRBが大規模な金融緩和策を講じていることから、低水準で推移すると予想します。

ドイツ国債利回りは、ECBの金融緩和姿勢が強化されているなか、米国債同様低水準での推移が続くと予想します。

【為替市場見通し】

米ドル円為替レートは、FRBが大規模な金融緩和策を講じているものの、今後より一層の緩和策を講じる可能性は限定的とみていることから、現行程度の水準で推移すると予想します。

ユーロ円為替レートは、欧州周辺国の経済再建に対する懸念が残されるなか、ECBの金融緩和姿勢が当面続くことが想定されることから、現行程度の水準で推移すると予想します。

2020年8月29日以降、上記の見通しなどを踏まえて基本資産配分を以下の通り変更する予定です。

- ・慎重型 日本債券のウェイトを引き下げ、外国債券のウェイトを引き上げ。
- ・安定重視型 日本債券のウェイトを引き下げ、外国債券のウェイトを引き上げ。
- ・バランス型 日本株式・日本債券・外国株式のウェイトを引き下げ、外国債券のウェイトを引き上げ。
- ・成長重視型 変更なし。
- ・積極型 日本株式・外国株式のウェイトを引き下げ、日本債券・外国債券のウェイトを引き上げ。

【基本資産配分】

	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
(慎重型)	11%	71%	7%	11%
(安定重視型)	18%	55%	12%	15%
(バランス型)	26%	39%	17%	18%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%



2020年8月29日以降の基本資産配分（予定）

	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
(慎重型)	11%	70%	7%	12%
(安定重視型)	18%	54%	12%	16%
(バランス型)	25%	38%	16%	21%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	41%	19%	27%	13%

＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

引き続き、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を行います。

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、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を行います。

＜TMA外国株式インデックスマザーファンド＞

引き続き、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を行います。

＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、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す。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月29日～2020年5月28日)

項 目	第11期										項目の概要
	L P S 4 資産 分散ファンド (慎 重 型)		L P S 4 資産 分散ファンド (安定重視型)		L P S 4 資産 分散ファンド (バランス型)		L P S 4 資産 分散ファンド (成長重視型)		L P S 4 資産 分散ファンド (積 極 型)		
	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 94	% 0.709	円 104	% 0.709	円 115	% 0.709	円 126	% 0.709	円 136	% 0.709	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(44)	(0.330)	(48)	(0.330)	(54)	(0.330)	(59)	(0.330)	(63)	(0.330)	*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)	(44)	(0.330)	(48)	(0.330)	(54)	(0.330)	(59)	(0.330)	(63)	(0.330)	*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)	(7)	(0.049)	(7)	(0.049)	(8)	(0.049)	(9)	(0.049)	(10)	(0.049)	*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	0	0.002	1	0.004	1	0.006	1	0.007	2	0.009	(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)	(0)	(0.001)	(0)	(0.002)	(0)	(0.003)	(1)	(0.004)	(1)	(0.005)	*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	(0)	(0.002)	(0)	(0.002)	(1)	(0.003)	(1)	(0.004)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	0	0.003	1	0.004	1	0.006	1	0.007	(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)	(0)	(0.002)	(0)	(0.003)	(1)	(0.004)	(1)	(0.006)	(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)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.018	3	0.023	4	0.028	6	0.031	7	0.035	(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)	(1)	(0.007)	(2)	(0.012)	(3)	(0.017)	(4)	(0.021)	(5)	(0.024)	*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)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	*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)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	96	0.731	108	0.739	121	0.747	134	0.753	146	0.760	
期中の平均基準価額	L P S 4 資産分散ファンド (慎 重 型) 13,252円 L P S 4 資産分散ファンド (安定重視型) 14,621円 L P S 4 資産分散ファンド (バランス型) 16,267円 L P S 4 資産分散ファンド (成長重視型) 17,782円 L P S 4 資産分散ファンド (積 極 型) 19,205円										

(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。

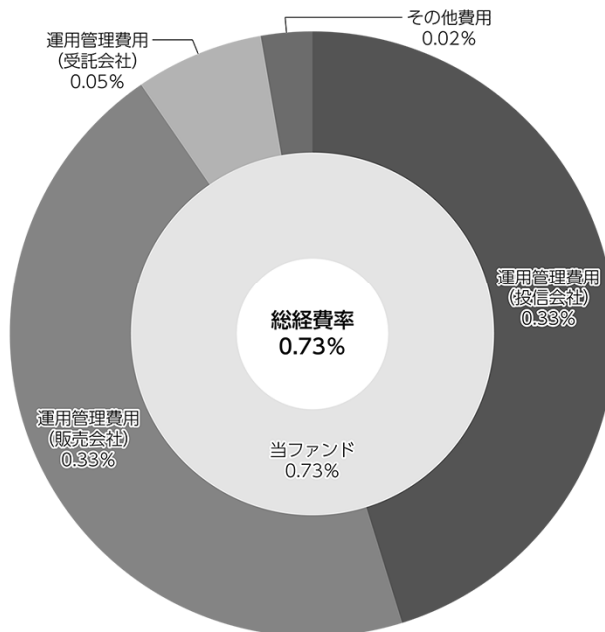
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

(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0.73%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。

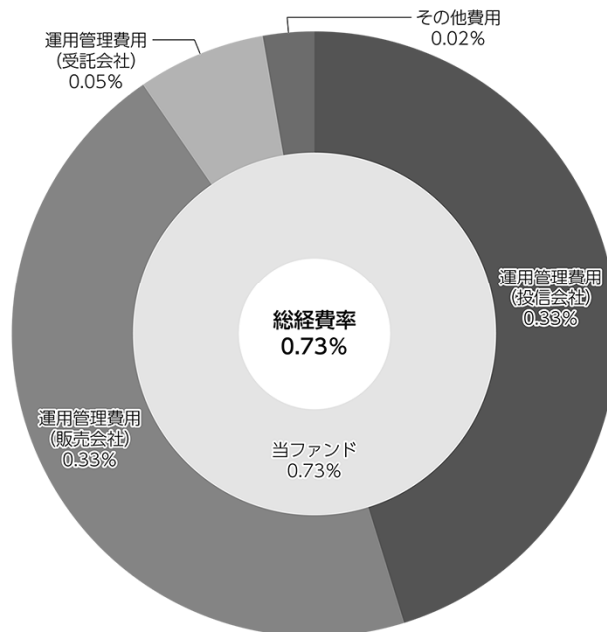
(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

(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0.73%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。

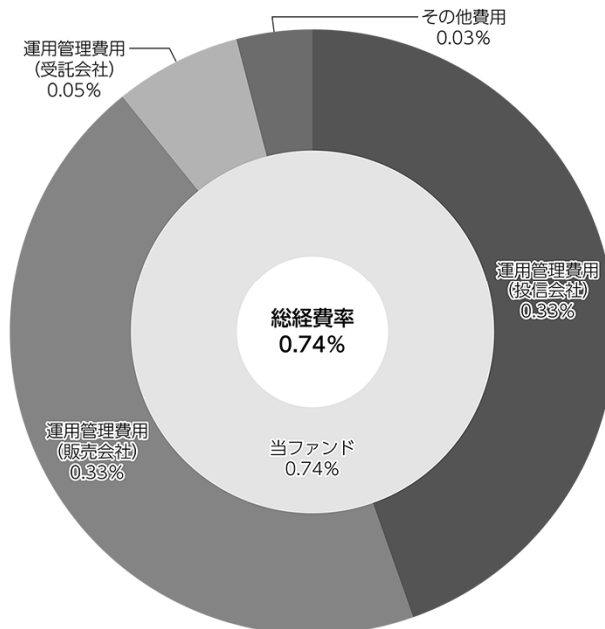
(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

(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0.74%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。

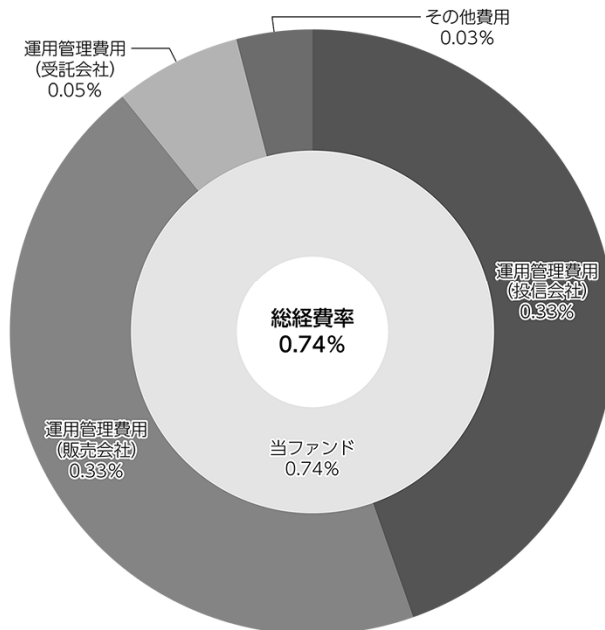
(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

(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0.74%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。

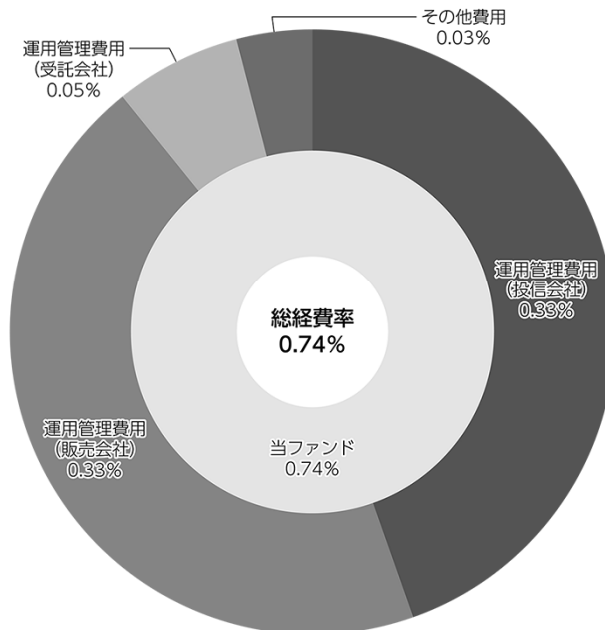
(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

(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0.74%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年5月29日～2020年5月28日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

<LPS4資産分散ファンド(慎重型)>

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 6,859	千円 8,915	千口 5,209	千円 6,901
TMA日本債券インデックスマザーファンド	28,996	38,058	29,277	38,481
TMA外国株式インデックスマザーファンド	2,369	5,849	1,936	4,918
TMA外国債券インデックスマザーファンド	3,955	6,279	6,377	10,088

<LPS4資産分散ファンド(安定重視型)>

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 10,589	千円 13,633	千口 8,145	千円 10,750
TMA日本債券インデックスマザーファンド	25,816	33,958	22,006	28,859
TMA外国株式インデックスマザーファンド	3,909	9,529	3,225	8,116
TMA外国債券インデックスマザーファンド	5,824	9,252	10,547	16,692

<LPS4資産分散ファンド(バランス型)>

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 23,186	千円 30,205	千口 17,087	千円 22,549
TMA日本債券インデックスマザーファンド	30,156	39,604	25,411	33,319
TMA外国株式インデックスマザーファンド	8,723	21,420	7,014	17,619
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10,241	16,348	17,996	28,610

<LPS4資産分散ファンド(成長重視型)>

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 31,013	千円 40,418	千口 20,004	千円 26,477
TMA日本債券インデックスマザーファンド	26,499	34,780	20,828	27,359
TMA外国株式インデックスマザーファンド	12,191	30,074	8,575	21,653
TMA外国債券インデックスマザーファンド	13,832	22,144	11,404	18,295

<LPS4資産分散ファンド(積極型)>

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 35,570	千円 46,808	千口 29,527	千円 40,092
TMA日本債券インデックスマザーファンド	17,774	23,308	17,068	22,423
TMA外国株式インデックスマザーファンド	13,549	33,717	11,647	30,276
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9,294	14,851	9,305	14,926

○株式売買比率

(2019年5月29日～2020年5月28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	12,694,771千円	8,327,834千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	30,958,228千円	13,485,378千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41	0.61

(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5月29日～2020年5月28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
株式	百万円 11	百万円 87	百万円 203

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

(2019年5月29日～2020年5月28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	百万円	百万円	百万円	
(慎重型)	1	—	—	1	当初設定における取得
(安定重視型)	1	—	—	1	
(バランス型)	1	—	—	1	
(成長重視型)	1	—	—	1	
(積極型)	—	—	—	—	—

○組入資産の明細

(2020年5月28日現在)

親投資信託残高

＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期 口数	期末 評価額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	5,600	7,250	9,653
TMA日本債券インデックスマザーファンド	44,566	44,285	57,659
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,932	2,365	5,924
TMA外国債券インデックスマザーファンド	7,990	5,568	9,105

＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期 口数	期末 評価額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	10,644	13,088	17,424
TMA日本債券インデックスマザーファンド	34,028	37,838	49,265
TMA外国株式インデックスマザーファンド	3,789	4,473	11,204
TMA外国債券インデックスマザーファンド	13,097	8,374	13,694

＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期 口数	期末 評価額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	33,891	39,990	53,238
TMA日本債券インデックスマザーファンド	51,998	56,743	73,879
TMA外国株式インデックスマザーファンド	11,698	13,408	33,585
TMA外国債券インデックスマザーファンド	29,007	21,253	34,755

＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期 口数	期末 評価額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	45,265	56,274	74,918
TMA日本債券インデックスマザーファンド	37,876	43,547	56,698
TMA外国株式インデックスマザーファンド	15,625	19,241	48,195
TMA外国債券インデックスマザーファンド	21,130	23,559	38,526

＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期 口数	期末 評価額
	千口	千口	千円
TMA日本株TOPIXマザーファンド	52,955	58,997	78,543
TMA日本債券インデックスマザーファンド	23,206	23,911	31,132
TMA外国株式インデックスマザーファンド	18,278	20,180	50,549
TMA外国債券インデックスマザーファンド	12,947	12,936	21,154

＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

○投資信託財産の構成

(2020年5月28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	9,653	11.7
TMA日本債券インデックスマザーファンド	57,659	69.8
TMA外国株式インデックスマザーファンド	5,924	7.2
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9,105	11.0
コール・ローン等、その他	318	0.3
投資信託財産総額	82,659	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（19,023,820千円）の投資信託財産総額（19,114,045千円）に対する比率は99.5%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（5,569,686千円）の投資信託財産総額（5,686,336千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル＝107.92円、1カナダドル＝78.54円、1メキシコペソ＝4.85円、1ユーロ＝119.00円、1英ポンド＝132.37円、1スイスフラン＝111.46円、1スウェーデンクローナ＝11.27円、1ノルウェークローネ＝10.98円、1デンマーククローネ＝15.96円、1ポーランドズロチ＝26.86円、1豪ドル＝71.54円、1ニュージーランドドル＝66.80円、1香港ドル＝13.92円、1シンガポールドル＝76.12円、1マレーシアリングgit＝24.79円、1イスラエルシェケル＝30.83円です。

＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	82,659,299
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	9,653,023
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	57,659,735
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	5,924,866
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	9,105,579
未収入金	316,096
(B) 負債	301,636
未払解約金	10,114
未払信託報酬	287,149
その他未払費用	4,373
(C) 純資産総額(A－B)	82,357,663
元本	62,392,654
次期繰越損益金	19,965,009
(D) 受益権総口数	62,392,654口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,200円

(注) 当ファンドの期首元本額は62,941,901円、期中追加設定元本額は37,336,253円、期中一部解約元本額は37,885,500円です。

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

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

○損益の状況（2019年5月29日～2020年5月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	754,679
売買益	1,778,100
売買損	△ 1,023,421
(B) 信託報酬等	△ 572,160
(C) 当期損益金(A＋B)	182,519
(D) 前期繰越損益金	854,832
(E) 追加信託差損益金	18,927,658
(配当等相当額)	(13,565,049)
(売買損益相当額)	(5,362,609)
(F) 計(C＋D＋E)	19,965,009
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	19,965,009
追加信託差損益金	18,927,658
(配当等相当額)	(13,600,777)
(売買損益相当額)	(5,326,881)
分配準備積立金	1,435,997
繰越損益金	△ 398,646

(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)	337,232円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	18,529,012円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,098,765円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	19,965,009円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,199円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

○投資信託財産の構成

(2020年5月28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	17,424	19.0
TMA日本債券インデックスマザーファンド	49,265	53.6
TMA外国株式インデックスマザーファンド	11,204	12.2
TMA外国債券インデックスマザーファンド	13,694	14.9
コール・ローン等、その他	351	0.3
投資信託財産総額	91,938	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（19,023,820千円）の投資信託財産総額（19,114,045千円）に対する比率は99.5%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（5,569,686千円）の投資信託財産総額（5,686,336千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは 1米ドル＝107.92円、1カナダドル＝78.54円、1メキシコペソ＝4.85円、1ユーロ＝119.00円、1英ポンド＝132.37円、1スイスフラン＝111.46円、1スウェーデンクローナ＝11.27円、1ノルウェークローネ＝10.98円、1デンマーククローネ＝15.96円、1ポーランドズロチ＝26.86円、1豪ドル＝71.54円、1ニュージーランドドル＝66.80円、1香港ドル＝13.92円、1シンガポールドル＝76.12円、1マレーシアリングgit＝24.79円、1イスラエルシェケル＝30.83円です。

＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	91,938,874
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	17,424,797
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	49,265,512
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	11,204,842
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	13,694,808
未収入金	348,915
(B) 負債	332,165
未払解約金	5,000
未払信託報酬	322,257
その他未払費用	4,908
(C) 純資産総額(A－B)	91,606,709
元本	62,626,536
次期繰越損益金	28,980,173
(D) 受益権総口数	62,626,536口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,627円

(注) 当ファンドの期首元本額は60,820,380円、期中追加設定元本額は33,404,944円、期中一部解約元本額は31,598,788円です。

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

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

○損益の状況（2019年5月29日～2020年5月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	1,661,107
売買益	2,960,868
売買損	△ 1,299,761
(B) 信託報酬等	△ 642,062
(C) 当期損益金(A＋B)	1,019,045
(D) 前期繰越損益金	1,028,776
(E) 追加信託差損益金	26,932,352
(配当等相当額)	(23,006,581)
(売買損益相当額)	(3,925,771)
(F) 計(C＋D＋E)	28,980,173
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	28,980,173
追加信託差損益金	26,932,352
(配当等相当額)	(23,055,286)
(売買損益相当額)	(3,877,066)
分配準備積立金	2,512,265
繰越損益金	△ 464,444

(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)	783,079円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	26,467,908円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,729,186円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	28,980,173円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,627円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

○投資信託財産の構成

(2020年5月28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	53,238	27.1
TMA日本債券インデックスマザーファンド	73,879	37.7
TMA外国株式インデックスマザーファンド	33,585	17.1
TMA外国債券インデックスマザーファンド	34,755	17.7
コール・ローン等、その他	720	0.4
投資信託財産総額	196,177	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（19,023,820千円）の投資信託財産総額（19,114,045千円）に対する比率は99.5%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（5,569,686千円）の投資信託財産総額（5,686,336千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル＝107.92円、1カナダドル＝78.54円、1メキシコペソ＝4.85円、1ユーロ＝119.00円、1英ポンド＝132.37円、1スイスフラン＝111.46円、1スウェーデンクローナ＝11.27円、1ノルウェークローネ＝10.98円、1デンマーククローネ＝15.96円、1ポーランドズロチ＝26.86円、1豪ドル＝71.54円、1ニュージーランドドル＝66.80円、1香港ドル＝13.92円、1シンガポールドル＝76.12円、1マレーシアリングgit＝24.79円、1イスラエルシェケル＝30.83円です。

＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	196,177,381
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	53,238,813
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	73,879,914
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	33,585,871
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	34,755,287
未収入金	717,496
(B) 負債	683,667
未払解約金	1
未払信託報酬	673,312
その他未払費用	10,354
(C) 純資産総額(A－B)	195,493,714
元本	119,650,327
次期繰越損益金	75,843,387
(D) 受益権総口数	119,650,327口
1万口当たり基準価額(C／D)	16,339円

(注) 当ファンドの期首元本額は115,739,043円、期中追加設定元本額は42,978,637円、期中一部解約元本額は39,067,353円です。

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

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

○損益の状況（2019年5月29日～2020年5月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	4,600,267
売買益	7,296,105
売買損	△ 2,695,838
(B) 信託報酬等	△ 1,351,795
(C) 当期損益金(A＋B)	3,248,472
(D) 前期繰越損益金	4,654,294
(E) 追加信託差損益金	67,940,621
(配当等相当額)	(58,006,835)
(売買損益相当額)	(9,933,786)
(F) 計(C＋D＋E)	75,843,387
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	75,843,387
追加信託差損益金	67,940,621
(配当等相当額)	(58,072,238)
(売買損益相当額)	(9,868,383)
分配準備積立金	9,914,261
繰越損益金	△ 2,011,495

(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)	2,229,748円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	65,929,126円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	7,684,513円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	75,843,387円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,338円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

○投資信託財産の構成

(2020年5月28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	74,918	34.2
TMA日本債券インデックスマザーファンド	56,698	25.9
TMA外国株式インデックスマザーファンド	48,195	22.0
TMA外国債券インデックスマザーファンド	38,526	17.6
コール・ローン等、その他	764	0.3
投資信託財産総額	219,101	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（19,023,820千円）の投資信託財産総額（19,114,045千円）に対する比率は99.5%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（5,569,686千円）の投資信託財産総額（5,686,336千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル＝107.92円、1カナダドル＝78.54円、1メキシコペソ＝4.85円、1ユーロ＝119.00円、1英ポンド＝132.37円、1スイスフラン＝111.46円、1スウェーデンクローナ＝11.27円、1ノルウェークローネ＝10.98円、1デンマーククローネ＝15.96円、1ポーランドズロチ＝26.86円、1豪ドル＝71.54円、1ニュージーランドドル＝66.80円、1香港ドル＝13.92円、1シンガポールドル＝76.12円、1マレーシアリングgit＝24.79円、1イスラエルシェケル＝30.83円です。

＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	219,101,216
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	74,918,068
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	56,698,641
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	48,195,385
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	38,526,377
未収入金	762,745
(B) 負債	727,189
未払解約金	10,328
未払信託報酬	705,998
その他未払費用	10,863
(C) 純資産総額(A－B)	218,374,027
元本	122,040,033
次期繰越損益金	96,333,994
(D) 受益権総口数	122,040,033口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,894円

(注) 当ファンドの期首元本額は102,356,316円、期中追加設定元本額は54,588,029円、期中一部解約元本額は34,904,312円です。

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

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

○損益の状況 (2019年5月29日～2020年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	5,529,910
売買益	8,962,387
売買損	△ 3,432,477
(B) 信託報酬等	△ 1,382,413
(C) 当期損益金(A＋B)	4,147,497
(D) 前期繰越損益金	5,858,999
(E) 追加信託差損益金	86,327,498
(配当等相当額)	(72,091,501)
(売買損益相当額)	(14,235,997)
(F) 計(C＋D＋E)	96,333,994
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	96,333,994
追加信託差損益金	86,327,498
(配当等相当額)	(72,205,829)
(売買損益相当額)	(14,121,669)
分配準備積立金	13,088,140
繰越損益金	△ 3,081,644

(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)	2,712,668円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	83,245,854円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	10,375,472円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	96,333,994円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,893円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

○投資信託財産の構成

(2020年5月28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	78,543	43.0
TMA日本債券インデックスマザーファンド	31,132	17.0
TMA外国株式インデックスマザーファンド	50,549	27.6
TMA外国債券インデックスマザーファンド	21,154	11.6
コール・ローン等、その他	1,474	0.8
投資信託財産総額	182,852	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（19,023,820千円）の投資信託財産総額（19,114,045千円）に対する比率は99.5%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（5,569,686千円）の投資信託財産総額（5,686,336千円）に対する比率は97.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル＝107.92円、1カナダドル＝78.54円、1メキシコペソ＝4.85円、1ユーロ＝119.00円、1英ポンド＝132.37円、1スイスフラン＝111.46円、1スウェーデンクローナ＝11.27円、1ノルウェークローネ＝10.98円、1デンマーククローネ＝15.96円、1ポーランドズロチ＝26.86円、1豪ドル＝71.54円、1ニュージーランドドル＝66.80円、1香港ドル＝13.92円、1シンガポールドル＝76.12円、1マレーシアリンギット＝24.79円、1イスラエルシェケル＝30.83円です。

＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月28日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	182,852,919
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	78,543,954
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	31,132,782
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	50,549,050
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	21,154,314
未収入金	1,472,819
(B) 負債	1,443,926
未払解約金	843,927
未払信託報酬	590,921
その他未払費用	9,078
(C) 純資産総額(A－B)	181,408,993
元本	93,889,351
次期繰越損益金	87,519,642
(D) 受益権総口数	93,889,351口
1万口当たり基準価額(C／D)	19,322円

(注) 当ファンドの期首元本額は86,671,920円、期中追加設定元本額は49,464,156円、期中一部解約元本額は42,246,725円です。

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

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

○損益の状況（2019年5月29日～2020年5月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	4,464,990
売買益	9,077,125
売買損	△ 4,612,135
(B) 信託報酬等	△ 1,208,411
(C) 当期損益金(A＋B)	3,256,579
(D) 前期繰越損益金	2,448,276
(E) 追加信託差損益金	81,814,787
(配当等相当額)	(60,375,468)
(売買損益相当額)	(21,439,319)
(F) 計(C＋D＋E)	87,519,642
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	87,519,642
追加信託差損益金	81,814,787
(配当等相当額)	(60,491,741)
(売買損益相当額)	(21,323,046)
分配準備積立金	9,304,358
繰越損益金	△ 3,599,503

(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)	2,431,736円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	78,215,284円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	6,872,622円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	87,519,642円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	9,321円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2020年5月28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(22,426,686千口)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	21.3	16	8,160
マルハニチロ	3.3	2.5	5,872
サカタのタネ	2.5	2	7,290
ホクト	2.4	2.9	5,843
鉱業 (0.2%)			
国際石油開発帝石	87.7	66.6	50,949
石油資源開発	3.2	2.3	4,751
K&Oエナジーグループ	3.2	2.8	4,396
建設業 (2.5%)			
ショーボンドホールディングス	1.6	2.4	11,556
ミライト・ホールディングス	6.1	4.3	6,596
ベステラ	3.2	3	3,072
安藤・間	13.7	10.3	7,251
東急建設	8.7	1.7	1,008
コムシスホールディングス	7.9	5.9	17,688
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	5.6	5.4	4,525
大成建設	18	12.9	48,697
大林組	54.7	39	39,546
清水建設	55.9	39.6	36,550
長谷工コーポレーション	22.5	16.4	21,451
鹿島建設	42.4	30.6	37,944
西松建設	3.8	2.7	5,848
三井住友建設	13.3	10.3	4,851
前田建設工業	13.1	9.9	8,434
奥村組	2.9	2.1	5,592
東鉄工業	2.1	2	5,806
戸田建設	21.9	17.5	11,952
熊谷組	2.5	2.8	7,467
大東建託	6.4	4.2	46,578

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
N I P P O	4.9	3.6	9,615
前田道路	5.6	4.1	8,269
東亜建設工業	4.3	3.8	6,406
五洋建設	21.5	16.5	9,339
住友林業	12.5	9.3	12,657
日本基礎技術	13.8	0.5	212
大和ハウス工業	50	38.2	102,490
積水ハウス	55.3	42.3	85,382
北陸電気工事	5.2	4.4	4,153
中電工	3.2	2.4	5,618
関電工	7.6	6	6,042
きんでん	12.2	9.2	16,707
日本電設工業	3.4	2.7	6,312
協和エクシオ	6.9	5.1	12,469
新日本空調	4.2	1.8	4,590
九電工	3.5	2.5	7,425
三機工業	6.4	4.1	5,539
日揮ホールディングス	15.8	11.9	13,863
中外炉工業	2.3	2.3	3,811
ヤマト	7.8	6.5	4,387
高砂熱学工業	4.6	3.5	6,338
三晃金属工業	1.2	0.8	1,678
大気社	2.3	1.8	6,210
日比谷総合設備	4.5	3.5	6,821
東芝プラントシステム	3.9	—	—
OSJBホールディングス	25.4	12.8	3,174
東洋エンジニアリング	11	2.6	1,105
レイズネクスト	5.7	1.7	2,138
食料品 (4.0%)			
日本製粉	4.9	3.4	5,599
日清製粉グループ本社	18.4	13.8	23,377
鳥越製粉	7	6.3	5,688

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本甜菜製糖	3.3	3	5,307
三井製糖	2.2	0.6	1,272
森永製菓	4.1	3	13,830
江崎グリコ	4.8	3.4	17,340
山崎製パン	13.3	10.2	18,890
亀田製菓	1.5	1.1	5,797
寿スピリッツ	1.8	1.3	7,020
カルビー	7.2	5.6	17,052
森永乳業	3.1	2.5	11,012
ヤクルト本社	12	8.5	55,165
明治ホールディングス	11.5	8	63,600
雪印メグミルク	3.8	2.7	7,111
プリマハム	3	2.3	5,894
日本ハム	6.6	4.8	19,368
丸大食品	2.8	3.2	6,412
S F o o d s	1.6	3.2	8,275
伊藤ハム米久ホールディングス	11.2	9	5,922
サッポロホールディングス	5.8	4.3	9,429
アサヒグループホールディングス	33.9	25.9	107,044
キリンホールディングス	73.1	52.3	115,583
宝ホールディングス	12.4	9.4	8,225
オエノンホールディングス	16.3	10.4	4,149
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12.4	9.4	20,134
サントリー食品インターナショナル	10.9	8.3	36,022
ダイドーグループホールディングス	1.3	0.9	4,788
伊藤園	5	3.7	22,644
キーコーヒー	2.9	1.9	4,423
ユニカフェ	4	4	3,892
ジャパンフーズ	3.9	3.8	4,472
日清オイリオグループ	2.2	1.8	6,192
不二製油グループ本社	4	2.9	8,160
Jーオイルミルズ	1.3	0.8	3,492
キッコーマン	10.7	8.9	47,615
味の素	35.7	27.4	49,799
キュービー	9.1	6.8	14,470
ハウス食品グループ本社	6.1	4.4	15,994
カゴメ	6.5	4.7	14,264
アリアケジャパン	1.4	1.1	8,239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチレイ	8.4	6.3	18,144
東洋水産	8.4	6.3	34,839
日清食品ホールディングス	6.9	5.2	46,280
フジッコ	2.9	3.7	7,355
ロック・フィールド	4.9	4.2	5,846
日本たばこ産業	93.4	71.4	154,331
ユーグレナ	9.9	7.8	5,826
繊維製品 (0.6%)			
片倉工業	5.3	4.6	5,533
グンゼ	1.5	0.5	1,962
東洋紡	6.4	5	7,595
倉敷紡績	2.7	1.9	4,544
日本毛織	7.9	6.2	6,162
帝国繊維	2.6	2.1	5,040
帝人	12.7	9.4	16,750
東レ	122.1	86.6	47,699
日本フェルト	10.5	8.7	4,280
セーレン	4.1	3.9	5,304
小松マターレ	8	6.4	5,049
ワコールホールディングス	4.4	3.1	7,179
ホギメディカル	2.1	1.5	5,325
T S I ホールディングス	9.3	5.5	2,673
三陽商会	3	2.8	2,576
オンワードホールディングス	10.2	7.8	2,979
ゴールドウイン	1.4	2.1	14,385
デサント	3.6	3.5	5,610
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	1.6	1.2	5,244
王子ホールディングス	71.4	51.2	28,262
日本製紙	7.5	5.5	8,965
三菱製紙	9.9	2.6	998
北越コーポレーション	11.9	5.6	2,324
大王製紙	7.2	5.5	8,013
レンゴー	16.2	12.4	10,490
ザ・バック	1.8	1.3	4,134
化学 (7.4%)			
クラレ	26.6	20.5	23,903
旭化成	112.4	80.4	70,711

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
共和レザー	5.2	4.8	3,288
昭和電工	10.5	8.7	22,646
住友化学	125.4	92.9	33,072
日産化学	9.8	6.7	31,222
クレハ	1.5	1.1	5,324
石原産業	5.8	0.6	482
片倉コープアグリ	3.6	3.6	4,320
日本曹達	2.8	2.1	6,352
東ソー	24.8	18.8	28,463
トクヤマ	4.5	3.1	7,973
セントラル硝子	3.4	3	6,219
東亜合成	10.2	7.7	8,038
大阪ソーダ	2.4	1.9	5,008
デンカ	6.1	4.5	12,163
信越化学工業	27.8	20.8	264,784
堺化学工業	2.5	2.1	4,256
エア・ウォーター	13.2	9.9	15,295
大陽日酸	13.3	10.7	19,784
日本パーカライジング	8.4	6.3	7,301
ステラ ケミファ	2.1	1.2	3,214
日本触媒	2.6	2.1	12,768
カネカ	4.1	2.9	8,447
三菱瓦斯化学	16	12.2	19,581
三井化学	14.6	11	25,201
J S R	16.3	11.5	24,058
東京応化工業	2.7	1.9	9,462
三菱ケミカルホールディングス	106.3	80.9	53,175
KHネオケム	2.9	7.1	15,144
ダイセル	24.1	17.6	16,755
住友ベークライト	2.6	1.8	5,553
積水化学工業	34.9	26.1	39,959
日本ゼオン	14.6	11	11,671
アイカ工業	4.7	3.3	10,642
宇部興産	8	6	11,796
旭有機材	4.7	2.8	4,348
日立化成	7.4	—	—
タイガースポリマー	5.8	4.6	2,267
ミライアル	3.9	2.8	3,500

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本化薬	9.6	7.2	7,675
ADEKA	7.5	5.6	8,405
日油	6.1	4.6	17,273
ハリマ化成グループ	5.6	4.7	4,808
花王	39.1	29.4	258,896
ニイタカ	2.8	2.7	9,004
三洋化成工業	1.1	2.8	14,168
日本ペイントホールディングス	13	9.9	76,527
関西ペイント	18	13.6	30,423
中国塗料	7.2	2.6	2,181
太陽ホールディングス	2.4	1.9	9,633
D I C	7.1	5.3	15,110
サカタインクス	4.7	3.5	3,794
東洋インキＳＣホールディングス	3.2	2.4	5,152
富士フイルムホールディングス	33.5	23.6	119,699
資生堂	32	24.6	168,190
ライオン	22.3	16.1	38,801
高砂香料工業	1.7	1.3	3,299
マンダム	3.6	2.8	6,260
ミルボン	2	1.5	7,995
ファンケル	6.9	5.4	16,713
コーセー	2.7	2.3	32,246
コタ	4.4	4.6	5,515
ポーラ・オルビスホールディングス	6.9	5	10,685
ノエビアホールディングス	1.5	0.9	4,441
エスデー	3.3	2.9	4,779
長谷川香料	3.6	2.8	6,577
小林製薬	4.5	3.4	32,912
荒川化学工業	4.4	4	5,412
メック	6	5.1	10,791
タカラバイオ	4	3	8,460
アース製薬	1.4	1	7,070
大成ラミック	1.9	1.6	4,496
クミアイ化学工業	10.7	10.5	9,198
日本農薬	12.7	6.3	3,093
日東電工	11.1	8.5	49,980
レック	2.4	1.9	3,032
前澤化成工業	4.2	3.8	4,199

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エフビコ	1.7	1.3	10,127
天馬	3.1	2.7	4,959
信越ポリマー	9.1	5.2	4,882
ニフコ	6.3	4.7	11,562
バルカー	2	1.6	3,291
ユニ・チャーム	34.1	23.4	94,231
医薬品 (6.9%)			
協和キリン	19.1	12.5	36,062
武田薬品工業	140.6	102.2	425,458
アステラス製薬	148.4	105.8	198,322
大日本住友製薬	12.1	9.1	13,604
塩野義製薬	20.6	15.7	95,393
田辺三菱製薬	17.1	—	—
あすか製薬	5.9	3.7	4,343
日本新薬	4.2	3.2	28,480
中外製薬	16.8	12.8	192,320
科研製薬	3	2.2	12,672
エーザイ	19.2	14.7	118,335
ロート製薬	8.2	6	19,890
小野薬品工業	38.2	28.3	85,777
久光製薬	4.7	3.3	17,523
持田製薬	2.4	1.6	6,544
参天製薬	30.3	23	45,126
ツムラ	5	3.7	10,789
日医工	5	3.8	4,951
キッセイ薬品工業	2.7	2.1	5,848
生化学工業	5	4.1	4,797
栄研化学	2.7	2.2	3,993
鳥居薬品	1.9	1.5	4,785
J C Rファーマ	1.1	0.8	9,600
東和薬品	2.7	1.9	4,318
沢井製薬	3.3	2.3	13,432
ゼリア新薬工業	3.9	3	6,396
第一三共	46	35.4	328,972
キョーリン製薬ホールディングス	3.8	3	6,831
大幸薬品	3.8	8.5	16,405
大塚ホールディングス	30.6	23.4	109,254
大正製薬ホールディングス	3.6	2.6	17,498

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ペプチドリーム	8	6.2	30,535
石油・石炭製品 (0.5%)			
ニチレキ	6.7	5.6	9,189
出光興産	18.7	13.8	32,857
J X T Gホールディングス	270.8	186.2	78,743
コスモエネルギーホールディングス	4.5	3.3	5,765
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	9.3	6.8	11,206
TOYO TIRE	8.1	6.6	10,223
ブリヂストン	49.4	35.4	128,856
住友ゴム工業	14.5	10.8	12,312
オカモト	1.2	0.7	2,712
ニッタ	1.9	1.4	3,213
住友理工	7.4	4.3	2,850
パンドー化学	4.4	3.7	2,493
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	3	1.6	9,248
A G C	16	12.2	39,589
日本山村硝子	3.4	3.2	2,752
日本電気硝子	6.9	5.1	8,853
住友大阪セメント	3.3	2.3	8,855
太平洋セメント	10.2	7.6	19,486
日本ヒューム	6.8	6.4	4,723
東海カーボン	14.7	11.6	11,414
東洋炭素	2.7	2.6	4,308
T O T O	12.5	8.8	37,488
日本碍子	19.5	14.8	23,428
日本特殊陶業	13.7	10.4	18,584
ニチアス	4.1	3.1	7,722
ニチハ	2.5	1.6	3,811
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	73.7	54.7	58,446
神戸製鋼所	29.4	22.3	9,410
合同製鐵	2.3	—	—
ジェイ エフ イー ホールディングス	42.9	32.9	27,405
東京製鐵	8.6	4.1	2,988
共英製鋼	2.1	3.4	5,025
大和工業	3.3	2.3	5,221

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪製鐵	3	1.7	2,252
淀川製鋼所	2.9	2.3	3,999
丸一銅管	5.6	4.2	11,894
大同特殊鋼	2.5	2	7,670
山陽特殊製鋼	2.4	2.6	2,670
愛知製鋼	1	1.6	4,952
日立金属	17.1	12.9	15,957
大太平洋金属	1.3	0.9	1,584
新日本電工	26.8	12.7	2,120
三菱製鋼	4.2	3.8	2,853
シンニッタン	11.5	8.3	2,473
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	44.6	36.6	6,697
三井金属鉱業	4.3	3.3	7,850
東邦亜鉛	1.3	1.9	3,057
三菱マテリアル	10.4	7.7	18,849
住友金属鉱山	21.9	15.6	46,675
DOWAホールディングス	3.8	2.6	9,126
古河機械金属	4.3	3.6	4,161
UACJ	3.4	2.5	5,302
古河電気工業	4.5	3.2	8,515
住友電気工業	59.4	45.6	58,322
フジクラ	18.4	12.9	4,321
タツタ電線	12.7	7.1	4,473
リョービ	3.2	2.4	3,439
アサヒホールディングス	3.6	—	—
金属製品 (0.6%)			
トーカロ	6.4	3.2	3,427
SUMCO	17.6	13.9	23,199
東洋製鐵グループホールディングス	10.1	7.5	8,895
コ罗纳	4.1	3.8	3,746
横河ブリッジホールディングス	4.2	2.9	6,049
駒井ハルテック	1.8	1.8	2,700
三和ホールディングス	16.1	12.1	11,482
文化シャッター	7.5	3.3	2,676
三協立山	5.5	4.7	4,676
LIXILグループ	24	18	28,584
ノーリツ	4.7	4.9	6,237

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
長府製作所	2.7	2.2	5,225
リンナイ	2.9	2.2	20,790
日東精工	9.1	9.1	4,504
東ブレ	2.7	2.7	3,666
高周波熱錬	7.8	3.8	2,226
パイオラックス	2.7	2.8	4,961
日本発條	16.3	12.2	9,430
三益半導体工業	4.6	4.2	9,399
機械 (5.1%)			
日本製鋼所	4.9	3.6	5,914
三浦工業	6.9	5	22,700
タクマ	5.7	4.5	6,165
オークマ	2	1.1	5,137
芝浦機械	2.9	0.4	965
アマダ	24.7	16.3	15,974
アイダエンジニアリング	7.6	5.7	4,542
F U J I	5.7	4.3	8,660
牧野フライス製作所	1.7	1.3	4,524
オーエスジー	7.8	5.9	9,440
旭ダイヤモンド工業	9.2	4.8	2,563
DMG森精機	10	7.4	10,182
ディスコ	2.2	1.7	42,704
日東工器	2.9	2.6	5,200
島精機製作所	2.3	1.6	2,729
日阪製作所	7	4.6	3,611
ナプテスコ	8.8	7.3	25,075
SMC	4.7	3.8	215,878
ユニオンツール	2	1.8	5,113
オイレス工業	3	2.2	3,262
サトーホールディングス	2.4	0.1	253
小松製作所	72.9	55.7	124,962
住友重機械工業	9.1	6.7	17,125
日立建機	6.4	4.6	13,294
巴工業	2.6	2.4	4,348
井関農機	3.3	2.8	3,626
タカキタ	6	6	3,444
クボタ	86.4	65.2	99,430
月島機械	5.2	4.1	5,211

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
帝国電機製作所	5.8	3.9	5,241
新東工業	6	4.9	3,988
小森コーポレーション	5.9	4.5	3,591
鶴見製作所	3.6	3.2	6,192
住原製作所	7.1	5.2	13,707
西島製作所	6.4	5.9	4,950
ダイキン工業	22	15.7	250,179
栗田工業	8.6	6.3	18,578
椿本チエイン	1.9	2.3	6,674
ダイフク	8.9	6.3	53,235
タダノ	7.8	5.8	5,156
フジテック	6.1	4.9	8,143
CKD	6	3.7	6,893
平和	4.5	3.2	5,961
SANKYO	4	3	8,493
日本金銭機械	5.8	4.3	2,562
フクシマガリレイ	1.9	1	3,425
竹内製作所	3.7	1.3	2,418
アマノ	4.6	3.3	7,692
グローリー	4.5	3.9	10,104
大和冷機工業	6.4	4.7	4,685
セガサミーホールディングス	16.3	12.3	17,650
リケン	1.1	0.7	2,026
ホシザキ	4.7	3.6	32,076
大豊工業	5.8	3.7	2,049
日本精工	33.7	25.8	21,981
NTN	37.3	30.5	7,472
ジェイテクト	16	12.1	10,938
不二越	1.5	1.2	4,374
日本トムソン	9.5	5	2,175
THK	10.2	7.7	23,015
ユージン精機	5.2	4	2,860
キッツ	8.7	7.1	5,197
マキタ	19.7	16	58,800
日立造船	16.5	10.7	4,461
三菱重工業	27	20.7	60,195
IHI	12.5	9.4	15,369
スター精密	3.9	5.2	6,910

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気機器 (14.7%)			
日清紡ホールディングス	8.9	7.1	5,829
イビデン	9.8	7.3	21,089
コニカミノルタ	35.9	27.3	11,711
ブラザー工業	20.8	15.2	31,175
ミネベアミツミ	29.7	22.9	44,105
日立製作所	72.3	59.4	212,652
三菱電機	161	123.2	181,288
富士電機	10.4	7.9	23,976
安川電機	18.8	13.3	52,601
明電舎	4.4	3.3	6,190
東芝テック	2.9	1.4	5,243
マブチモーター	4.3	3.3	11,946
日本電産	19.4	29.6	202,404
東光高岳	3.4	3.2	3,475
ダイヘン	2.5	1.6	5,840
日新電機	6.2	3	3,480
オムロン	17.1	11	80,520
日東工業	3.7	2.5	4,897
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.6	4.4	8,408
メルコホールディングス	1.8	1.6	4,339
テクノメディカ	2.1	1.8	3,265
日本電気	20.9	14.9	72,041
富士通	15.5	11.8	129,859
神電気工業	6.6	5.2	5,720
サンケン電気	2.9	2.4	5,966
アイホン	3.6	2.8	4,510
ルネサスエレクトロニクス	16.7	58.8	33,516
セイコーエプソン	20.4	15.5	19,297
ワコム	16.6	4.7	2,256
アルパック	3.4	2.6	8,502
EIZO	1.7	1.2	4,800
日本信号	6.4	5.3	6,519
能美防災	2.7	2.1	4,237
ホーチキ	3.9	3.5	4,865
エレコム	—	1.3	6,318
パナソニック	183.9	140.5	137,577
シャープ	16	14.6	17,782

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アンリツ	10.7	8	16,864
富士通ゼネラル	5	4	8,536
ソニー	107.9	76.8	528,691
T D K	8.4	5.9	59,295
アルプスアルパイン	16.7	10.8	14,580
日本トリム	0.9	0.1	321
フォスター電機	4.4	3.4	4,243
ヨコオ	2.9	2.4	6,768
ホシデン	5.9	4.2	4,023
ヒロセ電機	2.3	2.1	27,426
日本航空電子工業	4.9	3.5	5,236
アイコム	2.6	2.2	6,564
船井電機	8.3	6.2	3,360
横河電機	16.4	12.6	19,656
アズビル	10.6	8	21,632
日本光電工業	7.1	5.3	18,894
堀場製作所	3.1	2.4	14,112
アドバンテスト	10.8	9.1	48,685
キーエンス	7.9	11.2	499,296
日置電機	1.6	1.2	4,152
シスメックス	12.5	8.8	75,152
OBARA GROUP	1.3	0.8	2,616
コーセル	4.1	3.6	3,416
イリソ電子工業	1.5	1.1	3,916
オブテックスグループ	4.2	3.5	5,120
千代田インテグレ	2.8	2.6	4,739
レーザーテック	3.4	5.4	46,170
スタンレー電気	11.3	8.3	22,551
ウシオ電機	9.6	7.1	9,187
日本セラミック	2	2.3	4,905
図研	5.2	2.7	6,831
日本電子	—	2.5	7,925
カシオ計算機	14.1	10.5	20,254
ファナック	15.3	11.9	235,144
ローム	7.7	5.5	40,865
浜松ホトニクス	11.6	8.8	41,140
三井ハイテック	5	3.5	5,089
新光電気工業	7.8	5.1	7,104

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京セラ	24.5	17.3	102,727
太陽誘電	6.9	5	14,910
村田製作所	50.6	36.2	223,716
双葉電子工業	3.7	3	2,991
ニチコン	6.4	1.8	1,425
日本ケミコン	2.1	1.7	2,782
K O A	4.1	3.3	3,385
小糸製作所	9.7	7.4	34,743
ミツバ	8.5	7.8	3,588
S C R E E Nホールディングス	2.9	2.1	10,479
キャノン電子	3.8	2.6	4,477
キャノン	86.8	65.7	151,701
リコー	49	32.1	26,289
象印マホービン	—	3.5	5,904
東京エレクトロン	10.7	7.8	172,263
輸送用機器 (7.5%)			
トヨタ紡織	5.3	3.9	6,076
ユニプレス	3	2.3	2,497
豊田自動織機	13	9.8	54,684
モリタホールディングス	3.5	2.6	4,768
デンソー	35.4	27.1	114,172
東海理化電機製作所	4.2	3.5	5,726
三井E&Sホールディングス	7.3	—	—
川崎重工業	12.7	9.5	17,128
日産自動車	189.9	144.6	64,983
いすゞ自動車	51.1	37.4	38,222
トヨタ自動車	179.3	137.3	957,392
日野自動車	19.9	14.9	11,249
三菱自動車工業	59.9	45.6	15,230
武蔵精密工業	3.9	2.9	2,911
日産車体	7.4	3.3	3,517
新明和工業	6.7	5	5,495
極東開発工業	4	3	4,128
日信工業	4.7	3	6,678
トビー工業	1.7	1.3	1,783
ティラド	3.1	2.4	3,542
N O K	8.5	6.2	9,039
フタバ産業	11.2	2.8	1,503

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KYB	2.1	1.8	4,078
プレス工業	13.9	8.3	2,307
ケーヒン	3.7	2.9	7,455
アイシン精機	13.3	10.2	35,598
マツダ	50.8	37	27,565
今仙電機製作所	6	6	4,572
本田技研工業	135.8	96.5	279,657
スズキ	29.4	24.4	95,745
SUBARU	50	38.3	94,179
ヤマハ発動機	22.4	16.2	26,065
ショーワ	5.1	3.5	7,959
エクセディ	2.5	4.6	8,307
豊田合成	5.2	3.8	8,968
愛三工業	7.9	7.2	4,262
ヨロズ	3.5	3	3,897
エフ・シー・シー	2.9	2.4	4,574
シマノ	6.5	4.6	91,586
テイ・エス テック	3.7	2.7	8,478
精密機器 (2.6%)			
テルモ	45.5	34.8	144,280
クリエートメディック	4.4	4.4	4,404
島津製作所	20.9	14.8	43,808
ブイ・テクノロジー	0.6	0.8	3,400
東京精密	2.8	2.2	7,931
マニー	2	4.6	13,022
ニコン	28.5	20.9	22,760
トプコン	8.3	6.1	5,764
オリンパス	96.1	68	125,834
理研計器	2.7	3.1	7,582
タムロン	2.7	1.8	3,780
HOYA	32.4	24.5	247,817
朝日インテック	6.7	13.8	44,160
シチズン時計	18.9	15.3	6,089
メニコン	2	1.5	7,695
セイコーホールディングス	2.9	2	3,820
ニプロ	11.1	8.3	10,524
その他製品 (2.4%)			
パラマウントベッドホールディングス	1.8	1.3	5,473

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
バンダイナムコホールディングス	16.8	12.7	76,504
アイフィスジャパン	6.1	5	3,480
パイロットコーポレーション	2.7	1.9	7,144
トッパン・フォームズ	6.9	5.2	5,829
フジシールインターナショナル	3.6	2.8	6,176
タカラトミー	7.3	5.9	5,599
タカノ	4.9	4.5	3,199
大建工業	3	4.8	8,400
凸版印刷	22.5	17.5	30,467
大日本印刷	22.7	16.2	39,479
N I S S H A	4.3	4	4,128
アシックス	15.4	11.1	13,231
小松ウオール工業	2.3	2.2	4,312
ヤマハ	9.6	7.3	37,960
クリナップ	6.8	5.7	3,032
ビジョン	9.8	7.5	32,025
キングジム	5.8	5.8	5,579
リンテック	3.6	2.5	6,437
イトーキ	11.2	9.7	4,132
任天堂	9.2	7.6	333,336
三菱鉛筆	2.8	3	4,506
タカラスタンダード	4.1	3.2	5,081
コクヨ	7.5	5.5	7,843
オカムラ	6	4.2	3,704
美津濃	2.9	2.5	5,175
電気・ガス業 (1.6%)			
東京電力ホールディングス	129.1	98.6	36,482
中部電力	49.4	37.6	55,121
関西電力	65.6	46.9	52,340
中国電力	22.4	17.6	26,294
北陸電力	16	12.2	8,820
東北電力	37.6	30.4	33,531
四国電力	14.9	11.2	9,296
九州電力	33.5	25.4	23,368
北海道電力	15.7	12.8	5,619
沖縄電力	3.1	2.205	4,421
電源開発	12.9	9.7	19,564
東京瓦斯	31.5	23.9	61,028

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪瓦斯	31.2	23.9	51,480
東邦瓦斯	7.9	6	31,200
北海道瓦斯	3.7	3.5	5,540
西部瓦斯	2.8	2.2	5,915
静岡ガス	7.1	5.9	5,787
陸運業 (4.3%)			
東武鉄道	17.2	12.9	49,600
相鉄ホールディングス	5.5	4.1	12,771
東急	43.8	31.2	54,756
京浜急行電鉄	22.4	16	29,728
小田急電鉄	26	18.4	48,815
京王電鉄	9	6.4	40,960
京成電鉄	12	8.6	30,573
富士急行	2.1	1.8	6,354
東日本旅客鉄道	28.6	21.6	182,757
西日本旅客鉄道	14.5	10.8	76,690
東海旅客鉄道	14.4	10.2	190,077
西武ホールディングス	20.4	16.2	23,409
西日本鉄道	4.3	3	8,739
近鉄グループホールディングス	15.2	11.7	64,350
阪急阪神ホールディングス	20.4	15.6	63,414
南海電気鉄道	6.8	5	13,210
京阪ホールディングス	6.9	5.2	26,832
名古屋鉄道	12.4	9.6	31,344
日本通運	6	4.4	24,376
ヤマトホールディングス	26.9	20.4	47,389
山九	4.2	3.2	13,664
丸運	16.9	15.6	3,790
センコーグループホールディングス	9.3	7.4	6,245
トナミホールディングス	1	2.7	15,417
ニッコンホールディングス	5.7	4.2	9,231
日本石油輸送	1.5	1	3,220
福山通運	2	2.5	8,812
セイノーホールディングス	11.6	8.6	12,607
日立物流	3.4	2.5	7,090
C&Fロジホールディングス	4.5	4	6,188
九州旅客鉄道	12.9	10.3	32,599
S Gホールディングス	14.6	12.2	41,663

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.1%)			
日本郵船	13	9.8	15,640
商船三井	9.1	6.8	13,681
川崎汽船	5.8	1.5	1,789
飯野海運	13.5	8.2	2,894
空運業 (0.4%)			
日本航空	27.8	20.7	45,798
A N Aホールディングス	27.9	21.3	57,328
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	5.2	3.8	10,442
三井倉庫ホールディングス	2.8	2.3	3,705
住友倉庫	5.6	4.4	5,878
東陽倉庫	15.9	15.4	5,220
安田倉庫	6	5.8	5,318
上組	9.5	7.1	14,626
キムラユニティー	3.9	3.9	4,044
キューソー流通システム	1.8	1.8	3,142
近鉄エクスプレス	4.5	3.5	6,107
エーアイテイー	5.3	4.7	3,877
情報・通信業 (9.3%)			
N E C ネットエスアイ	3.1	7.5	14,385
システナ	6.1	4.6	7,042
デジタルアーツ	1	1.1	9,383
日鉄ソリューションズ	2.3	1.6	4,659
T I S	5.4	12	26,760
ネオス	5.9	0.9	634
電算システム	2.1	0.9	3,154
グリー	11.9	9.1	4,095
コーエーテクモホールディングス	3.9	2.9	8,801
ブレインパッド	1	0.7	3,454
K L a b	6.9	3.1	2,377
ネクソン	40.7	33.8	73,379
エイチーム	3.3	0.9	693
コロプラ	7.7	4.4	4,620
サイバーリンクス	2.8	3.1	5,130
C A R T A H O L D I N G S	3.5	0.3	319
ティーガイア	2.7	2.2	5,077
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40.4	3	5,322

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
GMOペイメントゲートウェイ	2.6	2.5	29,625
ザッパラス	11	7.9	2,962
インターネットイニシアティブ	3.1	2.2	7,997
L I N E	4.7	2.5	13,400
フェイス	3	3	1,998
野村総合研究所	10.2	17.3	46,848
C Eホールディングス	6.1	6.8	3,366
インテージホールディングス	7	6.2	5,462
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3	2.8	3,127
フジ・メディア・ホールディングス	16.7	12.8	14,131
オービック	5.5	4.2	76,566
ジャストシステム	2	2	14,020
Zホールディングス	105.7	166.9	74,938
トレンドマイクロ	8.6	5.3	31,482
日本オラクル	3.3	2.5	30,500
フューチャー	4.9	6.4	11,110
C A C H o l d i n g s	5	6.6	8,586
S Bテクノロジー	3.3	2	5,466
オービックビジネスコンサルタント	1.7	1.1	5,786
伊藤忠テクノソリューションズ	7.3	5.3	18,682
大塚商会	8.7	6.5	33,150
サイボウズ	6.6	0.9	2,337
電通国際情報サービス	2.9	1.4	6,748
デジタルガレージ	3.1	2.2	8,360
ウェザーニューズ	1.6	1.3	4,862
日本エンタープライズ	18.9	0.1	27
ネットワンシステムズ	5.7	4.2	13,377
アルゴグラフィックス	4	1.5	5,137
エイベックス	4.7	4	3,900
日本ユニシス	5	3.7	11,729
兼松エレクトロニクス	1.8	2.4	9,420
東京放送ホールディングス	10.4	7.8	13,322
日本テレビホールディングス	14.8	11.3	14,181
テレビ朝日ホールディングス	4.3	3.2	5,366
スカパーJ S A Tホールディングス	14.5	12.2	5,416
テレビ東京ホールディングス	1.4	2.9	7,145
日本電信電話	108.1	161.2	397,116
K D D I	139.3	89.9	283,274

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトバンク	167.6	109.8	149,767
光通信	1.9	1.2	29,244
N T T ドコモ	100.2	86.2	256,574
GMOインターネット	5.7	4.6	12,305
K A D O K A W A	5	3.5	6,034
ゼンリン	3.2	2.7	3,677
松竹	1	0.6	8,574
東宝	10.4	7.2	28,728
東映	0.7	0.4	5,904
エヌ・ティ・ティ・データ	42.7	32.3	40,891
ビジネスブレイン太田昭和	1.9	1.3	3,467
D T S	1.9	3	6,792
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7.4	5.2	27,196
カプコン	7	5.4	19,845
S C S K	4.3	3.2	16,544
アイネス	6.6	6.1	8,552
T K C	2.5	1.9	10,317
富士ソフト	2.4	1.9	8,550
N S D	2.6	4	6,660
コナミホールディングス	6.6	5	19,250
ソフトバンクグループ	66	95.4	460,495
卸売業 (4.8%)			
伊藤忠食品	1.2	0.9	4,302
エレマテック	3.1	4.8	4,372
J A L U X	2.2	2	3,682
双日	90	69	17,526
アルフレッサ ホールディングス	17.8	13.4	28,622
横浜冷凍	7	8.9	8,214
神戸物産	2.3	4.1	21,976
あい ホールディングス	3.8	3	4,431
ダイワボウホールディングス	1.4	1	7,070
マクニカ・富士エレホールディングス	5	3.7	6,578
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4.9	3.7	3,984
レスターホールディングス	3.1	2.4	4,946
O C H I ホールディングス	3.1	3.1	4,578
T O K A I ホールディングス	9	6.7	6,733
シップヘルスケアホールディングス	3.4	2.4	10,908
明治電機工業	2.8	2.8	3,922

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コメダホールディングス	3.4	2.7	5,116
エコートレーディング	8.1	7.4	3,855
ナガイレーベン	2.5	1.8	4,786
三菱食品	2.7	2.1	5,693
松田産業	4	3.7	5,324
第一興商	2.2	1.8	6,858
メディバルホールディングス	17.1	13.1	27,627
アズワン	1.1	0.7	8,106
尾家産業	3.3	3.2	4,860
ドウシシャ	3.6	3.2	4,870
丸文	7.5	5.2	2,558
橋本総業ホールディングス	2.9	2.7	5,130
日本ライフライン	4.9	3.1	4,420
進和	3.3	2.7	5,283
オーハシテクニカ	3.9	2.3	3,859
白銅	2.4	2.4	3,427
伊藤忠商事	111	84.8	197,584
丸紅	156.9	125.4	66,399
長瀬産業	9.3	7	9,639
豊田通商	17.8	13.5	36,990
兼松	6.6	5.3	7,234
三井物産	130.7	106.8	178,249
日本紙パルプ商事	1.5	1.1	4,488
日立ハイテック	4.9	—	—
山善	6.9	5	4,775
住友商事	93.9	76.5	99,373
内田洋行	1.3	1	5,500
三菱商事	111.4	84.6	213,826
キャノンマーケティングジャパン	4.3	2.9	6,530
西華産業	4.1	3.9	4,797
菱洋エレクトロ	4.2	2.1	5,772
東京産業	7.6	2.4	1,358
阪和興業	2.7	1.8	3,691
岩谷産業	3.6	2.6	9,880
イワキ	8.6	9.2	4,388
三愛石油	6.9	5.5	5,978
稲畑産業	4.8	3.9	5,257
ワキタ	6.4	2.3	2,435

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦ホールディングス	4.6	3.3	7,065
サンゲツ	5	3.9	6,279
シナネンホールディングス	2.8	1.9	5,660
伊藤忠エネクス	6.7	5.4	4,692
サンリオ	4.8	3.6	6,573
リョーサン	2.5	1.9	4,672
三信電気	3.7	2.3	3,813
モスフードサービス	2.9	2.2	6,721
加賀電子	3.4	2.9	6,965
立花エレテック	3.7	2.5	4,410
フォーバル	5.7	5.2	6,021
PALTAC	2.8	2	10,520
日鉄物産	1.7	1.3	4,875
トラスコ中山	3.4	2.6	6,585
オートバックスセブン	6.1	4.8	6,484
加藤産業	2.5	1.7	6,349
イノテック	5	4.6	4,595
杉本商事	3.1	2.7	5,092
因幡電機産業	2.3	3.2	8,044
ミスミグループ本社	19.8	15.2	44,536
スズケン	7.2	5.4	20,817
ジェコス	5.3	5.3	5,379
小売業 (4.9%)			
ローソン	4	2.9	17,284
サンエー	1.3	2	8,520
エービーシー・マート	2.4	1.9	12,559
ハードオフコーポレーション	4.5	4.5	3,222
アスクル	1.9	2.3	7,624
ゲオホールディングス	3.6	2.9	4,184
アダストリア	2.6	1.7	3,070
ジーフット	5.2	4.1	2,033
エディオン	7	5.3	5,326
あみやき亭	1.8	1.5	4,822
ハニーズホールディングス	5.6	0.2	243
ジンズホールディングス	1.2	0.5	3,355
ビックカメラ	8.8	6.6	7,497
DCMホールディングス	8.7	6.4	7,161
Monotaro	10	8.6	33,239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J. フロント リテイリング	20.5	15.6	15,007
ドトール・日レスホールディングス	3.6	2.9	5,283
マツモトキョシホールディングス	6.4	4.9	19,943
ZOZO	17.1	8.7	16,912
トレジャー・ファクトリー	3.8	0.1	75
ココカラファイン	1.7	1.1	6,204
三越伊勢丹ホールディングス	29.8	22.9	17,014
ウエルシアホールディングス	4.1	3.6	31,212
クリエイトSDホールディングス	2.6	2	6,590
シュッピン	4.1	4	3,352
ジョイフル本田	4.8	4.1	5,576
すかいらーくホールディングス	14.9	13.7	24,536
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5.1	3.6	4,021
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.7	5.6	3,309
あさひ	4	3.3	4,943
コスモス薬品	0.7	1	15,130
トーエル	3.6	3.6	2,592
セブン&アイ・ホールディングス	66.3	47.4	178,698
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	5,908
ツルハホールディングス	3.4	2.6	40,846
サンマルクホールディングス	3.2	2.3	4,344
トリドールホールディングス	4.5	3.6	4,626
クスリのアオキホールディングス	1.5	1.1	9,724
スシローグローバルホールディングス	1.7	6.4	14,387
カップバ・クリエイト	6	4.6	7,070
ライトオン	5.4	0.2	113
良品計画	2.2	17.5	29,102
三城ホールディングス	10.3	6.9	2,014
アドヴァン	4.6	3.9	4,855
G-7ホールディングス	2.8	3.1	7,207
エコス	2.1	2.1	3,935
マルシェ	5.3	4.2	2,742
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	9.5	26.8	58,343
西松屋チェーン	5.1	3.9	3,712
ゼンショーホールディングス	7.6	5.8	13,473
サイゼリヤ	4.1	3.4	7,884
魚力	2.9	2.9	4,524

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユナイテッドアローズ	1.8	1.3	2,499
ハイデイ日高	3.2	2.3	4,404
京都きもの友禅	4.9	3.6	878
コロナイド	5.1	3.8	6,361
老番屋	1.7	1.2	6,660
スギホールディングス	3.5	2.5	17,250
薬王堂ホールディングス	—	1.3	3,425
スクロール	9	6.4	2,374
ファミリーマート	17.7	9.6	19,132
木曽路	3	2.2	5,640
千趣会	12.8	15.6	6,380
ケーヨー	11.5	7.8	4,984
上新電機	2.5	2	4,536
日本瓦斯	2.7	1.9	7,951
ロイヤルホールディングス	3	1.8	3,619
いなげや	4.1	2.6	4,453
島忠	3.1	2.4	7,046
チヨダ	2.4	1.9	2,053
ライフコーポレーション	2	1.5	4,845
AOKIホールディングス	3.4	7.5	5,325
コメリ	2.5	1.8	4,701
青山商事	2.8	5	4,435
しまむら	1.8	1.2	9,060
高島屋	12.5	9.4	10,246
松屋	4.4	3.5	2,499
エイチ・ツー・オー リテイリング	7.8	6.3	5,594
パルコ	5	—	—
丸井グループ	13.5	10.9	21,560
アクシアル リテイリング	1.7	0.7	2,887
イオン	61	46.7	111,636
イズミ	3.2	2.2	7,524
平和堂	3	3.1	6,066
フジ	2.9	2.3	4,514
ヤオコー	1.8	1.2	8,244
ゼビオホールディングス	4.7	4.2	4,053
ケーズホールディングス	16.1	12.1	16,685
Genky DrugStores	1.7	1.4	3,822
ブックオフグループホールディングス	4.5	1.1	965

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アインホールディングス	2.1	1.7	11,985
ヤマダ電機	48.8	37	19,388
ニトリホールディングス	6.9	5.3	102,581
吉野家ホールディングス	5.5	4.3	10,621
王将フードサービス	1.1	0.9	5,778
ブレナス	4.7	3.2	6,073
ミニストップ	3	2.6	3,988
アークス	2.8	3	6,480
パローホールディングス	3.3	2.4	5,044
ファーストリテイリング	2.1	1.6	94,576
サンドラッグ	5.8	4.3	15,372
ヤマザワ	2.4	2.4	4,132
ペルーナ	5.8	1.7	923
銀行業 (5.2%)			
めぶきフィナンシャルグループ	83.8	64	16,000
東京きらばしフィナンシャルグループ	3.3	2.4	2,565
九州フィナンシャルグループ	25.8	22.5	10,687
ゆうちょ銀行	45.1	34.4	30,960
コンコルディア・フィナンシャルグループ	100.1	74	26,344
西日本フィナンシャルホールディングス	9.8	7.3	5,204
関西みらいフィナンシャルグループ	7.3	1.7	685
三十三フィナンシャルグループ	2.5	2.1	3,217
第四北越フィナンシャルグループ	2.5	2	4,672
新生銀行	11.8	8.8	12,504
あおぞら銀行	8.8	6.4	13,107
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,092.3	828.7	378,881
りそなホールディングス	173.6	133.8	52,583
三井住友トラスト・ホールディングス	31.2	23	73,531
三井住友フィナンシャルグループ	111.8	83.9	267,641
千葉銀行	54.2	40.9	21,063
群馬銀行	32.8	25.2	8,416
武蔵野銀行	2.5	2.6	3,998
千葉興業銀行	11.6	—	—
七十七銀行	4.6	3.5	5,470
青森銀行	1	0.4	872
秋田銀行	1.7	1.3	2,031
山形銀行	2.3	2.6	3,510
岩手銀行	1.5	1	2,603

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	17.6	8.4	2,032
東北銀行	1.3	0.9	839
ふくおかフィナンシャルグループ	13.8	10.4	18,647
静岡銀行	40.1	30.5	21,106
十六銀行	2.4	2.6	5,712
スルガ銀行	—	13.4	5,507
八十二銀行	36.2	27.2	11,016
山梨中央銀行	2.4	1.9	1,818
大垣共立銀行	3.1	2.6	6,003
福井銀行	2.5	2.1	3,567
北國銀行	1.8	1.9	5,553
滋賀銀行	3	2.3	5,911
南都銀行	2.3	1.6	3,721
百五銀行	15.5	15.5	5,068
京都銀行	5.7	4.2	16,884
紀陽銀行	5.5	4	6,756
ほくほくフィナンシャルグループ	10.4	7.6	7,037
広島銀行	23.5	17.7	9,062
山陰合同銀行	8.7	3.6	2,005
中国銀行	13.1	9.6	9,532
鳥取銀行	0.9	0.9	1,126
伊予銀行	21.3	15.8	9,843
百十四銀行	2.7	2.2	4,485
四国銀行	3.4	5.7	4,799
阿波銀行	2.5	2.3	5,773
大分銀行	0.9	1.6	4,155
宮崎銀行	1.5	1	2,439
佐賀銀行	2.8	2.4	2,796
沖縄銀行	1.9	1.3	4,303
琉球銀行	4.1	4.2	4,153
セブン銀行	55.1	42.3	13,197
みずほフィナンシャルグループ	2,160.2	1,652.4	225,222
山口フィナンシャルグループ	19.9	15	9,810
長野銀行	0.9	0.9	1,030
名古屋銀行	1.6	1.1	2,590
北洋銀行	24.9	17.8	3,666
中京銀行	2	1.8	3,781
愛媛銀行	3.6	2.8	3,250

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	1.7	1,791
京葉銀行	8	7	3,661
栃木銀行	18.8	19.3	3,261
トモニホールディングス	13.3	13.2	4,752
フィデアホールディングス	27.9	17	1,853
池田泉州ホールディングス	19.9	10.4	1,768
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	7	5.7	3,756
S B I ホールディングス	18.8	13.7	31,551
ジャフコ	2.5	1.9	6,963
大和証券グループ本社	126.6	98	44,825
野村ホールディングス	280.6	213.4	100,938
岡三証券グループ	14.3	10.2	3,641
丸三証券	6.3	5.1	2,397
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18.2	11	2,860
水戸証券	9.6	12.3	2,644
いちよし証券	4.8	6	2,916
松井証券	7.7	6.1	5,221
だいこう証券ビジネス	7.7	6.9	6,341
マネックスグループ	16.2	4.2	1,003
カブドットコム証券	13.9	—	—
極東証券	4.2	5.6	3,046
藍澤證券	5.6	4.9	3,537
保険業 (2.0%)			
かんぽ生命保険	5.9	4.7	6,659
S O M P O ホールディングス	28	22.8	86,685
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	41.5	31.5	97,965
ソニーフィナンシャルホールディングス	13.1	9.8	25,431
第一生命ホールディングス	89.9	68.5	97,475
東京海上ホールディングス	56.9	43.1	203,863
T & D ホールディングス	49.5	36.7	36,589
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	4.4	3.1	12,989
クレディセゾン	10.9	8.1	10,756
芙蓉総合リース	1.9	1.3	8,190
みずほリース	2.9	2.1	5,071
東京センチュリー	3.1	2.4	11,160
日本証券金融	9.4	4.8	2,496

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイフル	26.9	21	5,628
リコーリース	1.9	1.4	4,529
イオンフィナンシャルサービス	10.4	8	10,000
アコム	33.1	25.3	11,182
オリエントコーポレーション	49.8	28.9	3,757
日立キャピタル	3.7	2.9	6,440
オリックス	106	76.4	110,627
三菱UFJリース	36.7	27.5	14,602
日本取引所グループ	42.7	34.9	79,676
アサックス	7.4	6.1	3,965
NECキャピタルソリューション	3.2	1.5	3,078
不動産業 (2.1%)			
いちご	23	18.1	5,719
ヒューリック	33.9	25.9	28,205
野村不動産ホールディングス	10.6	8.1	16,305
オープンハウス	2.3	3.1	9,123
東急不動産ホールディングス	42.4	31.9	17,672
飯田グループホールディングス	13.2	9.9	16,047
パーク24	9.2	7	15,169
三井不動産	84.4	59.8	124,055
三菱地所	111.5	85	149,642
平和不動産	3.6	2.9	8,624
東京建物	17.8	13.6	19,271
ダイビル	6.6	5.2	5,538
京阪神ビルディング	6.9	2.5	3,695
住友不動産	35.7	27.3	83,729
テアオーシー	9.3	6.2	4,216
スターツコーポレーション	2.6	1.9	4,216
空港施設	10	6.1	2,745
ゴールドクレスト	3.8	3.4	5,409
エスリード	3.6	1.5	2,229
A V A N T I A	5.2	4.6	3,638
イオンモール	8.3	6.3	9,821
カチタス	2.2	3.4	8,238
日本空港ビルデング	5.1	3.9	18,037
サービス業 (5.3%)			
日本M&Aセンター	11.4	8.8	37,136
パソナグループ	4.3	5.2	6,635

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
G C A	7.7	7.3	4,861
エス・エム・エス	5.6	4.2	11,163
パーソルホールディングス	15.3	12	17,292
クックパッド	17.5	11.6	3,723
学情	3	0.9	1,214
スタジオアリス	3	1.7	2,840
シミックホールディングス	2.9	1.7	2,561
N J S	2.7	2.5	4,542
総合警備保障	6.2	4.7	24,910
カカココム	11.7	8.7	22,446
アイロムグループ	3.1	1.5	3,303
ディップ	5.5	3.9	10,315
キャリアデザインセンター	2.5	2.5	2,522
ベネフィット・ワン	4.2	3.5	8,200
エムスリー	32.6	25.8	109,392
アウトソーシング	7.7	4.4	2,833
ディー・エヌ・エー	8.1	6.1	9,028
博報堂DYホールディングス	21.7	16.4	21,976
ぐるなび	11.4	0.2	134
ファンコミュニケーションズ	11.8	10.5	4,935
WDBホールディングス	2.6	1.5	3,841
インフォマート	8.2	12.2	10,736
E P Sホールディングス	3.7	2.8	3,141
クイック	4	3.7	4,754
ケネディクス	14.9	11.1	6,604
電通グループ	18.8	12.3	36,813
みらかホールディングス	4.4	3.1	7,722
ダイオーズ	3.9	3.8	4,411
日本空調サービス	8.9	7.6	5,540
オリエンタルランド	18.2	12.4	198,214
ダスキン	4	3	8,808
ラウンドワン	5.2	3.8	3,522
リゾートトラスト	6.5	5	6,925
ビー・エム・エル	2.5	2	6,000
りらいあコミュニケーションズ	6.4	8.2	10,028
リソー教育	16.5	4.2	1,285
早稲田アカデミー	6.1	2.6	2,592
ユー・エス・エス	19	13.8	26,385

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サイバーエージェント	8.9	7.2	38,880
楽天	72.1	54.7	56,341
テー・オー・ダブリュー	6.7	11.2	4,009
エン・ジャパン	2	1.5	4,500
テクノプロ・ホールディングス	3	2.4	15,840
インターワークス	4	4	1,596
ジャパンマテリアル	—	3.2	5,507
キャリアリンク	9.1	0.1	55
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.9	2.7	4,374
リクルートホールディングス	110.3	84.2	324,085
エラン	2.6	1.3	2,286
日本郵政	126.2	96.2	75,998
MS－J a p a n	3	0.9	840
リログループ	8.3	6.6	15,793
エイチ・アイ・エス	2.7	2.8	5,728
共立メンテナンス	2.5	1.5	5,400
建設技術研究所	3.9	5.7	9,906
よみうりランド	1.2	0.9	3,469
東京都競馬	2.3	1.4	5,005
カナモト	2.5	2.9	6,835
東京ドーム	7.9	6.4	5,772
トランス・コスモス	3.8	1.4	3,455
乃村工藝社	3.7	5.5	5,395
日本管財	2.2	3.5	6,412
白洋舎	1.6	1.4	4,130
セコム	16.4	12.4	114,762
セントラル警備保障	1.6	0.8	3,696
メイテック	2	1.4	7,294
応用地質	5.6	5.1	7,002
船井総研ホールディングス	3.2	2.5	6,292
ベネッセホールディングス	5.5	4.2	12,217
イオンディライト	2	2.5	7,750
ニチイ学館	7	4.7	7,520
ダイセキ	2.7	1.8	4,996
ステップ	3.2	3	4,350
合 計	株 数 ・ 金 額	18,768	14,400
	銘柄数＜比率＞	1,085	1,080
			<91.4%>

(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 2,536		百万円 —

＜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(13,273,313千口)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B B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	14,128,000	15,106,960	87.4	—	56.4	21.7	9.3
地方債証券	970,000	981,999	5.7	—	3.4	1.8	0.6
	(970,000)	(981,999)	(5.7)	(—)	(3.4)	(1.8)	(0.6)
特殊債券 (除く金融債)	200,000	202,305	1.2	—	0.6	—	0.6
	(200,000)	(202,305)	(1.2)	(—)	(0.6)	(—)	(0.6)
普通社債券 (含む投資法人債券)	799,676	863,740	5.0	—	3.8	1.2	—
	(799,676)	(863,740)	(5.0)	(—)	(3.8)	(1.2)	(—)
合 計	16,097,676 (1,969,676)	17,155,006 (2,048,045)	99.3 (11.9)	— (—)	64.2 (7.8)	24.6 (2.9)	10.5 (1.2)

(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			償還年月日
		額面金額	評価額	期末	
国債証券	%	千円	千円		
第400回利付国債(2年)	0.1	110,000	110,273	2021/5/1	
第403回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,969	2021/8/1	
第406回利付国債(2年)	0.1	120,000	120,480	2021/11/1	
第411回利付国債(2年)	0.1	10,000	10,050	2022/4/1	
第129回利付国債(5年)	0.1	170,000	170,603	2021/9/20	
第130回利付国債(5年)	0.1	270,000	271,139	2021/12/20	
第131回利付国債(5年)	0.1	400,000	401,956	2022/3/20	
第132回利付国債(5年)	0.1	370,000	372,101	2022/6/20	
第133回利付国債(5年)	0.1	440,000	442,807	2022/9/20	
第134回利付国債(5年)	0.1	120,000	120,848	2022/12/20	
第135回利付国債(5年)	0.1	350,000	352,765	2023/3/20	
第136回利付国債(5年)	0.1	380,000	383,271	2023/6/20	
第137回利付国債(5年)	0.1	250,000	252,247	2023/9/20	
第138回利付国債(5年)	0.1	330,000	333,131	2023/12/20	
第139回利付国債(5年)	0.1	210,000	212,091	2024/3/20	
第140回利付国債(5年)	0.1	255,000	257,654	2024/6/20	
第141回利付国債(5年)	0.1	320,000	323,401	2024/9/20	
第142回利付国債(5年)	0.1	140,000	141,541	2024/12/20	
第5回利付国債(40年)	2.0	34,000	49,211	2052/3/20	
第7回利付国債(40年)	1.7	45,000	61,960	2054/3/20	
第8回利付国債(40年)	1.4	13,000	16,767	2055/3/20	
第9回利付国債(40年)	0.4	86,000	83,387	2056/3/20	
第10回利付国債(40年)	0.9	57,000	64,691	2057/3/20	
第11回利付国債(40年)	0.8	73,000	80,475	2058/3/20	
第12回利付国債(40年)	0.5	90,000	89,853	2059/3/20	
第320回利付国債(10年)	1.0	50,000	50,919	2021/12/20	
第324回利付国債(10年)	0.8	50,000	51,008	2022/6/20	
第327回利付国債(10年)	0.8	55,000	56,372	2022/12/20	
第330回利付国債(10年)	0.8	33,000	34,066	2023/9/20	
第335回利付国債(10年)	0.5	100,000	102,821	2024/9/20	
第339回利付国債(10年)	0.4	40,000	41,100	2025/6/20	
第340回利付国債(10年)	0.4	80,000	82,312	2025/9/20	
第341回利付国債(10年)	0.3	105,000	107,589	2025/12/20	
第342回利付国債(10年)	0.1	290,000	293,987	2026/3/20	
第343回利付国債(10年)	0.1	110,000	111,578	2026/6/20	
第344回利付国債(10年)	0.1	150,000	152,244	2026/9/20	
第345回利付国債(10年)	0.1	280,000	284,261	2026/12/20	
第346回利付国債(10年)	0.1	250,000	253,860	2027/3/20	
第347回利付国債(10年)	0.1	180,000	182,818	2027/6/20	
第348回利付国債(10年)	0.1	205,000	208,249	2027/9/20	
第349回利付国債(10年)	0.1	160,000	162,561	2027/12/20	
第350回利付国債(10年)	0.1	150,000	152,359	2028/3/20	
第351回利付国債(10年)	0.1	90,000	91,387	2028/6/20	
第352回利付国債(10年)	0.1	150,000	152,259	2028/9/20	
第353回利付国債(10年)	0.1	190,000	192,698	2028/12/20	
第354回利付国債(10年)	0.1	90,000	91,194	2029/3/20	
第355回利付国債(10年)	0.1	200,000	202,546	2029/6/20	
第356回利付国債(10年)	0.1	190,000	192,215	2029/9/20	
第357回利付国債(10年)	0.1	105,000	106,156	2029/12/20	
第3回利付国債(30年)	2.3	20,000	24,576	2030/5/20	
第5回利付国債(30年)	2.2	10,000	12,353	2031/5/20	
第22回利付国債(30年)	2.5	10,000	13,493	2036/3/20	
第28回利付国債(30年)	2.5	20,000	27,625	2038/3/20	
第29回利付国債(30年)	2.4	60,000	82,228	2038/9/20	
第31回利付国債(30年)	2.2	87,000	117,496	2039/9/20	

銘柄	利率	当期			償還年月日
		額面金額	評価額	期末	
国債証券	%	千円	千円		
第32回利付国債(30年)	2.3	65,000	89,557	2040/3/20	
第33回利付国債(30年)	2.0	38,000	50,416	2040/9/20	
第34回利付国債(30年)	2.2	60,000	82,327	2041/3/20	
第35回利付国債(30年)	2.0	20,000	26,757	2041/9/20	
第36回利付国債(30年)	2.0	87,000	116,794	2042/3/20	
第37回利付国債(30年)	1.9	100,000	132,627	2042/9/20	
第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	26,180	2043/3/20	
第39回利付国債(30年)	1.9	24,000	32,005	2043/6/20	
第40回利付国債(30年)	1.8	25,000	32,848	2043/9/20	
第42回利付国債(30年)	1.7	171,000	221,489	2044/3/20	
第45回利付国債(30年)	1.5	18,000	22,554	2044/12/20	
第46回利付国債(30年)	1.5	93,000	116,613	2045/3/20	
第47回利付国債(30年)	1.6	20,000	25,583	2045/6/20	
第48回利付国債(30年)	1.4	110,000	135,594	2045/9/20	
第49回利付国債(30年)	1.4	30,000	36,999	2045/12/20	
第50回利付国債(30年)	0.8	30,000	32,654	2046/3/20	
第51回利付国債(30年)	0.3	54,000	52,171	2046/6/20	
第52回利付国債(30年)	0.5	117,000	118,654	2046/9/20	
第54回利付国債(30年)	0.8	20,000	21,778	2047/3/20	
第55回利付国債(30年)	0.8	55,000	59,859	2047/6/20	
第56回利付国債(30年)	0.8	35,000	38,118	2047/9/20	
第57回利付国債(30年)	0.8	52,000	56,601	2047/12/20	
第58回利付国債(30年)	0.8	80,000	87,135	2048/3/20	
第59回利付国債(30年)	0.7	40,000	42,544	2048/6/20	
第60回利付国債(30年)	0.9	5,000	5,579	2048/9/20	
第62回利付国債(30年)	0.5	104,000	104,924	2049/3/20	
第63回利付国債(30年)	0.4	26,000	25,501	2049/6/20	
第64回利付国債(30年)	0.4	110,000	107,738	2049/9/20	
第65回利付国債(30年)	0.4	57,000	55,818	2049/12/20	
第66回利付国債(30年)	0.4	13,000	12,728	2050/3/20	
第68回利付国債(20年)	1.9	60,000	61,014	2021/3/22	
第51回利付国債(20年)	2.0	90,000	92,084	2021/6/21	
第53回利付国債(20年)	2.1	20,000	20,710	2021/12/20	
第60回利付国債(20年)	1.4	20,000	20,810	2022/12/20	
第66回利付国債(20年)	1.8	60,000	64,212	2023/12/20	
第67回利付国債(20年)	1.9	30,000	32,361	2024/3/20	
第70回利付国債(20年)	2.4	40,000	44,166	2024/6/20	
第71回利付国債(20年)	2.2	60,000	65,760	2024/6/20	
第74回利付国債(20年)	2.1	40,000	44,113	2024/12/20	
第75回利付国債(20年)	2.1	30,000	33,244	2025/3/20	
第76回利付国債(20年)	1.9	10,000	10,984	2025/3/20	
第80回利付国債(20年)	2.1	40,000	44,554	2025/6/20	
第82回利付国債(20年)	2.1	30,000	33,587	2025/9/20	
第84回利付国債(20年)	2.0	80,000	89,570	2025/12/20	
第85回利付国債(20年)	2.1	20,000	22,616	2026/3/20	
第90回利付国債(20年)	2.2	65,000	74,638	2026/9/20	
第99回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,361	2027/12/20	
第100回利付国債(20年)	2.2	70,000	82,637	2028/3/20	
第105回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,638	2028/9/20	
第113回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,966	2029/9/20	
第116回利付国債(20年)	2.2	50,000	60,818	2030/3/20	
第117回利付国債(20年)	2.1	92,000	111,003	2030/3/20	
第123回利付国債(20年)	2.1	155,000	188,779	2030/12/20	
第124回利付国債(20年)	2.0	40,000	48,296	2030/12/20	
第126回利付国債(20年)	2.0	9,000	10,898	2031/3/20	

銘柄		当 期 末			
		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第127回利付国債 (20年)		1.9	50,000	60,008	2031/3/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	55,000	65,752	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	45,000	53,412	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	95,000	113,848	2031/12/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	60,000	71,370	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	77,000	90,690	2032/3/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	135,000	159,320	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	25,000	29,865	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)		1.7	110,000	131,670	2032/12/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	90,000	105,666	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	90,000	108,145	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	90,000	108,348	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	74,000	88,261	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	95,000	112,197	2034/3/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	126,000	147,447	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	68,000	77,731	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	85,000	97,224	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	60,000	69,598	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	130,000	148,981	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	16,000	17,864	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	146,000	149,442	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	100,000	99,151	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	111,000	115,257	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	80,000	84,318	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	90,000	96,299	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	118,000	124,249	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	120,000	126,339	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	13,000	13,684	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	80,000	82,774	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	90,000	93,083	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	90,000	96,165	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	34,000	35,102	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	68,000	68,964	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	18,000	17,919	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	50,000	49,772	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	29,000	28,866	2039/12/20

銘柄		当 期 末			
		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第172回利付国債 (20年)		0.4	12,000	12,156	2040/3/20
小	計		14,128,000	15,106,960	
地方債証券					
第781回東京都公募公債		0.16	100,000	100,439	2028/6/20
平成30年度第11回北海道公募公債 (5年)		0.03	100,000	99,966	2023/9/28
第26回神奈川県公募公債 (20年)		1.477	20,000	23,160	2034/6/20
平成28年度第2回京都府公募公債 (15年)		0.21	50,000	50,000	2031/4/22
平成31年度第1回愛知県公募公債 (10年)		0.09	100,000	99,779	2029/4/26
平成29年度第7回広島県公募公債		0.2	100,000	100,854	2028/3/23
平成25年度第8回埼玉県公募公債		0.703	100,000	102,478	2023/12/25
平成27年度第3回福岡県公募公債		0.529	200,000	204,956	2025/8/25
平成22年度第3回横浜市公募公債		1.168	100,000	100,357	2020/9/18
平成29年度第1回広島市公募公債 (5年)		0.01	100,000	100,010	2022/6/24
小	計		970,000	981,999	
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	101,467	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	100,838	2028/5/31
小	計		200,000	202,305	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.02	100,000	99,959	2024/6/20
第33回道路債券		2.91	100,000	135,127	2034/6/20
第101回都市再生債券		0.935	100,000	107,289	2029/11/20
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.47	39,165	41,447	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.41	43,219	45,726	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	40,990	43,353	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.44	42,090	44,570	2047/4/10
第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券		1.69	34,212	34,735	2039/2/10
第16回成田国際空港株式会社社債		0.57	100,000	102,360	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	109,433	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	99,739	2028/6/6
小	計		799,676	863,740	
合	計		16,097,676	17,155,006	

(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(7,615,312千口)の内容です。

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	15	28	105	11,432	保険
AT&T INC	182	328	1,047	113,003	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	44	83	755	81,551	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	38	83	754	81,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	1	3	62	6,771	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	19	38	271	29,275	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	1	2	20	2,239	資本財
ADOBE INC	12	22	859	92,758	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	2	4	63	6,805	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	24	52	277	29,909	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8	16	138	14,992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5	9	224	24,236	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	5	9	96	10,465	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	3	5	41	4,445	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5	12	134	14,547	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	111	11,992	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	0.53	0.84	44	4,800	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1	4	25	2,709	ソフトウェア・サービス
ALLSTATE CORP	8	12	121	13,120	保険
ALPHABET INC-CL C	7	14	2,038	220,033	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	7	13	1,981	213,820	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	47	84	328	35,471	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	10	19	4,685	505,691	小売
AMEREN CORPORATION	6	12	85	9,237	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	11	19	160	17,279	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	18	31	314	33,921	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	6	44	4,758	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23	34	109	11,847	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5	9	115	12,501	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	5	8	83	8,994	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4	6	90	9,799	各種金融
AMETEK INC	6	8	82	8,895	資本財
AMGEN INC	16	28	637	68,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	7	13	126	13,598	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	13	—	—	—	エネルギー
ANALOG DEVICES	9	18	217	23,428	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	2	4	125	13,572	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	6	11	335	36,239	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	13	23	29	3,130	エネルギー
APPLE INC	119	203	6,488	700,237	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	25	42	240	25,923	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	9	20	56	6,141	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13	20	79	8,623	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	1	3	81	8,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	2	4	48	5,203	保険

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ATMOS ENERGY CORP	3	8	79	8,584	公益事業
AUTODESK INC	6	11	228	24,647	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	3	4	31	3,401	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10	19	282	30,476	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	0.67	1	132	14,325	小売
AVERY DENNISON CORP	3	5	61	6,658	素材
BB&T CORPORATION	18	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	14	44	73	7,956	エネルギー
BALL CORP	9	16	112	12,126	素材
BANK OF AMERICA CORP	235	385	1,000	107,944	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	25	35	137	14,785	各種金融
BAXTER INTL INC	12	23	204	22,034	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	6	13	305	33,017	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	5	8	49	5,388	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	32	58	1,095	118,264	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	7	11	87	9,464	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5	10	112	12,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	5	9	273	29,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	2	5	292	31,607	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	32	182	19,687	各種金融
H&R BLOCK INC	8	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	13	25	382	41,276	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	1	1	314	33,915	小売
BORGWARNER INC	7	11	36	3,890	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36	67	251	27,163	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	41	110	666	71,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3	7	83	8,979	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	10	19	549	59,342	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8	14	97	10,512	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B	10	—	—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3	7	74	8,021	各種金融
CBRE GROUP INC - A	10	20	92	10,008	不動産
CDK GLOBAL INC	4	7	32	3,470	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	4	7	87	9,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	—	15	45	4,867	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4	7	56	6,133	運輸
CIGNA CORP	10	18	359	38,746	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	8	17	300	32,444	各種金融
CMS ENERGY CORP	9	14	81	8,824	公益事業
CSX CORP	19	31	233	25,202	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	33	59	389	42,019	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	11	20	42	4,598	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	—	15	128	13,884	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	6	11	53	5,808	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13	21	153	16,591	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	9	15	81	8,822	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	5	10	94	10,224	小売
CARNIVAL CORP	10	35	61	6,621	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	—	44	89	9,703	資本財
CATERPILLAR INC	15	24	302	32,698	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	4	6	64	7,007	素材

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	
CELGENE CORP	18	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	11	29	194	20,948	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	14	31	55	6,020	公益事業
CERNER CORP	8	12	88	9,546	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4	7	388	41,879	メディア・娯楽
CHEVRONTEXACO CORP	47	85	806	87,068	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	0.68	1	145	15,705	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	7	12	88	9,545	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	3	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4	9	57	6,248	保険
CISCO SYSTEMS INC	113	189	869	93,833	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	2	3	92	9,991	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	63	97	511	55,186	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14	27	70	7,592	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	4	6	90	9,720	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	3	6	123	13,317	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY	99	182	850	91,809	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	6	10	64	6,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	14	23	128	13,900	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	20	35	250	27,059	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	116	206	826	89,145	メディア・娯楽
COMERICA INC	5	12	47	5,178	銀行
CONAGRA BRANDS INC	14	23	78	8,441	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	5	12	66	7,223	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	27	47	212	22,918	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	7	14	103	11,210	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4	7	140	15,138	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	1	3	95	10,288	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	6	10	94	10,165	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	7	80	8,679	ソフトウェア・サービス
CORNING INC	20	32	74	8,084	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	36	92	10,031	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	10	19	609	65,785	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	1	1	117	12,697	商業・専門サービス
CUMMINS INC	3	5	88	9,557	資本財
DR HORTON INC	10	17	103	11,212	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	3	9	97	10,528	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	7	22	40	4,350	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	15	29	479	51,724	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	3	8	70	7,587	消費者サービス
DAVITA INC	5	6	48	5,190	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	8	13	207	22,426	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	7	15	73	7,958	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	15	23	29	3,164	エネルギー
DEXCOM INC	—	5	189	20,453	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO	46	83	1,012	109,239	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9	20	100	10,818	各種金融
DISCOVERY INC-A	7	14	31	3,432	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	10	22	46	5,011	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION	—	17	54	5,909	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD	1	3	63	6,881	保険
Dollar General Corp	6	12	233	25,152	小売

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
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
DOLLAR TREE INC	6	11	102	11,033	小売	
DOMINION ENERGY INC	18	37	304	32,892	公益事業	
DOMINO'S PIZZA INC	1	2	80	8,677	消費者サービス	
DOVER CORP	4	8	84	9,101	資本財	
DOW INC	19	35	142	15,423	素材	
DOWDUPONT INC	58	—	—	—	素材	
DUKE ENERGY CORP	17	31	267	28,894	公益事業	
DUPONT DE NEMOURS INC	—	39	194	20,977	素材	
EOG RESOURCES INC	14	25	133	14,425	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORP	8	16	78	8,418	各種金融	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	—	3	56	6,124	保険	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4	13	72	7,810	消費者サービス	
EAST WEST BANCORP INC	—	8	31	3,368	銀行	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4	6	48	5,201	素材	
EBAY INC	23	32	143	15,447	小売	
ECOLAB INC	5	11	239	25,800	素材	
BUNGE LIMITED	5	11	44	4,825	食品・飲料・タバコ	
EDISON INTERNATIONAL	8	17	100	10,792	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	5	10	223	24,095	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	8	14	174	18,798	メディア・娯楽	
EMERSON ELECTRIC CO	14	23	145	15,756	資本財	
ENTERGY CORP	5	9	94	10,241	公益事業	
EQUIFAX INC	3	6	94	10,210	商業・専門サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	31	63	6,874	各種金融	
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	16	67	7,256	公益事業	
EVERGY INC	6	14	89	9,705	公益事業	
EVERSOURCE ENERGY	6	15	123	13,284	公益事業	
EXELON CORP	22	41	155	16,824	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	3	9	74	8,023	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5	9	68	7,418	運輸	
EXXON MOBIL CORPORATION	105	189	874	94,345	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	5	9	44	4,749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FACEBOOK INC-A	60	111	2,560	276,294	メディア・娯楽	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	2	78	8,503	各種金融	
FASTENAL CO	15	21	86	9,353	資本財	
FEDEX CORP	6	11	147	15,948	運輸	
F5 NETWORKS INC	2	4	69	7,446	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	7	29	412	44,509	ソフトウェア・サービス	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9	12	41	4,442	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	20	42	89	9,674	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4	8	95	10,277	銀行	
FISERV INC	10	28	304	32,868	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	12	26	108	11,712	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2	4	104	11,248	ソフトウェア・サービス	
FLUOR CORP	6	—	—	—	資本財	
FLOWERVE CORP	5	8	24	2,659	資本財	
FORD MOTOR CO	98	205	123	13,346	自動車・自動車部品	
FORTINET INC	4	8	116	12,610	ソフトウェア・サービス	
FORTIVE CORP	7	14	94	10,209	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5	7	49	5,336	資本財	
FOX CORP-CLASS A	11	23	70	7,631	メディア・娯楽	
FOX CORP-CLASS B	6	15	44	4,762	メディア・娯楽	

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FRANKLIN RESOURCES INC	10	13	26	2,869	各種金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5	9	85	9,183	保険
GARTNER INC	2	6	75	8,195	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	6	10	154	16,707	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	225	403	294	31,748	資本財
GENERAL MILS INC	15	26	163	17,630	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	33	55	154	16,644	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	4	8	77	8,384	小売
GILEAD SCIENCES INC	32	61	459	49,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	4	15	270	29,196	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	6	49	5,350	保険
GODADDY INC - CLASS A	5	11	85	9,214	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8	14	294	31,812	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11	—	—	—	自動車・自動車部品
WW GRAINGER INC	1	2	72	7,870	資本財
HCA HEALTHCARE INC	7	13	150	16,228	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	12	41	4,503	資本財
HP INC	40	65	112	12,122	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	21	42	51	5,546	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	7	11	29	3,175	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	2	—	—	—	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10	18	70	7,645	保険
HASBRO INC	3	7	56	6,095	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE	3	—	—	—	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2	4	85	9,211	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE	—	7	97	10,539	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	7	16	82	8,885	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	37	71	69	7,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	7	12	100	10,857	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	6	9	29	3,232	エネルギー
HOME DEPOT INC	28	49	1,228	132,567	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	18	31	461	49,759	資本財
HORMEL FOODS CORP	10	14	66	7,201	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	3	6	247	26,763	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3	5	65	7,016	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	34	71	68	7,392	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	2	49	5,377	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	2	4	120	12,980	メディア・娯楽
IDEX CORP	—	4	77	8,333	資本財
IDEX LABORATORIES INC	2	4	133	14,419	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	7	13	233	25,182	資本財
ILLUMINA INC	3	7	269	29,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	5	11	109	11,850	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	20	61	6,662	資本財
INGREDION INC	2	5	43	4,679	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	114	200	1,271	137,208	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	13	26	244	26,337	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	22	38	485	52,418	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	5	80	8,688	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	10	19	68	7,414	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	14	30	55	6,028	メディア・娯楽
INTUIT INC	6	12	340	36,781	ソフトウェア・サービス

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			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	
INTUITIVE SURGICAL INC	2	5	325	35,104	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	4	9	133	14,434	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	83	141	1,433	154,744	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4	7	63	6,880	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	12	19	30	3,330	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	67	120	1,745	188,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	—	19	46	5,030	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	4	7	136	14,705	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO	7	12	78	8,478	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	31	61	77	8,415	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	5	8	90	9,782	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	8	15	213	22,990	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	51	91	145	15,747	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6	9	36	3,977	運輸
KOHL'S CORP	5	11	26	2,824	小売
KONTOOR BRANDS INC	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KRAFT HEINZ CO/THE	15	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	19	35	117	12,707	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	11	19	55	5,939	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	2	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	10	193	20,885	資本財
LAM RESEARCH CORP	4	7	194	20,947	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	10	16	85	9,184	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5	10	201	21,787	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	—	3	34	3,694	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	5	9	31	3,405	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	4	7	76	8,261	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	8	17	112	12,161	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	1	42	4,590	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	3	6	90	9,788	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6	13	50	5,460	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	23	41	601	64,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	7	12	51	5,595	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	6	11	456	49,285	資本財
LOEWS CORP	8	14	50	5,479	保険
LOWE'S COMPANIES	20	36	461	49,761	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	2	5	164	17,711	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	3	4	55	5,958	銀行
MSCI INC	2	4	145	15,748	各種金融
MANPOWERGROUP	2	2	20	2,210	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	28	43	26	2,853	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	18	32	120	12,964	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	11	23	244	26,438	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7	14	144	15,625	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	—	3	73	7,884	素材
MASCO CORP	10	14	69	7,497	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	23	41	1,237	133,545	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7	13	79	8,611	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3	6	116	12,548	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	19	34	646	69,791	消費者サービス
MCKESSON CORP	5	7	119	12,925	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	1	2	187	20,197	小売

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	
MERCK & CO. INC.	66	117	911	98,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	21	28	106	11,522	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	0.73	1	105	11,399	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	183	334	6,073	655,417	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6	13	132	14,335	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	30	53	266	28,737	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	2	3	24	2,634	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	2	4	40	4,367	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	6	10	42	4,623	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34	64	322	34,846	食品・飲料・タバコ
MONSTER BEVERAGE CORP	10	17	126	13,638	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	4	8	223	24,102	各種金融
MORGAN STANLEY	34	54	254	27,505	各種金融
MOSAIC CO/THE	12	35	46	5,020	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4	7	103	11,180	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NATIONAL OILWELL VARCO INC	12	23	30	3,331	エネルギー
NETAPP INC	7	11	51	5,606	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	11	20	869	93,801	メディア・娯楽
NEWELL BRANDS INC	14	23	34	3,700	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	19	41	243	26,296	素材
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	19	33	40	4,334	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	11	22	550	59,435	公益事業
NIKE INC -CL B	31	56	561	60,647	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	13	27	64	6,988	公益事業
NOBLE ENERGY INC	16	33	33	3,665	エネルギー
NORDSTROM INC	4	10	20	2,197	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	6	11	209	22,638	運輸
NORTHERN TRUST CORP	5	9	82	8,866	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	4	7	251	27,131	資本財
NORTONLIFELOCK INC	—	34	69	7,477	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	9	18	78	8,460	素材
NVIDIA CORP	14	27	935	100,910	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	7	12	38	4,174	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2	3	155	16,761	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19	—	—	—	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	—	6	100	10,817	運輸
ONEOK INC	10	23	88	9,588	エネルギー
ORACLE CORPORATION	65	104	554	59,870	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	19	100	10,830	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11	18	210	22,738	銀行
PPG INDUSTRIES INC	5	10	103	11,167	素材
PPL CORPORATION	16	30	81	8,847	公益事業
PVH CORP	2	4	23	2,580	耐久消費財・アパレル
PACCAR INC	8	12	94	10,149	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	3	5	51	5,595	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	2	5	130	14,133	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	3	6	112	12,132	資本財
PAYCHEX INC	6	13	97	10,506	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	28	52	771	83,296	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16	29	36	3,973	銀行
PEPSICO INC	35	62	814	87,850	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	146	252	944	101,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額	期末	
			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	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	39	70	520	56,145	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	11	19	156	16,873	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	3	7	58	6,330	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4	8	81	8,762	エネルギー
POLARIS INC	2	3	31	3,423	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	5	9	122	13,189	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8	14	60	6,546	保険
PROCTER & GAMBLE CO	62	114	1,298	140,117	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	14	26	199	21,547	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10	13	88	9,541	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11	20	104	11,230	公益事業
PULTE HOMES INC	9	15	57	6,171	耐久消費財・アパレル
QUALCOMM INC	30	52	417	45,086	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	4	7	89	9,626	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC-A	15	—	—	—	小売
RALPH LAUREN CORP	1	3	25	2,784	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	7	53	5,733	各種金融
RAYTHEON COMPANY	7	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	69	462	49,860	資本財
RED HAT INC	4	—	—	—	ソフトウェア・サービス
Regeneron Pharmaceuticals Inc	2	4	226	24,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	33	54	64	7,007	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	3	30	3,238	保険
REPUBLIC SERVICES INC	5	7	65	7,095	商業・専門サービス
RESMED INC	4	8	124	13,469	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	4	5	28	3,095	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	3	4	106	11,498	資本財
ROLLINS INC	5	10	40	4,320	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	2	5	193	20,870	資本財
ROSS STORES INC	9	17	172	18,629	小売
S&P GLOBAL INC	6	11	360	38,943	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	5	7	41	4,477	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7	14	86	9,351	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	1	2	61	6,594	銀行
SALESFORCE.COM INC	19	39	700	75,624	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	33	53	102	11,046	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	31	54	202	21,883	各種金融
SEALED AIR CORP	6	12	39	4,278	素材
SEATTLE GENETICS INC	3	7	108	11,688	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	6	13	165	17,900	公益事業
SERVICENOW INC	4	9	345	37,331	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2	4	233	25,160	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5	8	104	11,304	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	—	6	31	3,423	資本財
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	3	6	73	7,937	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	—	2	38	4,204	資本財
SOUTHERN CO	24	46	257	27,771	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	5	11	39	4,300	運輸
SPLUNK INC	4	8	154	16,699	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	8	18	152	16,455	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	4	7	105	11,411	資本財
STARBUCKS CORP	31	54	429	46,348	消費者サービス

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	
STATE STREET CORP	10	16	104	11,248	各種金融
STRYKER CORP	8	16	313	33,811	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	11	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	4	8	140	15,117	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	17	30	64	6,919	各種金融
SYSCO CORP	11	24	138	14,910	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8	16	64	7,007	各種金融
TJX COMPANIES INC	30	56	311	33,623	小売
T-MOBILE US INC	8	20	203	21,976	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3	6	92	10,002	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	10	16	24	2,672	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	12	23	273	29,510	小売
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	2	84	9,126	資本財
TELEFLEX INC	1	2	99	10,692	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC	3	6	533	57,626	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	24	42	500	54,039	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	8	10	33	3,641	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10	18	634	68,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	14	25	402	43,488	資本財
TIFFANY & CO	3	5	71	7,707	小売
TORCHMARK CORP	3	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4	7	88	9,499	小売
TRANSDIGM GROUP INC	1	2	124	13,485	資本財
TRANSUNION	6	10	91	9,903	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	6	10	108	11,712	保険
TRIMBLE INC	8	17	74	8,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	3	17	41	4,490	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	—	61	244	26,361	銀行
TWITTER INC	17	42	139	15,035	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	7	15	96	10,462	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	35	70	264	28,521	銀行
ULTA BEAUTY INC	1	3	91	9,884	小売
UNION PACIFIC CORP	18	31	542	58,533	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	17	31	312	33,693	運輸
UNITED RENTALS INC	2	4	68	7,413	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	20	—	—	—	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	24	43	1,318	142,244	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2	4	51	5,577	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	8	10	16	1,833	保険
VF CORP	8	14	88	9,542	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	1	2	50	5,449	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	11	19	135	14,602	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3	5	66	7,212	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3	7	135	14,648	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	3	6	126	13,664	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	103	185	1,023	110,504	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	3	7	119	12,877	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6	12	354	38,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	12	—	—	—	メディア・娯楽

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	
VIACOMCBS INC-CLASS B		—	39	86	9,323	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES		44	77	1,500	161,895	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A		2	5	72	7,852	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC		5	11	52	5,612	各種金融
VULCAN MATERIALS CO		3	7	78	8,435	素材
WABCO HOLDINGS INC		1	3	43	4,683	資本財
WEC ENERGY GROUP INC		7	15	129	13,970	公益事業
WABTEC CORP/DE		5	10	70	7,579	資本財
WALMART INC		35	63	782	84,410	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		20	31	135	14,621	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC		5	12	114	12,324	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC		9	18	187	20,272	商業・専門サービス
WATERS CORP		2	4	80	8,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WELLS FARGO & COMPANY		112	179	501	54,119	銀行
WESTERN DIGITAL CORP		9	17	81	8,833	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO		16	24	49	5,373	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO		9	14	41	4,468	素材
WHIRLPOOL CORP		2	3	43	4,726	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC		31	60	124	13,460	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A		3	9	153	16,603	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A		8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC		12	24	150	16,281	公益事業
XILINX INC		6	13	118	12,782	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP		9	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC		5	11	77	8,360	資本財
XEROX HOLDINGS CORP		—	10	19	2,051	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC		7	12	116	12,523	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A		—	3	78	8,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		5	10	135	14,584	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC		12	23	319	34,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INVESCO LTD		15	23	19	2,150	各種金融
CHUBB LTD		10	19	240	25,944	保険
LyondellBasell Industries NV		8	13	88	9,574	素材
GARMIN LTD		3	8	74	8,046	耐久消費財・アパレル
ACCENTURE PLC-CL A		15	27	557	60,133	ソフトウェア・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV		8	14	153	16,605	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY		8	12	64	6,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AON PLC		5	—	—	—	保険
TE CONNECTIVITY LTD		8	14	119	12,887	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND PLC		6	—	—	—	資本財
APTIV PLC		7	13	107	11,620	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC		10	15	137	14,786	資本財
IHS MARKIT LTD		8	21	147	15,872	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		3	6	126	13,643	保険
TECHNIPFMC PLC		14	38	29	3,233	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		5	13	52	5,662	資本財
PERRIGO CO PLC		5	9	50	5,483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC		—	91	90	9,728	素材
CAPRI HOLDINGS LTD		5	14	25	2,698	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC		—	10	93	10,118	資本財
AON PLC		—	10	208	22,525	保険
PENTAIR PLC		6	9	36	3,979	資本財

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	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル 千円	
MEDTRONIC PLC		33	61	589 63,633	ヘルスケア機器・サービス
MYLAN NV		16	27	46 5,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NIELSEN HOLDINGS PLC		13	—	—	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		23	29	92 9,988	資本財
ALLERGAN PLC		8	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		7	15	60 6,506	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC		13	25	488 52,669	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		6	8	26 2,882	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	7,330	13,304	118,279	12,764,722
		482	489	—	<66.9%>
(カナダ)				千カナダドル	
AGNICO EAGLE MINES LTD		8	15	137 10,766	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		11	39	165 12,972	食品・生活必需品小売り
BCE INC		6	13	73 5,802	電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		14	26	190 14,970	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		28	50	293 23,037	銀行
BARRICK GOLD CORP		39	90	298 23,422	素材
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		22	68	304 23,934	各種金融
CAE INC		10	18	39 3,103	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B		6	10	48 3,791	素材
CGI INC		7	10	89 7,023	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP		16	35	52 4,115	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		9	18	167 13,179	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		17	30	356 27,965	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES		30	58	149 11,777	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		3	6	220 17,303	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		2	4	49 3,862	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		6	11	36 2,901	公益事業
CENOVUS ENERGY INC		37	74	45 3,597	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		0.58	1	154 12,123	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC		11	16	73 5,790	小売
ENCANA CORP		50	—	—	エネルギー
ENBRIDGE INC		50	95	420 33,003	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		—	1	67 5,329	保険
FIRST CAPITAL REALTY INC		11	—	—	不動産
FORTIS INC		13	26	137 10,816	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP		4	9	189 14,902	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC		7	13	26 2,107	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC		11	25	56 4,462	保険
HUSKY ENERGY INC		19	68	29 2,331	エネルギー
HYDRO ONE LTD		14	26	67 5,286	公益事業
IGM FINANCIAL INC		6	11	36 2,880	各種金融
IMPERIAL OIL LTD		10	17	39 3,096	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP		4	8	102 8,071	保険
INTER PIPELINE LTD		14	38	48 3,827	エネルギー
KEYERA CORP		8	22	49 3,859	エネルギー
LOBLAW COMPANIES LTD		6	12	84 6,609	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC		9	14	84 6,623	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP		51	71	126 9,938	保険
METRO INC		8	17	98 7,715	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA		10	21	131 10,349	銀行
NUTRIEN LTD		15	30	143 11,241	素材

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
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
OPEN TEXT CORP		9	18	101	7,978	ソフトウェア・サービス
OVINTIV INC		—	14	17	1,342	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		13	35	125	9,886	エネルギー
POWER CORP OF CANADA		12	38	88	6,954	保険
POWER FINANCIAL CORP		11	—	—	—	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		10	20	18	1,462	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		7	16	128	10,120	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B		10	19	109	8,589	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		34	61	570	44,826	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC		9	—	—	—	資本財
SAPUTO INC		8	14	49	3,855	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		17	35	82	6,484	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A		—	5	527	41,429	ソフトウェア・サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC		14	21	104	8,174	保険
SUNCOR ENERGY INC		42	71	173	13,627	エネルギー
TC ENERGY CORP		23	44	273	21,456	エネルギー
TELUS CORP		3	16	37	2,936	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		6	10	95	7,478	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK		43	77	484	38,021	銀行
VERMILION ENERGY INC		7	—	—	—	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD		3	4	47	3,763	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		15	24	143	11,273	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	925	1,684	8,066	633,561	
	銘 柄 数 < 比 率 >	60	58	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		4	8	190	22,708	耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG		10	17	75	9,018	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		6	8	33	4,009	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF		3	6	21	2,615	素材
HANNOVER RUECK SE		2	3	58	6,993	保険
GEA GROUP AG		6	11	29	3,566	資本財
CONTINENTAL AG		3	6	55	6,651	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG		23	40	116	13,839	運輸
AXEL SPRINGER SE		3	—	—	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA		4	6	69	8,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG		14	28	82	9,796	公益事業
SAP SE		24	43	487	58,040	ソフトウェア・サービス
E.ON SE		50	100	100	11,980	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		3	7	53	6,325	家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG		0.33	6	41	4,984	耐久消費財・アパレル
BAYER AG		24	45	282	33,562	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	5	40	4,841	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE		22	37	185	22,076	素材
BEIERSDORF AG		3	6	59	7,091	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG		—	7	36	4,300	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co		6	10	73	8,723	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE		10	17	299	35,635	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		10	25	23	2,789	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		3	6	126	15,043	保険
VOLKSWAGEN AG		1	2	45	5,382	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD		4	6	95	11,421	自動車・自動車部品
DAIMLER AG		24	43	154	18,436	自動車・自動車部品

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG		18	34	338	40,259	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG		60	123	96	11,487	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		9	13	75	8,938	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		74	140	198	23,606	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		29	63	121	14,495	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG		4	9	136	16,256	各種金融
PORSCHЕ AUTOMOBIL HOLDING SE		—	7	40	4,762	自動車・自動車部品
WIRECARD AG		3	7	62	7,434	ソフトウェア・サービス
LANXESS		3	5	27	3,285	素材
MTU AERO ENGINES AG		1	3	49	5,873	資本財
SYMRISE AG		3	8	80	9,545	素材
BRENNTAG AG		5	7	36	4,355	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		8	9	21	2,587	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		46	117	32	3,901	電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD		2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		38	84	31	3,751	銀行
VONOVIA SE		12	25	126	15,041	不動産
METRO AG		8	22	19	2,267	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE		4	—	—	—	公益事業
COVESTRO AG		6	8	28	3,436	素材
UNIPER SE		6	11	32	3,815	公益事業
DELIVERY HERO SE		4	7	63	7,552	小売
小計	株数・金額	625	1,222	4,460	530,811	
	銘柄数<比率>	47	46	—	<2.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		30	34	44	5,266	保険
INTESA SANPAOLO		418	712	109	13,045	銀行
MEDIOBANCA SPA		26	61	35	4,189	銀行
ENEL SPA		222	365	240	28,625	公益事業
ENI SPA		70	103	87	10,371	エネルギー
ATLANTIA S.P.A		16	35	53	6,315	運輸
TERNA SPA		50	94	54	6,478	公益事業
RECORDATI SPA		4	9	39	4,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONCLER SPA		6	13	44	5,265	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA		—	48	48	5,728	銀行
UNICREDIT SPA		56	126	93	11,175	銀行
POSTE ITALIANE SPA		22	54	42	5,110	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		24	52	36	4,313	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA		25	—	—	—	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	979	1,712	928	110,547	
	銘柄数<比率>	13	13	—	<0.6%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		8	12	34	4,158	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		17	29	58	6,969	公益事業
L'OREAL		5	10	273	32,579	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		6	12	473	56,366	耐久消費財・アパレル
THALES SA		3	5	40	4,852	資本財
CAPGEMINI		4	7	69	8,220	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)-B		3	6	58	6,925	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		4	8	123	14,642	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		6	15	35	4,254	自動車・自動車部品
SCHNEIDER ELECTRIC SE		12	22	196	23,377	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	
VIVENDI SA		26	37	75	8,928	メディア・娯楽
ORANGE		41	74	77	9,253	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		0.79	1	102	12,200	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		3	7	106	12,664	ソフトウェア・サービス
KERING		1	3	165	19,753	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES		8	20	21	2,539	保険
CARREFOUR SA		—	34	45	5,438	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		3	5	38	4,528	ソフトウェア・サービス
SANOFI		28	52	452	53,871	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA		7	14	35	4,252	消費者サービス
SOCIETE GENERALE-A		20	47	67	8,013	銀行
TELEPERFORMANCE		1	3	81	9,677	商業・専門サービス
SODEXO		3	6	43	5,156	消費者サービス
AXA		43	72	121	14,478	保険
PEUGEOT SA		19	28	39	4,684	自動車・自動車部品
ESSILORLUXOTTICA		6	13	157	18,779	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA		36	60	48	5,772	銀行
BNP PARIBAS		29	45	154	18,394	銀行
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		13	23	67	7,995	資本財
Wendel		1	3	33	3,943	各種金融
Iliad SA		1	—	—	—	電気通信サービス
IMERYS SA		3	—	—	—	素材
SAFRAN SA		7	15	140	16,662	資本財
ENGIE		43	73	77	9,275	公益事業
ALSTOM		6	13	52	6,246	資本財
Eutelsat Communications		8	15	15	1,811	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE		21	40	32	3,831	公益事業
Legrand SA		7	10	61	7,300	資本財
Eiffage SA		3	5	47	5,688	資本財
TOTAL SA		58	105	359	42,776	エネルギー
Aeroports de Paris		1	2	22	2,652	運輸
Natixis		38	92	20	2,383	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		2	6	42	5,060	メディア・娯楽
SCOR SE		5	10	25	3,021	保険
VINCI S. A.		11	23	197	23,450	資本財
DANONE		13	26	159	19,035	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE		9	19	230	27,422	素材
Bureau Veritas SA		10	18	35	4,195	商業・専門サービス
GETLINK SE		18	40	51	6,111	運輸
SUEZ		15	24	24	2,950	公益事業
EDENRED		7	15	62	7,457	ソフトウェア・サービス
VALEO SA		9	14	30	3,688	自動車・自動車部品
WORLDDLINE SA		1	9	61	7,280	ソフトウェア・サービス
小 計		株 数 ・ 金 額	679	1,275	5,050	600,978
銘 柄 数 < 比 率 >		52	51	—	<3.2%>	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE		14	27	166	19,801	資本財
RANDSTAD NV		4	6	24	2,885	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER		6	11	76	9,086	商業・専門サービス
Koninklijke Vopak NV		4	5	27	3,260	エネルギー
AEGON NV		65	99	25	2,996	保険
KONINKLIJKE KPN NV		122	194	41	4,988	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		外 貨 換 算 金 額
		株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV		23	39	86	10,256	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV		22	41	163	19,459	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV		6	9	82	9,782	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		4	7	53	6,387	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		5	7	82	9,832	素材
UNILEVER NV-CVA		37	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
UNILEVER NV		—	62	281	33,530	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV		10	20	585	69,702	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		28	48	107	12,771	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV		—	5	81	9,733	自動車・自動車部品
AKZO NOBEL		5	8	65	7,800	素材
PROSUS NV		—	23	173	20,624	小売
NN GROUP NV		—	19	55	6,556	保険
QIAGEN N V		8	15	61	7,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV /WI		0.24	0.71	76	9,074	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA		103	185	111	13,285	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	472	839	2,430	289,181	
	銘 柄 数 < 比 率 >	18	21	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA		10	20	44	5,240	公益事業
Bankinter SA		30	56	22	2,701	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		167	244	71	8,501	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		12	15	24	2,969	公益事業
REPSOL SA		26	86	76	9,088	エネルギー
BANCO SANTANDER S.A		416	674	144	17,249	銀行
TELEFONICA SA		105	180	75	8,940	電気通信サービス
ENAGAS SA		9	10	22	2,655	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		7	15	36	4,357	資本財
FERROVIAL SA		16	32	77	9,246	資本財
MAPFRE S.A.		55	109	18	2,176	保険
CaixaBank SA		124	219	39	4,667	銀行
IBERDROLA SA		145	262	252	30,010	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		10	18	94	11,232	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		16	16	25	3,089	公益事業
INDITEX		24	44	110	13,111	小売
AENA SME SA		1	4	56	6,688	運輸
CELLNEX TELECOM SAU		—	15	74	8,871	電気通信サービス
GRIFOLS SA		10	21	60	7,153	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	1,191	2,048	1,327	157,952	
	銘 柄 数 < 比 率 >	18	19	—	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		6	15	77	9,274	銀行
SOLVAY SA		2	3	27	3,249	素材
UCB SA		4	7	68	8,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		2	4	25	3,050	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		2	5	40	4,815	各種金融
AGEAS		6	9	30	3,638	保険
UMICORE		6	13	54	6,468	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		19	34	145	17,300	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	51	94	470	55,935	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.3%>	

銘柄		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			
(ユーロ…オーストリア)			千ユーロ	千円			
OMV AG			5	12	37	4,505	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG			10	21	44	5,277	銀行
ANDRITZ AG			3	6	21	2,559	資本財
小 計		株 数 ・ 金 額	20	40	103	12,342	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)							
TENARIS SA			20	23	13	1,620	エネルギー
SES SA			11	34	22	2,723	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA			—	93	46	5,587	不動産
ARCELORMITTAL			21	49	43	5,198	素材
小 計		株 数 ・ 金 額	53	201	127	15,130	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)							
WARTSILA			17	23	17	2,125	資本財
UPM-KYMMENE OYJ			14	18	47	5,660	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS			22	22	24	2,899	素材
SAMPO OYJ-A SHS			7	24	80	9,624	保険
FORTUM OYJ			13	21	35	4,275	公益事業
ELISA OYJ			5	8	47	5,630	電気通信サービス
NOKIA OYJ			142	262	92	11,061	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ			11	19	70	8,406	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ			4	7	15	1,884	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B			7	13	83	9,877	資本財
ORION OYJ			4	7	33	3,956	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	249	429	549	65,401	
		銘柄 数 < 比 率 >	11	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)							
CRH PLC(DUBLIN)			22	33	97	11,572	素材
KINGSPAN GROUP PLC			—	9	49	5,880	資本財
KERRY GROUP PLC-A			4	7	79	9,477	食品・飲料・タバコ
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC			2	7	86	10,236	消費者サービス
小 計		株 数 ・ 金 額	29	57	312	37,166	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL SA			94	146	60	7,239	公益事業
Galp Energia SGPS SA			17	21	23	2,784	エネルギー
JERONIMO MARTINS			11	14	20	2,490	食品・生活必需品小売り
小 計		株 数 ・ 金 額	123	182	105	12,514	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計		株 数 ・ 金 額	4,476	8,104	15,865	1,887,963	
		銘柄 数 < 比 率 >	179	183	—	<9.9%>	
(イギリス)					千英ポンド		
ASHTED GROUP PLC			16	29	72	9,532	資本財
AVIVA PLC			84	154	40	5,386	保険
DIAGEO PLC			58	100	294	38,991	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC			5	9	27	3,581	各種金融
BAE SYSTEMS PLC			76	132	66	8,829	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC			58	105	345	45,692	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC			78	151	62	8,240	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC			22	38	58	7,797	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC			492	927	367	48,694	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC			106	330	67	8,987	保険

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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
MEGGITT PLC	31	68	20	2,755	資本財
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	90	193	35	4,638	食品・生活必需品小売り
Associated British Foods PLC	11	19	36	4,876	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC	10	17	40	5,337	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	64	114	121	16,083	保険
RIO TINTO PLC	30	52	224	29,659	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	—	45	42	5,687	各種金融
SSE PLC	28	45	55	7,392	公益事業
BP PLC	499	923	295	39,053	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,851	3,005	95	12,658	銀行
TESCO PLC	243	430	98	13,013	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	22	40	65	8,714	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	124	231	381	50,521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	10	19	19	2,639	資本財
ASTRAZENECA PLC	32	61	512	67,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	203	404	48	6,411	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	6	20	24	3,235	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	60	154	15	2,022	小売
BARCLAYS PLC	463	752	90	11,939	銀行
INTERTEK GROUP PLC	4	9	50	6,743	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	13	19	28	3,837	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	4	7	38	5,082	小売
KINGFISHER PLC	84	110	21	2,856	小売
ITV PLC	150	247	20	2,662	メディア・娯楽
G4S PLC	70	196	18	2,482	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	8	12	29	3,872	保険
CENTRICA PLC	174	461	18	2,399	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	108	177	234	31,084	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	95	179	227	30,051	エネルギー
BUNZL PLC	12	18	35	4,679	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	—	126	61	8,137	商業・専門サービス
London Stock Exchange Group PLC	7	16	128	17,006	各種金融
UNILEVER PLC	26	47	198	26,279	家庭用品・パーソナル用品
EXPERIAN PLC	18	40	114	15,149	商業・専門サービス
MONDI PLC	13	21	32	4,366	素材
SEVERN TRENT PLC	10	15	36	4,884	公益事業
Whitbread PLC	5	9	24	3,283	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11	18	33	4,484	各種金融
SMITHS GROUP PLC	14	25	33	4,487	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	30	54	90	11,960	素材
3I GROUP PLC	—	56	47	6,345	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	16	34	238	31,527	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	46	82	156	20,655	商業・専門サービス
Fresnillo PLC	13	—	—	—	素材
GLENCORE PLC	311	562	88	11,663	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	44	—	—	—	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	149	336	40	5,355	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	37	57	40	5,335	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	37	80	51	6,854	メディア・娯楽
COMPASS GROUP PLC	37	69	86	11,487	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	78	143	129	17,101	公益事業
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	34	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	金額	当期(前期末)		当 期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価	額	
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円			
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	94	176	47	6,227	各種金融		
BHP GROUP PLC	57	89	140	18,600	素材		
VODAFONE GROUP PLC	679	1,193	156	20,750	電気通信サービス		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6	13	55	7,294	消費者サービス		
CRODA INTERNATIONAL PLC	4	7	38	5,103	素材		
FERGUSON PLC	6	10	65	8,707	資本財		
M&G PLC	—	144	20	2,678	各種金融		
RSA INSURANCE GROUP PLC	37	43	17	2,337	保険		
WHITBREAD PLC-NIL	—	4	5	676	消費者サービス		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	4	45	6,079	資本財		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	42	65	18	2,384	保険		
MELROSE INDUSTRIES PLC	165	327	38	5,148	資本財		
JOHNSON MATTHEY PLC	7	7	16	2,143	素材		
小 計	株 数 ・ 金 額	7,564	13,911	6,651	880,434		
	銘柄 数 < 比 率 >	69	72	—	<4.6%>		
(スイス)			千スイスフラン				
SGS SA	0.16	0.22	48	5,414	商業・専門サービス		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.1	0.24	45	5,101	食品・飲料・タバコ		
SWISSCOM AG-REG	0.75	1	76	8,523	電気通信サービス		
Lindt & Spruengli AG	0.03	0.08	62	6,928	食品・飲料・タバコ		
GIVAUDAN-REG	0.18	0.42	139	15,593	素材		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3	6	193	21,619	保険		
NOVARTIS AG-REG SHS	54	97	789	87,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ABB LTD	40	73	138	15,428	資本財		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	17	32	1,095	122,078	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	8	37	4,203	商業・専門サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD	11	19	78	8,721	素材		
CLARIANT AG-REG	9	14	25	2,789	素材		
NESTLE SA-REGISTERED	75	134	1,362	151,847	食品・飲料・タバコ		
Baloise Holding AG	1	2	40	4,463	保険		
TEMENOS GROUP AG-REG	2	4	64	7,233	ソフトウェア・サービス		
SONOVA HOLDING AG	1	3	68	7,652	ヘルスケア機器・サービス		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.4	0.8	59	6,637	ヘルスケア機器・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG	71	132	117	13,107	各種金融		
THE SWATCH GROUP AG-B	1	2	41	4,584	耐久消費財・アパレル		
LONZA GROUP AG-REG	2	3	181	20,276	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	71	7,988	保険		
SWISS PRIME SITE	—	5	52	5,835	不動産		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.56	1	85	9,570	各種金融		
Schindler Holding AG	1	1	34	3,823	資本財		
Schindler Holding AG	1	1	34	3,832	資本財		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1	3	43	4,865	運輸		
GEBERIT AG-REG	0.92	1	71	7,950	資本財		
JULIUS BAER GROUP LTD	8	16	67	7,504	各種金融		
SWISS RE AG	6	14	99	11,045	保険		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12	21	121	13,554	耐久消費財・アパレル		
SIKA AG-REG	3	6	100	11,175	素材		
ALCON INC	11	21	123	13,807	ヘルスケア機器・サービス		
UBS GROUP AG	104	164	171	19,102	各種金融		
小 計	株 数 ・ 金 額	453	800	5,744	640,238		
	銘柄 数 < 比 率 >	32	33	—	<3.4%>		

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	千スウェーデンクローナ	千円		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	40	97	789	8,898	銀行	
Swedbank AB	26	39	471	5,318	銀行	
SWEDISH MATCH AB	5	10	658	7,422	食品・飲料・タバコ	
SECURITAS AB-B SHS	13	13	168	1,902	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	8	16	783	8,833	各種金融	
HENNES & MAURITZ AB-B	19	38	553	6,238	小売	
ERICSSON LM-B SHS	72	146	1,236	13,930	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA COMPANY AB	76	157	507	5,720	電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	12	19	357	4,032	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	7	11	267	3,018	エネルギー	
ALFA LAVAL AB	10	14	283	3,197	資本財	
Millicom International Cellular SA	3	10	224	2,535	電気通信サービス	
Husqvarna AB	18	32	224	2,529	耐久消費財・アパレル	
SKF AB-B SHARES	15	15	262	2,956	資本財	
VOLVO AB-B SHS	33	46	638	7,194	資本財	
SANDVIK AB	26	39	621	7,007	資本財	
Industrivarden AB	7	15	328	3,705	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	7	15	778	8,778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELE2 AB-B SHS	17	41	502	5,663	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	9	—	—	—	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	15	23	842	9,493	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	13	24	825	9,307	資本財	
EPIROC AB-A	24	32	347	3,914	資本財	
EPIROC AB-B	18	22	243	2,747	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	14	25	770	8,687	家庭用品・パーソナル用品	
BOLIDEN AB	11	21	455	5,134	素材	
BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	11	—	—	—	素材	
KINNEVIK AB-B	—	14	334	3,775	各種金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	34	74	683	7,704	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	19	37	721	8,136	資本財	
NORDEA BANK ABP	61	127	824	9,292	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	657	1,185	15,712	177,079	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	29	—	<0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	26	—	—	—	銀行	
TELENOR ASA	21	36	539	5,927	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	22	38	578	6,353	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	6	9	326	3,587	素材	
MOWI ASA	—	25	476	5,229	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	59	131	334	3,672	素材	
ORKLA ASA	25	47	393	4,317	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10	15	279	3,070	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	6	16	375	4,125	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額	178	321	3,304	36,283	
	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	3	6	577	9,217	食品・飲料・タバコ	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.23	0.48	324	5,172	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.14	0.2	127	2,038	運輸	
DANSKE BANK A/S	22	38	329	5,255	銀行	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5	9	634	10,124	資本財	
H LUNDBECK A/S	3	9	229	3,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄		期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
DSV PANALPINA A/S		4	11	828	13,226	運輸
PANDORA A/S		4	4	149	2,388	耐久消費財・アパレル
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		3	6	415	6,633	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		6	10	380	6,065	素材
COLOPLAST-B		3	5	617	9,862	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B		44	81	3,437	54,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ORSTED A/S		5	9	694	11,077	公益事業
DEMANT A/S		4	9	171	2,732	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	111	205	8,917	142,323	
	銘 柄 数 < 比 率 >	14	14	—	<0.7%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD		70	113	203	14,529	銀行
AMCOR PLC-CDI		39	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION		84	144	254	18,200	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		—	83	109	7,854	素材
TELSTRA CORP LTD		145	207	65	4,712	電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED		26	41	36	2,622	食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE		6	13	117	8,371	各種金融
BHP GROUP LIMITED		78	128	442	31,663	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		12	—	—	—	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED		20	35	47	3,374	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED		11	22	636	45,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP		61	149	213	15,301	運輸
COCHLEAR LIMITED		1	5	94	6,749	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED		51	102	59	4,289	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		43	77	501	35,852	銀行
RIO TINTO LIMITED		11	16	149	10,678	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		77	110	66	4,749	保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		3	—	—	—	消費者サービス
ORICA LTD		17	31	56	4,039	素材
LENDLEASE GROUP		23	44	54	3,890	不動産
SUNCORP GROUP LTD		42	75	70	5,034	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		63	145	260	18,649	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		20	41	123	8,809	素材
INCITEC PIVOT LTD		86	220	45	3,246	素材
AMP LIMITED		114	279	46	3,304	各種金融
QBE INSURANCE GROUP LIMITED		42	84	72	5,156	保険
SANTOS LTD		57	97	54	3,928	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD		17	34	99	7,131	ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED		78	206	70	5,010	消費者サービス
WESFARMERS LIMITED		27	43	176	12,597	小売
ALUMINA LTD		117	292	44	3,198	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		19	58	138	9,913	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		27	54	189	13,547	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD		15	37	75	5,385	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		4	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LTD		52	91	103	7,372	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD		8	15	173	12,437	各種金融
CROWN RESORTS LIMITED		18	—	—	—	消費者サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		17	45	44	3,153	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT		45	82	50	3,590	運輸
AMPOL LTD		—	14	38	2,767	エネルギー

銘柄	株数	当期末	期末		業種等
			評価額	外貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
AGL ENERGY LTD	21	30	52	3,733	公益事業
SOUTH32 LTD	174	376	74	5,317	素材
COLES GROUP LTD	40	76	116	8,347	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,900 42	3,733 39	5,228 —	374,068 <2.0%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	22	33	44	2,944	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	17	41	79	5,296	食品・飲料・タバコ
SPARK NEW ZEALAND LTD	85	112	50	3,385	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	40	56	37	2,477	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	67	114	55	3,716	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232 5	360 5	266 —	17,819 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	18	28	201	2,806	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	64	144	213	2,966	銀行
CLP HOLDINGS LIMITED	45	80	618	8,608	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	32	55	1,500	20,885	各種金融
MTR CORPORATION	55	110	415	5,780	運輸
HANG SENG BANK	21	36	439	6,123	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	49	134	379	5,289	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	50	90	386	5,380	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	244	489	629	8,758	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	40	—	—	—	不動産
Galaxy Entertainment Group Limited	70	130	687	9,563	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	110	240	522	7,266	銀行
NWS HOLDINGS LTD	95	295	188	2,619	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45	80	95	1,327	耐久消費財・アパレル
SINO LAND CO	138	298	268	3,741	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	45	65	603	8,396	不動産
SWIRE PACIFIC LTD A	20	45	190	2,646	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	50	95	655	9,124	資本財
ATA GROUP LTD	314	546	3,521	49,022	保険
HKT Trust / HKT Ltd	160	310	360	5,014	電気通信サービス
Sands China Ltd	80	172	529	7,374	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	58	126	220	3,069	不動産
WH Group Limited	310	550	352	4,899	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	37	123	612	8,528	資本財
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	30	55	220	3,062	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	73	118	502	6,997	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,290 26	4,415 25	14,314 —	199,253 <1.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	75	165	52	3,968	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	44	70	136	10,358	銀行
CITY DEVELOPMENTS	30	63	48	3,682	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	110	215	32	2,503	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	30	141	53	4,035	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	31	49	96	7,347	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD	30	71	47	3,626	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	90	218	32	2,439	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	217	374	97	7,458	電気通信サービス

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	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		79	113	97	7,388	銀行
KEPPEL CORP LTD		56	102	61	4,681	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		290	649	50	3,853	消費者サービス
小 計		株 数 ・ 金 額	1,082	2,230	805	61,346
		銘 柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.3%>
(イスラエル)				千イスラエルシケル		
BANK HAPOLIM BM		37	86	185	5,708	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		51	102	189	5,839	銀行
ICL GROUP LTD		35	35	43	1,327	素材
NICE LTD		2	4	288	8,886	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		7	18	123	3,807	銀行
小 計		株 数 ・ 金 額	133	246	829	25,570
		銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>
合 計		株 数 ・ 金 額	27,336	50,504	—	17,840,664
		銘 柄 数 < 比 率 >	964	972	—	<93.5%>

(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	%	
AMERICAN TOWER CORP	1	2	529	57,140	0.3	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.301	0.543	86	9,311	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	0.359	0.713	63	6,833	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.347	0.66	60	6,513	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	1	2	326	35,194	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.507	1	176	19,049	0.1	
DUKE REALTY CORP	1	2	82	8,898	0.0	
EQUINIX INC	0.208	0.414	279	30,182	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	—	1	71	7,755	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	0.844	1	85	9,214	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.189	0.275	68	7,361	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.41	0.821	77	8,362	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.271	0.411	34	3,716	0.0	
HCP INC	1	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	3	79	8,613	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2	4	54	5,919	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	1	1	46	5,019	0.0	
KIMCO REALTY CORP	1	2	29	3,202	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.574	—	—	—	—	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	3	69	7,494	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	0.39	0.714	83	9,006	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	1	44	4,783	0.0	
PROLOGIS INC	1	3	313	33,788	0.2	
PUBLIC STORAGE	0.365	0.62	122	13,179	0.1	
REALTY INCOME CORP	0.747	1	82	8,888	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	0.555	0.962	44	4,759	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.324	0.569	172	18,599	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	0.346	0.445	19	2,114	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.793	1	84	9,165	0.0	
SUN COMMUNITIES INC	—	0.592	82	8,870	0.0	
UDR INC	0.883	1	73	7,919	0.0	
VENTAS INC	0.916	2	85	9,179	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	0.572	0.801	31	3,414	0.0	
WP CAREY INC	—	1	71	7,719	0.0	
WELLTOWER INC	0.971	1	99	10,774	0.1	
WEYERHAEUSER CO	2	3	78	8,481	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	24	52	3,710	400,429	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	34	—	<2.1%>	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.967	1	26	2,059	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.967	1	26	2,059	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
KLEPIERRE		0.837	1	18	2,186	0.0
GECINA SA		0.19	0.267	30	3,590	0.0
COVIVIO		0.219	0.366	20	2,428	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		0.356	0.682	35	4,205	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	2	104	12,410	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		3	5	22	2,946	0.0
SEGRO PLC		3	7	59	7,895	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		2	4	24	3,189	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	10	16	106	14,032	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		13	22	54	3,877	0.0
GPT GROUP		7	10	45	3,284	0.0
STOCKLAND		10	14	50	3,634	0.0
DEXUS		3	5	52	3,768	0.0
GOODMAN GROUP		4	9	151	10,873	0.1
SCENTRE GROUP		17	21	53	3,852	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	57	84	409	29,292	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		6	7	441	6,138	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	6	7	441	6,138	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		12	22	42	3,205	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	12	22	42	3,205	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	112	188	—	467,568	
	銘柄 数 < 比 率 >	46	50	—	<2.5%>	

(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	573	—
		DJ EU STX 50	122	—
		FTSE 100 IDX	81	—

(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(3,449,614千口)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 21,250	千米ドル 23,654	千円 2,552,809	% 45.3	% —	% 20.4	% 14.8	% 10.0
カナダ	千カナダドル 1,300	千カナダドル 1,453	114,151	2.0	—	1.0	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 8,600	千メキシコペソ 9,467	45,915	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	2,900	3,416	406,513	7.2	—	4.2	2.0	1.1
イタリア	3,600	4,165	495,648	8.8	—	5.6	2.1	1.1
フランス	3,800	4,596	547,018	9.7	—	7.0	2.5	0.2
オランダ	600	824	98,104	1.7	—	1.0	0.5	0.2
スペイン	2,300	2,792	332,262	5.9	—	4.5	1.2	0.2
ベルギー	1,000	1,244	148,118	2.6	—	2.0	0.7	—
オーストリア	600	756	90,048	1.6	—	1.2	0.4	—
フィンランド	200	228	27,156	0.5	—	0.5	—	—
アイルランド	200	238	28,339	0.5	—	0.2	0.3	—
イギリス	千英ポンド 2,040	千英ポンド 2,893	383,006	6.8	—	5.6	1.0	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 1,000	千スウェーデンクローナ 1,132	12,760	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 700	千ノルウェークローネ 753	8,277	0.1	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,100	千デンマーククローネ 1,416	22,601	0.4	—	0.3	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 800	千ポーランドズロチ 854	22,958	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 1,500	千豪ドル 1,708	122,233	2.2	—	1.5	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 200	千シンガポールドル 237	18,061	0.3	—	0.3	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 700	千マレーシアリンギット 735	18,239	0.3	—	0.1	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 500	千イスラエルシェケル 617	千円 19,046	% 0.3	% —	% 0.2	% 0.1	% 0.1
合 計	—	—	5,513,273	97.7	—	56.4	27.5	13.9

(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		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 1 1/2 01/31/27	1.5	200	213	22,992	2027/1/31
T 1 1/2 02/15/30	1.5	200	215	23,271	2030/2/15
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	103	11,171	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	103	11,184	2023/3/31
T 1 1/2 08/31/21	1.5	300	304	32,904	2021/8/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	200	205	22,228	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/21	1.5	100	101	10,976	2021/9/30
T 1 1/2 10/31/24	1.5	100	105	11,352	2024/10/31
T 1 1/2 11/30/21	1.5	200	203	22,002	2021/11/30
T 1 1/2 11/30/24	1.5	100	105	11,363	2024/11/30
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	103	11,134	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	100	103	11,218	2024/8/31
T 1 1/8 02/28/22	1.125	100	101	10,967	2022/2/28
T 1 1/8 08/31/21	1.125	300	303	32,750	2021/8/31
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	312	33,696	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	513	55,414	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	412	44,493	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	522	56,367	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	300	318	34,318	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	207	22,359	2022/9/30
T 1 3/4 11/15/29	1.75	400	440	47,501	2029/11/15
T 1 3/4 12/31/24	1.75	100	106	11,490	2024/12/31
T 1 3/4 12/31/26	1.75	200	216	23,337	2026/12/31
T 1 3/8 01/31/22	1.375	200	203	22,003	2022/1/31
T 1 3/8 01/31/25	1.375	100	104	11,313	2025/1/31
T 1 3/8 02/15/23	1.375	200	206	22,263	2023/2/15
T 1 3/8 10/15/22	1.375	100	102	11,091	2022/10/15
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	640	69,117	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	200	213	23,074	2026/5/15
T 1 5/8 06/30/21	1.625	100	101	10,958	2021/6/30
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	515	55,671	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	217	23,474	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	200	214	23,131	2026/9/30
T 1 5/8 11/30/26	1.625	100	107	11,576	2026/11/30
T 1 5/8 12/15/22	1.625	100	103	11,179	2022/12/15
T 1 5/8 12/31/21	1.625	800	817	88,258	2021/12/31
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	205	22,212	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	108	11,716	2026/7/31
T 1 7/8 11/30/21	1.875	600	615	66,396	2021/11/30
T 2 02/15/22	2.0	500	515	55,637	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	314	33,929	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	215	23,243	2025/2/15
T 2 02/15/50	2.0	100	113	12,297	2050/2/15

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	
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券					
T 2 06/30/24	2.0	100	106	11,539	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	866	93,499	2025/8/15
T 2 1/2 01/31/24	2.5	200	216	23,337	2024/1/31
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	123	13,335	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	543	58,647	2024/5/15
T 2 1/2 05/15/46	2.5	100	123	13,346	2046/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	321	34,718	2023/8/15
T 2 1/4 07/31/21	2.25	100	102	11,050	2021/7/31
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	112	12,110	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	236	25,531	2046/8/15
T 2 1/4 08/15/49	2.25	100	119	12,909	2049/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	867	93,661	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	450	48,570	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	325	35,178	2025/5/15
T 2 1/8 08/15/21	2.125	100	102	11,044	2021/8/15
T 2 11/15/21	2.0	300	307	33,228	2021/11/15
T 2 11/15/26	2.0	100	109	11,828	2026/11/15
T 2 11/30/22	2.0	400	417	45,093	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	600	699	75,451	2028/2/15
T 2 3/4 07/31/23	2.75	100	107	11,648	2023/7/31
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	651	70,296	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	254	27,507	2042/11/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	112	12,165	2027/5/15
T 2 3/8 05/15/29	2.375	100	115	12,431	2029/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	217	23,450	2024/8/15
T 2 5/8 01/31/26	2.625	100	112	12,124	2026/1/31
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	117	12,626	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	110	11,969	2025/3/31
T 2 5/8 07/15/21	2.625	100	102	11,085	2021/7/15
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	117	12,728	2028/5/15
T 2 7/8 05/15/43	2.875	100	130	14,055	2043/5/15
T 2 7/8 05/31/25	2.875	200	224	24,276	2025/5/31
T 2 7/8 07/31/25	2.875	100	112	12,173	2025/7/31
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	118	12,766	2028/8/15
T 2 7/8 10/15/21	2.875	100	103	11,189	2021/10/15
T 2 7/8 11/15/21	2.875	100	103	11,214	2021/11/15
T 3 02/15/47	3.0	300	407	44,016	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	200	272	29,443	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	400	549	59,291	2049/2/15
T 3 05/15/47	3.0	100	135	14,670	2047/5/15
T 3 08/15/48	3.0	100	136	14,784	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	135	14,587	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	139	15,064	2048/5/15

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	
(アメリカ) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	408	44,041	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	134	14,553	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	300	403	43,530	2045/11/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	146	15,763	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	100	145	15,719	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	100	148	16,039	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	155	16,822	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	165	17,840	2041/2/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	157	16,955	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	81	8,844	2037/5/15
小 計				2,552,809	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0 3/4 09/01/21	0.75	100	100	7,894	2021/9/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	103	8,164	2027/6/1
CAN 1 09/01/22	1.0	100	101	7,979	2022/9/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	103	8,140	2023/6/1
CAN 1 1/2 06/01/26	1.5	100	106	8,365	2026/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	104	8,170	2025/3/1
CAN 1 1/4 06/01/30	1.25	100	106	8,400	2030/6/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	108	8,528	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	115	9,073	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	105	8,247	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	140	11,028	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	153	12,065	2045/12/1
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	100	103	8,091	2021/6/1
小 計				114,151	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	263	1,275	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	711	3,451	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	403	1,958	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	615	2,986	2022/6/9
MBONO 6 1/2 06/10/21	6.5	1,000	1,014	4,918	2021/6/10
MBONO 6 3/4 03/09/23	6.75	100	104	504	2023/3/9
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	700	761	3,695	2027/6/3
MBONO 7 1/4 12/09/21	7.25	100	103	499	2021/12/9
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	331	1,607	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	424	2,060	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	223	1,081	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	1,300	1,433	6,950	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	1,500	1,737	8,427	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	400	462	2,244	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	300	333	1,617	2047/11/7

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	
(メキシコ) 国債証券	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
MBONO 8 12/07/23	8.0	500	543	2,634	2023/12/7
小 計				45,915	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0 03/11/22	—	200	202	24,071	2022/3/11
BKO 0 06/11/21	—	100	100	11,971	2021/6/11
DBR 0 02/15/30	—	100	104	12,398	2030/2/15
DBR 0 08/15/26	—	100	103	12,348	2026/8/15
DBR 0 08/15/29	—	100	104	12,409	2029/8/15
DBR 0 1/2 02/15/25	0.5	100	105	12,546	2025/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	105	12,573	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	106	12,680	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	200	212	25,315	2028/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	108	12,921	2025/8/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	104	12,482	2022/9/4
DBR 1 1/4 08/15/48	1.25	100	135	16,129	2048/8/15
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	105	12,498	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	162	19,383	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	166	19,868	2046/8/15
DBR 3 1/4 07/04/42	3.25	100	175	20,854	2042/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	171	20,373	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	172	20,539	2034/7/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	150	17,954	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	200	204	24,390	2024/4/5
OBL 0 04/11/25	—	100	103	12,262	2025/4/11
OBL 0 10/08/21	—	200	201	23,989	2021/10/8
OBL 0 10/13/23	—	200	204	24,324	2023/10/13
OBL 0 10/18/24	—	100	102	12,228	2024/10/18
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.35 02/01/25	0.35	100	97	11,597	2025/2/1
BTPS 0.85 01/15/27	0.85	100	97	11,622	2027/1/15
BTPS 0.95 03/01/23	0.95	100	101	12,039	2023/3/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	102	12,204	2025/6/1
BTPS 1 35 04/15/22	1.35	200	203	24,252	2022/4/15
BTPS 1.45 11/15/24	1.45	100	102	12,196	2024/11/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	200	205	24,473	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	100	11,934	2032/3/1
BTPS 2 02/01/28	2.0	100	105	12,498	2028/2/1
BTPS 2 1/4 09/01/36	2.25	100	104	12,435	2036/9/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	105	12,506	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	102	12,241	2021/12/15
BTPS 2.95 09/01/38	2.95	100	113	13,448	2038/9/1
BTPS 3 08/01/29	3.0	100	113	13,486	2029/8/1

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 3 1/2 03/01/30	3.5	100	117	14,036	2030/3/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	100	104	12,390	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	112	13,336	2024/9/1
BTPS 3.35 03/01/35	3.35	100	118	14,125	2035/3/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	127	15,180	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	113	13,543	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	111	13,258	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	113	13,451	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	100	105	12,571	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	126	15,005	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	144	17,196	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	138	16,505	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	145	17,257	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	145	17,277	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	224	26,684	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	144	17,233	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	143	17,071	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	136	16,218	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	137	16,364	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 02/25/23	—	100	101	12,065	2023/2/25
FRTR 0 03/25/24	—	100	101	12,111	2024/3/25
FRTR 0 03/25/25	—	200	203	24,247	2025/3/25
FRTR 0 1/2 05/25/26	0.5	100	105	12,509	2026/5/25
FRTR 0 11/25/29	—	200	200	23,847	2029/11/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	200	214	25,494	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	200	216	25,817	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	200	231	27,558	2031/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/50	1.5	100	119	14,227	2050/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	100	113	13,514	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	113	13,531	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	107	12,781	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	106	12,709	2023/5/25
FRTR 1 3/4 06/25/39	1.75	100	123	14,703	2039/6/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	219	26,141	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	133	15,841	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	100	124	14,870	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	320	38,102	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	245	29,177	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	160	19,053	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	100	105	12,531	2021/10/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	163	19,400	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	165	19,718	2035/4/25

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…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	116	13,858	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	300	35,704	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	169	20,133	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	134	16,023	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	179	21,341	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/22	—	100	100	12,006	2022/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	110	13,147	2024/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	179	21,366	2042/1/15
NETHER 4 01/15/37	4.0	100	166	19,848	2037/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	145	17,279	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	121	14,456	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0 01/31/25	—	100	100	11,907	2025/1/31
SPGB 0.45 10/31/22	0.45	100	101	12,115	2022/10/31
SPGB 0.6 10/31/29	0.6	100	100	11,985	2029/10/31
SPGB 0.8 07/30/27	0.8	100	103	12,271	2027/7/30
SPGB 1.3 10/31/26	1.3	100	107	12,735	2026/10/31
SPGB 1.4 07/30/28	1.4	100	108	12,862	2028/7/30
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	108	12,869	2027/10/31
SPGB 1.85 07/30/35	1.85	100	112	13,402	2035/7/30
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	110	13,181	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	200	226	26,963	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	112	13,381	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	111	13,226	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	118	14,145	2033/7/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	149	17,770	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	115	13,765	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	165	19,705	2041/7/30
SPGB 4.8 01/31/24	4.8	100	118	14,071	2024/1/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	167	19,883	2040/7/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	158	18,896	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	138	16,479	2028/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	110	13,133	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	147	17,508	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	12,349	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	12,173	2023/10/22
BGB 0.8 06/22/27	0.8	100	106	12,687	2027/6/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	107	12,786	2026/6/22
BGB 1 06/22/31	1.0	100	109	13,025	2031/6/22

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 1 6 06/22/47	1.6	100	121	14,481	2047/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	170	20,319	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	111	13,229	2022/9/28
BGB 5 03/28/35	5.0	100	167	19,896	2035/3/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	144	17,169	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	—	100	101	12,052	2022/9/20
RAGB 0 3/4 02/20/28	0.75	100	107	12,774	2028/2/20
RAGB 0 3/4 10/20/26	0.75	100	106	12,706	2026/10/20
RAGB 1 3/4 10/20/23	1.75	100	107	12,816	2023/10/20
RAGB 3 15 06/20/44	3.15	100	167	19,926	2044/6/20
RAGB 4 15 03/37	4.15	100	166	19,771	2037/3/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFGB 0 1/2 09/15/28	0.5	100	105	12,546	2028/9/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	100	122	14,610	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 1 3 05/15/33	1.3	100	111	13,243	2033/5/15
IRISH 5 4 03/13/25	5.4	100	126	15,096	2025/3/13
ユ ー ロ 計				2,173,212	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 0 7/8 10/22/29	0.875	100	106	14,139	2029/10/22
UKT 1 04/22/24	1.0	100	104	13,773	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	122	16,187	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	108	14,399	2027/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	200	208	27,543	2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	120	15,924	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	113	14,978	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	110	14,681	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	107	14,227	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	165	21,943	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	228	30,235	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	157	20,886	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	193	25,563	2052/7/22
UKT 3 3/4 09/07/21	3.75	100	104	13,865	2021/9/7
UKT 4 1/2 12/07/42	4.5	100	182	24,162	2042/12/7
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	39	5,220	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/40	4.25	100	171	22,681	2040/12/7
UKT 4 1/4 12/07/46	4.25	100	188	24,961	2046/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	198	26,229	2049/12/7
UKT 4 25 06/07/32	4.25	100	146	19,414	2032/6/7

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	
(イギリス) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 6 12/07/28	6.0	10	15	1,988	2028/12/7
小 計				383,006	
(スウェーデン) 国債証券		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	100	106	1,203	2028/5/12
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	0.75	100	107	1,208	2029/11/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	200	212	2,392	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	100	107	1,212	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	200	227	2,560	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	155	1,757	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	200	215	2,425	2022/6/1
小 計				12,760	
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	106	1,169	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	108	1,191	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	106	1,171	2025/3/13
NGB 2 04/26/28	2.0	100	111	1,221	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	200	210	2,313	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	100	110	1,210	2024/3/14
小 計				8,277	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	200	212	3,389	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	100	106	1,705	2029/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	100	106	1,705	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	223	3,571	2025/11/15
DGB 3 11/15/21	3.0	200	209	3,335	2021/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	300	557	8,893	2039/11/15
小 計				22,601	
(ポーランド) 国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLGB 1 3/4 07/25/21	1.75	200	203	5,453	2021/7/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	100	105	2,821	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	106	2,852	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	108	2,910	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	108	2,924	2027/7/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	111	2,989	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	111	3,006	2022/9/23
小 計				22,958	
(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	15,100	2031/6/21
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	115	8,255	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	111	7,996	2028/5/21

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
		千豪ドル	千豪ドル	千円	
(オーストラリア)					
国債証券					
ACGB 2 12/21/21	2.0	100	102	7,337	2021/12/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	100	109	7,830	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	200	230	16,472	2027/11/21
ACGB 2 3/4 11/21/29	2.75	100	117	8,388	2029/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	127	9,137	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	113	8,141	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	120	8,643	2029/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	121	8,713	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	115	8,233	2023/4/21
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	111	7,982	2022/7/15
小 計				122,233	
(シンガポール)					
国債証券					
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	237	18,061	2027/3/1
小 計				18,061	
(マレーシア)					
国債証券					
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	103	2,557	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	105	2,612	2027/5/31
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	105	2,620	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	103	2,554	2022/3/10

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
		千円	千円	千円	
(マレーシア)					
国債証券					
MGS 4.16 07/15/21	4.16	100	102	2,535	2021/7/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	106	2,641	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	109	2,716	2026/4/15
小 計				18,239	
(イスラエル)					
国債証券					
ILGOV 1 3/4 08/31/25	—	100	108	3,336	2025/8/31
ILGOV 2 03/31/27	—	100	110	3,392	2027/3/31
ILGOV 4 1/4 03/31/23	—	100	112	3,456	2023/3/31
ILGOV 5 1/2 01/31/22	—	100	110	3,418	2022/1/31
ILGOV 5 1/2 01/31/42	—	100	176	5,442	2042/1/31
小 計				19,046	
合 計				5,513,273	

(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%

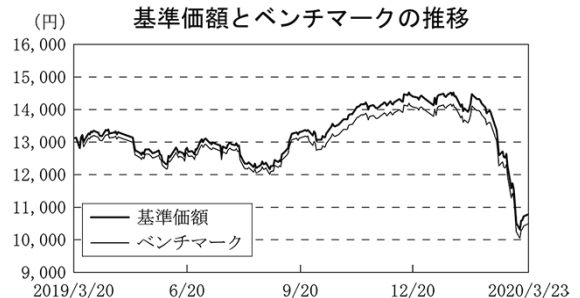
◇基準価額の主な変動要因

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ＳＣ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
JCR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
JXTG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
AGC	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
TOTO	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
東洋製鐵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
TDK	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
KOA	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
SCREEN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
NOK	8.8	6.2	6,503
フタバ産業	11.7	2.8	1,136
KYB	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
エーアイテイー	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
レスタールホールディングス	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
三愛石油	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
フォーバル	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
カップ・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
売番屋	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 DrugStores	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14期（決算日 2019年11月11日）

（計算期間 2018年11月13日～2019年11月11日）

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

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 円	価 額		ベ ン チ マ ー ク	債 組 入 比	券 率 %	純 資 産 額 百万円
		期 騰 落	中 率				
10期(2015年11月10日)	12,233		1.8	366.242		99.0	113,534
11期(2016年11月10日)	12,834		4.9	384.198		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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 円	価 額		ベ ン チ マ ー ク	債 組 入 比	券 率 %
		騰 落	率			
(期 首) 2018年11月12日	12,710		% —	379.669		% 99.5
11月末	12,763	0.4		381.238	0.4	99.2
12月末	12,860	1.2		384.131	1.2	99.7
2019年1月末	12,914	1.6		385.580	1.6	99.1
2月末	12,944	1.8		386.427	1.8	99.7
3月末	13,037	2.6		389.143	2.5	99.6
4月末	12,993	2.2		387.945	2.2	99.4
5月末	13,077	2.9		390.322	2.8	173.7
6月末	13,159	3.5		392.695	3.4	99.7
7月末	13,173	3.6		393.155	3.6	99.4
8月末	13,360	5.1		398.496	5.0	99.9
9月末	13,218	4.0		394.271	3.8	100.0
10月末	13,158	3.5		392.608	3.4	99.8
(期 末) 2019年11月11日	13,072	2.8		390.121	2.8	99.5

(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

(2018年11月13日～2019年11月11日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：12,710円
 期 末：13,072円
 騰落率： 2.8%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・欧米中央銀行による金融緩和姿勢の鮮明化などを背景とした10年国債利回りの低下（債券価格の上昇）
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・特にありません

■投資環境

10年国債利回りは前期末対比低下しました。

期初、世界経済の減速懸念を背景とした投資家のリスク回避姿勢の鮮明化や、FRB（米連邦準備制度理事会）高官による利上げサイクルの早期終了を示唆する発言をきっかけとした米国長期金利の低下を背景に、10年国債利回りは低下基調で推移し、2019年3月末には-0.09%程度まで低下しました。4月中旬にかけて一時0%に迫る水準まで上昇する局面もありましたが、4月下旬以降、米中貿易摩擦の激化やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和への期待、米国での利下げ観測の台頭などを背景に、10年国債利回りは低下に転じました。その後も、トランプ米大統領による第4弾となる対中制裁関税の発表や、香港情勢の悪化による地政学的リスクの高まり、英国の合意なきEU（欧州連合）離脱の可能性が高まったことなどから低下基調は続き、8月末には-0.28%を下回る水準まで低下しました。しかし、9月初旬、超長期金利の過度な低下を牽制した日銀総裁のインタビュー記事を契機に10年国債利回りは上昇に転じると、追加金融緩和期待の後退から期末にかけて上昇基調で推移し、-0.06%程度の水準で期を終えました。



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

(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI（総合）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2.8%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+2.8%に対して、基準価額の騰落率は+2.8%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

- ・リバランスに伴い売買した債券の評価時価と売買時価の差異に起因する含み益の発生

マイナス要因

- ・特にありません

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0.07%となっています。

※2019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運用を行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年11月13日～2019年11月11日)

該当事項はございません。

○ 売買及び取引の状況

(2018年11月13日～2019年11月11日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	9,010,477	1,607,461
	地方債証券	432,719	201,482 (12,000)
	特殊債券	—	— (4,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	110,651	— (24,570)

(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、上段の数字には含まれていません。

(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

(2018年11月13日～2019年11月11日)

該当事項はございません。

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

○ 組入資産の明細

(2019年11月11日現在)

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B B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	10,796,000	11,665,053	90.2	—	57.9	23.6	8.6
地方債証券	520,000	533,417	4.1	—	3.3	—	0.8
	(520,000)	(533,417)	(4.1)	(—)	(3.3)	(—)	(0.8)
特殊債券	100,000	102,562	0.8	—	—	—	0.8
(除く金融債)	(100,000)	(102,562)	(0.8)	(—)	(—)	(—)	(0.8)
普通社債券	510,799	570,803	4.4	—	3.6	—	0.8
(含む投資法人債券)	(510,799)	(570,803)	(4.4)	(—)	(3.6)	(—)	(0.8)
合 計	11,926,799 (1,130,799)	12,871,836 (1,206,782)	99.5 (9.3)	— (—)	64.8 (7.0)	23.6 (—)	11.0 (2.3)

(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391回利付国債 (2年)	0.1	50,000	50,106	2020/8/1		第46回利付国債 (30年)	1.5	93,000	118,040	2045/3/20	
第400回利付国債 (2年)	0.1	210,000	210,894	2021/5/1		第47回利付国債 (30年)	1.6	20,000	25,904	2045/6/20	
第403回利付国債 (2年)	0.1	360,000	361,767	2021/8/1		第49回利付国債 (30年)	1.4	30,000	37,444	2045/12/20	
第126回利付国債 (5年)	0.1	170,000	170,544	2020/12/20		第50回利付国債 (30年)	0.8	20,000	21,985	2046/3/20	
第129回利付国債 (5年)	0.1	170,000	170,901	2021/9/20		第51回利付国債 (30年)	0.3	50,000	48,680	2046/6/20	
第130回利付国債 (5年)	0.1	270,000	271,682	2021/12/20		第52回利付国債 (30年)	0.5	123,000	125,829	2046/9/20	
第131回利付国債 (5年)	0.1	400,000	402,832	2022/3/20		第56回利付国債 (30年)	0.8	35,000	38,460	2047/9/20	
第132回利付国債 (5年)	0.1	50,000	50,392	2022/6/20		第57回利付国債 (30年)	0.8	82,000	90,058	2047/12/20	
第133回利付国債 (5年)	0.1	190,000	191,635	2022/9/20		第58回利付国債 (30年)	0.8	80,000	87,812	2048/3/20	
第135回利付国債 (5年)	0.1	440,000	444,448	2023/3/20		第59回利付国債 (30年)	0.7	40,000	42,859	2048/6/20	
第136回利付国債 (5年)	0.1	430,000	434,678	2023/6/20		第62回利付国債 (30年)	0.5	134,000	136,089	2049/3/20	
第137回利付国債 (5年)	0.1	140,000	141,631	2023/9/20		第50回利付国債 (20年)	1.9	60,000	61,704	2021/3/22	
第139回利付国債 (5年)	0.1	270,000	273,553	2024/3/20		第51回利付国債 (20年)	2.0	90,000	93,166	2021/6/21	
第140回利付国債 (5年)	0.1	330,000	334,521	2024/6/20		第53回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,967	2021/12/20	
第5回利付国債 (40年)	2.0	34,000	49,724	2052/3/20		第60回利付国債 (20年)	1.4	20,000	20,996	2022/12/20	
第7回利付国債 (40年)	1.7	45,000	62,572	2054/3/20		第66回利付国債 (20年)	1.8	60,000	64,938	2023/12/20	
第9回利付国債 (40年)	0.4	94,000	91,671	2056/3/20		第67回利付国債 (20年)	1.9	30,000	32,750	2024/3/20	
第10回利付国債 (40年)	0.9	33,000	37,748	2057/3/20		第70回利付国債 (20年)	2.4	40,000	44,800	2024/6/20	
第11回利付国債 (40年)	0.8	88,000	97,913	2058/3/20		第71回利付国債 (20年)	2.2	60,000	66,642	2024/6/20	
第320回利付国債 (10年)	1.0	50,000	51,256	2021/12/20		第74回利付国債 (20年)	2.1	40,000	44,732	2024/12/20	
第324回利付国債 (10年)	0.8	50,000	51,301	2022/6/20		第75回利付国債 (20年)	2.1	30,000	33,722	2025/3/20	
第327回利付国債 (10年)	0.8	55,000	56,708	2022/12/20		第76回利付国債 (20年)	1.9	10,000	11,132	2025/3/20	
第335回利付国債 (10年)	0.5	100,000	103,406	2024/9/20		第80回利付国債 (20年)	2.1	40,000	45,200	2025/6/20	
第338回利付国債 (10年)	0.4	130,000	134,218	2025/3/20		第82回利付国債 (20年)	2.1	30,000	34,067	2025/9/20	
第339回利付国債 (10年)	0.4	30,000	31,019	2025/6/20		第84回利付国債 (20年)	2.0	80,000	90,791	2025/12/20	
第340回利付国債 (10年)	0.4	60,000	62,132	2025/9/20		第85回利付国債 (20年)	2.1	20,000	22,929	2026/3/20	
第341回利付国債 (10年)	0.3	385,000	396,769	2025/12/20		第90回利付国債 (20年)	2.2	65,000	75,736	2026/9/20	
第342回利付国債 (10年)	0.1	60,000	61,118	2026/3/20		第99回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,701	2027/12/20	
第343回利付国債 (10年)	0.1	105,000	107,035	2026/6/20		第100回利付国債 (20年)	2.2	70,000	83,875	2028/3/20	
第344回利付国債 (10年)	0.1	30,000	30,604	2026/9/20		第105回利付国債 (20年)	2.1	20,000	23,973	2028/9/20	
第345回利付国債 (10年)	0.1	230,000	234,717	2026/12/20		第111回利付国債 (20年)	2.1	20,000	24,306	2029/9/20	
第346回利付国債 (10年)	0.1	250,000	255,212	2027/3/20		第116回利付国債 (20年)	2.2	50,000	61,640	2030/3/20	
第347回利付国債 (10年)	0.1	80,000	81,694	2027/6/20		第117回利付国債 (20年)	2.1	135,000	165,026	2030/3/20	
第348回利付国債 (10年)	0.1	30,000	30,644	2027/9/20		第123回利付国債 (20年)	2.1	70,000	86,418	2030/12/20	
第350回利付国債 (10年)	0.1	140,000	142,959	2028/3/20		第127回利付国債 (20年)	1.9	100,000	121,566	2031/3/20	
第351回利付国債 (10年)	0.1	120,000	122,506	2028/6/20		第130回利付国債 (20年)	1.8	40,000	48,420	2031/9/20	
第352回利付国債 (10年)	0.1	150,000	153,021	2028/9/20		第133回利付国債 (20年)	1.8	90,000	109,211	2031/12/20	
第353回利付国債 (10年)	0.1	195,000	198,765	2028/12/20		第136回利付国債 (20年)	1.6	90,000	107,254	2032/3/20	
第354回利付国債 (10年)	0.1	210,000	213,861	2029/3/20		第139回利付国債 (20年)	1.6	105,000	125,381	2032/6/20	
第355回利付国債 (10年)	0.1	100,000	101,741	2029/6/20		第141回利付国債 (20年)	1.7	70,000	84,870	2032/12/20	
第3回利付国債 (30年)	2.3	20,000	24,929	2030/5/20		第144回利付国債 (20年)	1.5	90,000	106,952	2033/3/20	
第5回利付国債 (30年)	2.2	10,000	12,526	2031/5/20		第145回利付国債 (20年)	1.7	150,000	182,698	2033/6/20	
第22回利付国債 (30年)	2.5	10,000	13,717	2036/3/20		第147回利付国債 (20年)	1.6	30,000	36,258	2033/12/20	
第28回利付国債 (30年)	2.5	20,000	27,993	2038/3/20		第148回利付国債 (20年)	1.5	40,000	47,888	2034/3/20	
第29回利付国債 (30年)	2.4	60,000	83,302	2038/9/20		第150回利付国債 (20年)	1.4	177,000	209,911	2034/9/20	
第31回利付国債 (30年)	2.2	110,000	150,289	2039/9/20		第151回利付国債 (20年)	1.2	43,000	49,778	2034/12/20	
第32回利付国債 (30年)	2.3	10,000	13,929	2040/3/20		第152回利付国債 (20年)	1.2	85,000	98,539	2035/3/20	
第33回利付国債 (30年)	2.0	20,000	26,778	2040/9/20		第153回利付国債 (20年)	1.3	60,000	70,519	2035/6/20	
第34回利付国債 (30年)	2.2	100,000	138,541	2041/3/20		第154回利付国債 (20年)	1.2	50,000	58,040	2035/9/20	
第35回利付国債 (30年)	2.0	20,000	27,001	2041/9/20		第156回利付国債 (20年)	0.4	150,000	155,118	2036/3/20	
第36回利付国債 (30年)	2.0	93,000	126,115	2042/3/20		第158回利付国債 (20年)	0.5	81,000	84,892	2036/9/20	
第38回利付国債 (30年)	1.8	20,000	26,459	2043/3/20		第160回利付国債 (20年)	0.7	70,000	75,615	2037/3/20	
第39回利付国債 (30年)	1.9	20,000	26,964	2043/6/20		第161回利付国債 (20年)	0.6	40,000	42,503	2037/6/20	
第40回利付国債 (30年)	1.8	25,000	33,200	2043/9/20		第162回利付国債 (20年)	0.6	150,000	159,244	2037/9/20	
第42回利付国債 (30年)	1.7	153,000	200,244	2044/3/20		第164回利付国債 (20年)	0.5	160,000	166,724	2038/3/20	

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第167回利付国債（20年）	0.5	10,000	10,389	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	103,000	104,979	2039/3/20
小 計		10,796,000	11,665,053	
地方債証券				
第781回東京都公募公債	0.16	100,000	101,115	2028/6/20
第26回神奈川県公募公債（20年）	1.477	20,000	23,606	2034/6/20
平成29年度第7回広島県公募公債	0.2	100,000	101,502	2028/3/23
平成27年度第3回福岡県公募公債	0.529	200,000	206,188	2025/8/25
平成22年度第3回横浜市公募公債	1.168	100,000	101,006	2020/9/18
小 計		520,000	533,417	
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	102,562	2021/2/26
小 計		100,000	102,562	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第33回道路債券	2.91	100,000	137,761	2034/6/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	41,189	43,738	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	45,684	48,492	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	43,441	46,096	2047/1/10
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	44,368	47,121	2047/4/10
第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	36,117	37,057	2039/2/10
第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.11	100,000	100,221	2019/12/20
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	110,316	2026/12/22
小 計		510,799	570,803	
合 計		11,926,799	12,871,836	

(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

(2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	12,871,836	99.4
コール・ローン等、その他	80,859	0.6
投資信託財産総額	12,952,695	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,952,695,105
コール・ローン等	59,356,392
公社債(評価額)	12,871,836,511
未収利息	19,006,057
前払費用	2,496,145
(B) 負債	15,212,497
未払解約金	15,212,364
未払利息	133
(C) 純資産総額(A－B)	12,937,482,608
元本	9,896,990,636
次期繰越損益金	3,040,491,972
(D) 受益権総口数	9,896,990,636口
1万円当たり基準価額(C／D)	13,072円

(注) 当親ファンドの期首元本額は4,056,267,227円、期中追加設定元本額は7,730,963,854円、期中一部解約元本額は1,890,240,445円です。

<元本の内訳>

円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	3,001,932,489円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	2,700,209,668円
東京海上セレクション・日本債券インデックス	2,249,333,015円
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	873,582,369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>	381,902,037円
TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	172,022,837円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	159,583,222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>	112,605,739円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	56,369,653円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	42,718,861円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	39,181,691円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	38,164,519円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	23,392,213円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	23,372,387円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	21,874,462円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	217,143円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	201,782円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	170,990円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	155,559円

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

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2018年11月13日～2019年11月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	64,627,243
受取利息	64,715,462
支払利息	△ 88,219
(B) 有価証券売買損益	38,719,604
売買益	121,373,950
売買損	△ 82,654,346
(C) 当期損益金(A+B)	103,346,847
(D) 前期繰越損益金	1,099,173,394
(E) 追加信託差損益金	2,421,907,967
(F) 解約差損益金	△ 583,936,236
(G) 計(C+D+E+F)	3,040,491,972
次期繰越損益金(G)	3,040,491,972

(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。

○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外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2019年11月11日）

（計算期間 2018年11月13日～2019年11月11日）

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

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

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

（注）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首) 2018年11月12日	円	%		%	%	%	%
	24,465	—	1,147,119	—	92.4	5.1	2.3
11月末	24,074	△ 1.6	1,127,410	△ 1.7	94.6	4.3	2.3
12月末	21,574	△11.8	1,009,334	△12.0	93.7	6.4	2.3
2019年1月末	22,967	△ 6.1	1,074,490	△ 6.3	93.6	6.0	2.6
2月末	24,346	△ 0.5	1,141,179	△ 0.5	95.6	3.6	2.5
3月末	24,533	0.3	1,149,448	0.2	96.7	2.4	2.6
4月末	25,639	4.8	1,201,501	4.7	94.3	5.3	2.5
5月末	24,012	△ 1.9	1,125,764	△ 1.9	96.9	2.3	2.7
6月末	24,859	1.6	1,166,662	1.7	97.9	2.1	2.7
7月末	25,548	4.4	1,198,358	4.5	97.5	2.3	2.7
8月末	24,291	△ 0.7	1,139,763	△ 0.6	97.7	2.5	2.9
9月末	25,093	2.6	1,176,491	2.6	97.9	2.3	2.8
10月末	26,085	6.6	1,221,957	6.5	98.2	1.8	2.8
(期 末) 2019年11月11日	26,489	8.3	1,242,639	8.3	95.6	1.7	2.6

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2018年11月13日～2019年11月11日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：24,465円

期 末：26,489円

騰落率： 8.3%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

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

マイナス要因

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

■投資環境

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

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

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

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

以上のような経緯を経て、外国株式市場は前期末対比で上昇しました。



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

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

■ポートフォリオについて

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

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

以上の運用の結果、基準価額は8.3%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

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

(主な差異要因)

プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・配当課税の影響
- ・売買コストの影響

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

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

○今後の運用方針

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年11月13日～2019年11月11日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2018年11月13日～2019年11月11日)

株式

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

		買 付 額		売 付 額	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 1,634 (29)	千香港ドル 5,399 (—)	百株 430	千香港ドル 319
	シンガポール	494	千シンガポールドル 230	—	千シンガポールドル —
	イスラエル	13	千イスラエルシェケル 60	—	千イスラエルシェケル —

(注) 金額は受渡代金です。

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

投資信託証券

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

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	SL GREEN REALTY CORP	0.081	6	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.282	47	—	—
	UDR INC	0.569	25	—	—
	VENTAS INC	0.406	25	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	0.202	13	—	—
	WP CAREY INC	0.771	65	—	—
	WELLTOWER INC	0.617	49	—	—
	WEYERHAEUSER CO	0.829	20	—	—
	小 計	14	1,245	0.026	7
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.509	13	—	—
	小 計	0.509	13	—	—
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	0.425	12	—	—
	GECINA SA	0.05	6	—	—
	COVIVIO	0.158	14	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.136	20	—	—
	小 計	0.769	53	—	—
	ユ ー ロ 計	0.769	53	—	—
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	2	12	—	—
	HAMMERSON PLC	1	5	4	11
	SEGRO PLC	2	14	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1	9	—	—
	小 計	6	42	4	11
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	3	11	—	—
	GPT GROUP	3	21	—	—
	STOCKLAND	2	9	—	—
	DEXUS	4	60	—	—
	GOODMAN GROUP	0.677	10	—	—
	SCENTRE GROUP	3	12	—	—
	小 計	19	126	—	—
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	2	174	—	—
	小 計	2	174	—	—
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	7	18	—	—
	小 計	7	18	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 4,537	百万円 4,735	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2018年11月13日～2019年11月11日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,440,818千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,104,353千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.53

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2018年11月13日～2019年11月11日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2019年11月11日現在)

外国株式

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

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ASSURANT INC	1	3	39	4,273	保険
ATMOS ENERGY CORP	1	5	56	6,162	公益事業
AUTODESK INC	4	7	121	13,240	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	3	4	40	4,437	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	8	14	230	25,206	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	0.52	0.82	95	10,435	小売
AVERY DENNISON CORP	3	3	52	5,697	素材
BB&T CORPORATION	15	23	129	14,093	銀行
BAKER HUGHES COMPANY	10	26	58	6,395	エネルギー
BALL CORP	8	12	80	8,800	素材
BANK OF AMERICA CORP	189	296	987	107,794	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20	27	136	14,882	各種金融
BAXTER INTL INC	9	16	128	14,072	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	5	9	226	24,717	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	3	7	51	5,632	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24	42	932	101,754	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	4	8	69	7,541	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3	8	64	7,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	4	6	200	21,895	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	2	3	175	19,210	各種金融
H&R BLOCK INC	7	8	21	2,359	消費者サービス
BOEING CO	10	17	626	68,392	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	0.93	1	255	27,898	小売
BORGWARNER INC	6	9	44	4,893	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	27	47	194	21,217	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5	6	26	2,937	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32	54	316	34,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	2	5	60	6,631	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	7	13	428	46,733	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6	9	61	6,745	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B	7	15	60	6,581	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	4	54	5,981	各種金融
CBRE GROUP INC - A	6	12	70	7,723	不動産
CDK GLOBAL INC	3	5	30	3,306	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	3	5	78	8,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	—	8	40	4,438	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	5	39	4,320	運輸
CIGNA CORP	4	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CIGNA CORP	—	13	245	26,830	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	6	11	233	25,504	各種金融
CMS ENERGY CORP	6	11	65	7,177	公益事業
CSX CORP	16	24	180	19,717	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	19	43	316	34,601	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	11	15	28	3,142	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	5	8	37	4,084	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	10	15	152	16,594	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	8	11	63	6,982	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	3	7	65	7,173	小売
CARNIVAL CORP	8	15	70	7,642	消費者サービス
CATERPILLAR INC	11	18	280	30,583	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	3	5	66	7,282	素材
CELGENE CORP	14	24	265	29,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	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	
CENTENE CORP	4	16	90	9,862	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	13	23	66	7,266	公益事業
CERNER CORP	6	9	65	7,200	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	3	5	263	28,715	メディア・娯楽
CHEVRONTXACO CORP	37	62	750	81,950	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	0.68	0.99	72	7,906	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	8	58	6,425	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	2	5	25	2,794	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3	5	65	7,095	保険
CISCO SYSTEMS INC	92	138	677	73,968	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	2	2	75	8,230	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	50	76	582	63,532	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10	16	62	6,824	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	3	5	55	6,055	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	2	4	62	6,817	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY	77	130	683	74,654	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	5	7	38	4,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11	17	112	12,296	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	16	25	168	18,408	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	91	152	687	75,074	メディア・娯楽
COMERICA INC	3	7	52	5,755	銀行
CONAGRA BRANDS INC	10	20	55	6,023	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	3	7	54	5,908	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	22	35	209	22,880	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	5	10	88	9,626	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3	5	106	11,670	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	1	2	62	6,870	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	3	7	59	6,544	商業・専門サービス
CORNING INC	15	25	77	8,460	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	24	65	7,115	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	8	14	437	47,800	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	0.73	1	71	7,855	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	15	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
CUMMINS INC	2	4	87	9,556	資本財
DR HORTON INC	6	12	62	6,789	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	3	4	54	5,931	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	5	13	40	4,386	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	12	21	293	32,091	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	2	5	58	6,359	消費者サービス
DAVITA INC	3	6	42	4,658	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	6	10	182	19,975	資本財
DENTSPLY SIRONA INC	7	10	59	6,462	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	12	18	41	4,531	エネルギー
THE WALT DISNEY CO	29	59	822	89,801	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7	10	91	10,005	各種金融
DISCOVERY INC-A	5	11	36	4,038	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	4	13	39	4,363	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORPORATION	—	11	41	4,480	メディア・娯楽
EVEREST RE GROUP LTD	1	1	51	5,619	保険
Dollar General Corp	5	8	139	15,250	小売
DOLLAR TREE INC	4	8	95	10,407	小売
DOMINION ENERGY INC	12	25	205	22,478	公益事業

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

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

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

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

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

銘柄	株数	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	千ドル	千円	
SYSCO CORP	9	16	129	14,095	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7	13	56	6,155	各種金融
TJX COMPANIES INC	23	38	229	25,047	小売
T-MOBILE US INC	6	12	99	10,823	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	4	56	6,217	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	7	13	37	4,060	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	9	17	191	20,861	小売
TELEFLEX INC	0.7	2	69	7,627	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC	2	4	155	16,929	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	18	31	384	41,929	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	4	10	50	5,459	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8	13	404	44,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	11	18	321	35,080	資本財
TIFFANY & CO	3	4	61	6,708	小売
TOLL BROTHERS INC	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	2	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3	5	50	5,516	小売
TRANSDIGM GROUP INC	1	1	103	11,281	資本財
TRANSUNION	4	8	65	7,128	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	5	8	108	11,872	保険
TRIMBLE INC	6	12	50	5,521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC-W/I	3	7	25	2,752	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	19	—	—	—	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10	—	—	—	メディア・娯楽
TWITTER INC	13	29	84	9,256	メディア・娯楽
TYSON FOODS INC-CL A	5	10	84	9,200	食品・飲料・タバコ
US BANCORP	29	47	282	30,803	銀行
ULTA BEAUTY INC	1	2	56	6,138	小売
UNION PACIFIC CORP	15	23	406	44,347	運輸
UNITED PARCEL SERVICE CL B	13	22	283	30,990	運輸
UNITED RENTALS INC	2	3	54	5,917	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	14	27	408	44,546	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	18	31	805	87,883	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	2	3	51	5,669	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	6	10	30	3,359	保険
VF CORP	6	11	96	10,540	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	1	1	44	4,859	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	8	14	144	15,799	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2	3	47	5,188	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3	4	70	7,674	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	2	4	79	8,687	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	80	134	799	87,325	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	2	4	63	6,926	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5	9	189	20,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC CL B	10	18	41	4,502	メディア・娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	34	57	1,021	111,533	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	2	3	62	6,806	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	5	7	44	4,907	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	3	4	65	7,163	素材
WABCO HOLDINGS INC	2	2	29	3,248	資本財

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 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	
SOUTH32 LTD	117	234	64	4,812	素材	
COLES GROUP LTD	—	40	61	4,575	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,372	2,453	4,348	325,346	
	銘柄 数 < 比 率 >	36	40	—	< 2.3% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	27	37	2,560	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	—	29	36	2,541	食品・飲料・タバコ	
SPARK NEW ZEALAND LTD	68	85	38	2,640	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	35	40	38	2,657	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	—	93	43	2,997	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	103	276	193	13,397	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	5	—	< 0.1% >	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15	18	186	2,599	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	46	116	221	3,089	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	35	50	418	5,837	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24	40	1,016	14,163	各種金融	
LI & FUNG LTD	360	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MTR CORPORATION	45	80	360	5,023	運輸	
HANG SENG BANK	16	24	408	5,687	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	49	84	331	4,626	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	40	50	280	3,913	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	184	309	476	6,647	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	30	—	—	—	不動産	
Galaxy Entertainment Group Limited	60	100	552	7,701	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	100	155	437	6,093	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	95	145	175	2,449	資本財	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	45	60	136	1,898	耐久消費財・アパレル	
SINO LAND CO	118	218	264	3,689	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	40	60	724	10,095	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	20	30	229	3,205	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	—	65	407	5,676	資本財	
AIA GROUP LTD	242	408	3,361	46,865	保険	
HKT Trust / HKT Ltd	—	230	281	3,917	電気通信サービス	
Sands China Ltd	64	112	454	6,338	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	50	88	220	3,072	不動産	
WH Group Limited	—	375	327	4,563	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	58	93	700	9,771	資本財	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	25	45	255	3,556	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	58	98	544	7,589	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,820	3,054	12,774	178,076	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	25	—	< 1.2% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	65	113	46	3,736	資本財	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	33	55	146	11,744	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	20	39	42	3,405	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	110	138	32	2,646	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	30	43	40	3,216	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	24	31	83	6,704	銀行	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	30	49	38	3,126	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	70	165	38	3,098	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	137	217	72	5,833	電気通信サービス	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		65	79	87	7,056
KEPPEL CORP LTD		56	84	58	4,664
GENTING SINGAPORE LTD		220	341	32	2,572
小 計	株 数 ・ 金 額	860	1,354	720	57,805
	銘 柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>
(イスラエル)				千イスラエルシェケル	
BANK HAPOLIM BM		30	37	106	3,326
BANK LEUMI LE-ISRAEL		51	51	133	4,157
ISRAEL CHEMICALS LTD		35	35	57	1,803
NICE LTD		2	2	142	4,435
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		—	7	60	1,894
小 計	株 数 ・ 金 額	119	133	500	15,617
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.1%>
合 計	株 数 ・ 金 額	21,542	35,982	—	13,694,645
	銘 柄 数 < 比 率 >	931	967	—	<95.6%>

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

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

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

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

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

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引		百万円	百万円
		S&P 500 EMIN	151	—
		DJ EU STX 50	53	—
		FTSE 100 IDX	41	—

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

○投資信託財産の構成

(2019年11月11日現在)

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

(注) 当期末における外貨建純資産（14,310,779千円）の投資信託財産総額（14,366,057千円）に対する比率は99.6%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは 1米ドル=109.16円、1カナダドル=82.52円、1ユーロ=120.25円、1英ポンド=139.65円、1スイスフラン=109.40円、1スウェーデンクローネ=11.25円、1ノルウェークローネ=11.93円、1デンマーククローネ=16.09円、1豪ドル=74.82円、1ニュージーランドドル=69.19円、1香港ドル=13.94円、1シンガポールドル=80.25円、1イスラエルシェケル=31.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年11月11日現在)

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

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

<元本の内訳>

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

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

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

○損益の状況 (2018年11月13日～2019年11月11日)

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

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

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

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

○お知らせ

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2019年11月11日）

（計算期間 2018年11月13日～2019年11月11日）

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

東京海上アセットマネジメント

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	ベ ン チ マ ー ク	債 組 入 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	期 騰 落 率	率	率
10期(2015年11月10日)	円 15,790	% 1.8	% 271.842	% 153,885
11期(2016年11月10日)	14,050	△11.0	243.067	98.6
12期(2017年11月10日)	15,662	11.5	269.321	98.6
13期(2018年11月12日)	15,274	△ 2.5	262.755	98.9
14期(2019年11月11日)	15,809	3.5	272.101	97.7

○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	率
	騰 落 率	騰 落 率	率	率
(期 首)	円			%
2018年11月12日	15,274	262.755	98.9	
11月末	15,338	263.953	98.2	0.4
12月末	15,248	262.285	97.6	△0.2
2019年1月末	15,159	260.677	97.8	△0.8
2月末	15,371	264.369	97.1	0.6
3月末	15,571	267.927	97.9	2.0
4月末	15,529	267.171	97.5	1.7
5月末	15,408	265.037	97.3	0.9
6月末	15,603	268.513	97.7	2.2
7月末	15,650	269.293	97.9	2.5
8月末	15,748	271.108	97.4	3.1
9月末	15,823	272.390	97.1	3.6
10月末	15,981	275.051	97.2	4.6
(期 末)				
2019年11月11日	15,809	272.101	97.7	3.6

(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

(2018年11月13日～2019年11月11日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：15,274円

期 末：15,809円

騰落率： 3.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国債を中心とした世界的な金利低下（債券価格の上昇）
- ・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、世界的な景気減速懸念の高まりから米国株式市場が急落したことを背景に米国債利回りは低下して始まり、その後も2019年5月に米中貿易摩擦に対する懸念が急激に高まるなど、利回りは低下基調が続きました。期後半にかけても、7月にFRB（米連邦準備制度理事会）が利下げに転じたことや、8月の米国による対中追加関税の発表などを背景に、利回りは一段と低下しました。期末にかけて、米中貿易協議の進展や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退から利回りは上昇基調に転じましたが、期を通してみると米国債利回りは期初から低下した水準で期を終えました。

ドイツ国債利回りは低下しました。ユーロ圏の経済指標が悪化し、ECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和観測が高まるなか、米中貿易摩擦に対する懸念が急激に高まったことでドイツ国債利回りは大きく低下しました。期末には米国債と同様に利回りは上昇基調に転じましたが、期を通してみるとドイツ国債利回りは期初から低下した水準で期を終えました。

【外国為替市場動向】

米ドル円相場は円高米ドル安、ユーロ円相場も円高ユーロ安で期を終えました。

期初、米ドル円相場は、世界的な景気減速懸念を受けて円高米ドル安が進行しました。その後一時円安米ドル高へ反転する局面もありましたが、米中貿易摩擦に対する懸念の高まりなどから再度円高米ドル安が進行しました。期末にかけて円安米ドル高基調に戻りましたが、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、米ドル円相場と同様に、前期末対比円高ユーロ安の水準で期を終えました。



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

(注) ベンチマークは、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3.5%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+3.6%に対して、基準価額の騰落率は+3.5%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

・取引などのコスト

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0.09%となっています。

※2019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運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2018年11月13日～2019年11月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 4	% 0.028	(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)	(4)	(0.027)	*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	4	0.028	
期中の平均基準価額は、15,535円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2018年11月13日～2019年11月11日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 5,564	千米ドル 3,691
	カナダ	国債証券	千カナダドル 400	千カナダドル 305
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 589	千メキシコペソ 1,097
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	863	883
	イタリア	国債証券	672	523
	フランス	国債証券	984	807
	スペイン	国債証券	785	718
	ベルギー	国債証券	360	272
	オーストリア	国債証券	166	168
	アイルランド	国債証券	131	108
	イギリス	国債証券	千英ポンド 565	千英ポンド 528
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 108	千デンマーククローネ 321
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 102	千ポーランドズロチ 98
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 218	千豪ドル 102
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 200	千マレーシアリングット 312
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド ー	千南アフリカランド 100

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

○利害関係人との取引状況等

(2018年11月13日～2019年11月11日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2019年11月11日現在)

外国公社債

(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	19,050	19,692	2,149,670	47.3	—	21.2	17.4	8.7
カナダ	千カナダドル 1,000	千カナダドル 1,067	88,068	1.9	—	1.0	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 5,800	千メキシコペソ 6,116	34,927	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	2,000	2,307	277,427	6.1	—	3.6	1.7	0.8
イタリア	2,700	3,314	398,555	8.8	—	5.6	2.4	0.8
フランス	2,800	3,557	427,779	9.4	—	7.4	1.5	0.6
オランダ	500	663	79,769	1.8	—	0.9	0.9	—
スペイン	1,600	2,084	250,647	5.5	—	4.0	0.9	0.6
ベルギー	700	867	104,268	2.3	—	1.5	0.8	—
オーストリア	400	520	62,631	1.4	—	1.1	0.3	—
フィンランド	200	229	27,641	0.6	—	0.6	—	—
アイルランド	200	240	28,973	0.6	—	0.6	—	—
イギリス	千英ポンド 1,590	千英ポンド 2,020	282,180	6.2	—	4.7	1.0	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 1,000	千スウェーデンクローネ 1,132	12,743	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 900	千ノルウェークローネ 925	11,044	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 1,100	千デンマーククローネ 1,442	23,204	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 800	千ポーランドズロチ 829	23,385	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 1,100	千豪ドル 1,246	93,267	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 200	千シンガポールドル 224	17,995	0.4	—	0.4	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 700	千マレーシアリンギット 715	18,863	0.4	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 3,500	千南アフリカランド 3,170	23,272	0.5	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	4,436,319	97.7	—	55.9	28.8	12.9

(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	評 価 額	外貨換算金額	償還年月日
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	99	10,843	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	99	10,840	2023/3/31
T 1 1/2 08/31/21	1.5	100	99	10,875	2021/8/31
T 1 1/2 09/15/22	1.5	100	99	10,859	2022/9/15
T 1 1/2 09/30/21	1.5	100	99	10,876	2021/9/30
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	98	10,733	2023/7/31
T 1 1/4 08/31/24	1.25	300	293	32,018	2024/8/31
T 1 1/8 08/31/21	1.125	300	296	32,407	2021/8/31
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	300	32,781	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	500	54,631	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	400	43,745	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	500	54,639	2023/5/15
T 1 3/4 07/31/24	1.75	100	100	10,918	2024/7/31
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	200	21,859	2022/9/30
T 1 3/4 12/31/20	1.75	500	500	54,614	2020/12/31
T 1 5/8 02/15/26	1.625	600	592	64,687	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	300	296	32,318	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	498	54,469	2022/8/15
T 1 5/8 08/15/29	1.625	200	194	21,226	2029/8/15
T 1 5/8 09/30/26	1.625	100	98	10,759	2026/9/30
T 1 5/8 11/30/20	1.625	300	299	32,727	2020/11/30
T 1 7/8 02/28/22	1.875	200	200	21,917	2022/2/28
T 1 7/8 07/31/26	1.875	100	100	10,939	2026/7/31
T 1 7/8 11/30/21	1.875	600	602	65,756	2021/11/30
T 2 01/15/21	2.0	100	100	10,954	2021/1/15
T 2 02/15/22	2.0	500	503	54,959	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	302	33,047	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	202	22,079	2025/2/15
T 2 06/30/24	2.0	100	101	11,038	2024/6/30
T 2 08/15/25	2.0	800	807	88,194	2025/8/15
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	101	11,082	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	516	56,362	2024/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	308	33,671	2023/8/15
T 2 1/4 01/31/24	2.25	100	102	11,146	2024/1/31
T 2 1/4 03/31/21	2.25	300	302	32,988	2021/3/31
T 2 1/4 04/30/21	2.25	200	201	22,000	2021/4/30
T 2 1/4 07/31/21	2.25	300	302	33,042	2021/7/31
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	102	11,217	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	200	193	21,081	2046/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	818	89,354	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	411	44,871	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	305	33,318	2025/5/15
T 2 1/8 08/15/21	2.125	400	402	43,977	2021/8/15

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
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 2 11/15/21	2.0	300	301	32,950	2021/11/15
T 2 11/15/26	2.0	100	101	11,027	2026/11/15
T 2 11/30/20	2.0	100	100	10,952	2020/11/30
T 2 11/30/22	2.0	300	302	33,026	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	500	532	58,178	2028/2/15
T 2 3/4 11/15/23	2.75	500	519	56,729	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	212	23,194	2042/11/15
T 2 3/8 03/15/21	2.375	300	302	33,034	2021/3/15
T 2 3/8 05/15/27	2.375	100	103	11,313	2027/5/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	205	22,451	2024/8/15
T 2 5/8 02/15/29	2.625	200	211	23,121	2029/2/15
T 2 5/8 03/31/25	2.625	100	104	11,388	2025/3/31
T 2 5/8 07/15/21	2.625	100	101	11,080	2021/7/15
T 2 7/8 05/15/28	2.875	100	107	11,750	2028/5/15
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	107	11,761	2028/8/15
T 2 7/8 10/15/21	2.875	100	102	11,157	2021/10/15
T 2 7/8 11/15/21	2.875	100	102	11,168	2021/11/15
T 3 02/15/47	3.0	300	335	36,611	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	200	223	24,431	2048/2/15
T 3 02/15/49	3.0	300	336	36,754	2049/2/15
T 3 08/15/48	3.0	100	112	12,234	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	112	12,330	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/21	3.125	100	102	11,140	2021/5/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	114	12,511	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	339	37,102	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	113	12,341	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	400	445	48,630	2045/11/15
T 3 5/8 02/15/21	3.625	300	307	33,525	2021/2/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	122	13,366	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	200	244	26,684	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	100	125	13,730	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	132	14,424	2040/11/15
T 4 3/4 02/15/41	4.75	100	140	15,366	2041/2/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	133	14,616	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	70	7,739	2037/5/15
小 計				2,149,670	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0 3/4 09/01/21	0.75	100	98	8,121	2021/9/1
CAN 1 06/01/27	1.0	100	95	7,896	2027/6/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	99	8,233	2023/6/1
CAN 1 1/4 03/01/25	1.25	100	98	8,123	2025/3/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	104	8,590	2024/6/1

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
(カナダ) 国債証券	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	105	8,739	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	102	8,486	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	123	10,158	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	136	11,261	2045/12/1
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	100	102	8,456	2021/6/1
小 計				88,068	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	254	1,455	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	686	3,919	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	380	2,171	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	599	3,420	2022/6/9
MBONO 6 1/2 06/10/21	6.5	1,000	997	5,696	2021/6/10
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	700	728	4,158	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	317	1,812	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	419	2,395	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	213	1,217	2034/11/23
MBONO 8 09/05/24	8.0	100	105	603	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	300	334	1,910	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	300	337	1,929	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	200	217	1,243	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	500	524	2,992	2023/12/7
小 計				34,927	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0 06/11/21	—	100	100	12,145	2021/6/11
DBR 0 08/15/26	—	100	103	12,401	2026/8/15
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	106	12,774	2026/2/15
DBR 0 1/4 02/15/27	0.25	100	105	12,629	2027/2/15
DBR 0 1/4 02/15/29	0.25	100	105	12,638	2029/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	200	210	25,295	2028/8/15
DBR 1 08/15/24	1.0	100	107	12,924	2024/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	108	13,082	2025/8/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	106	12,756	2022/9/4
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	106	12,793	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	156	18,790	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	159	19,185	2046/8/15
DBR 4 01/04/37	4.0	100	169	20,343	2037/1/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	153	18,459	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	100	102	12,322	2024/4/5
OBL 0 04/09/21	—	200	201	24,264	2021/4/9
OBL 0 10/13/23	—	200	204	24,619	2023/10/13
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.05 04/15/21	0.05	100	100	12,054	2021/4/15

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
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	104	12,561	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	100	103	12,397	2022/4/15
BTPS 1.6 06/01/26	1.6	100	105	12,655	2026/6/1
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	102	12,336	2032/3/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	107	12,928	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	104	12,566	2021/12/15
BTPS 3 08/01/29	3.0	100	116	14,029	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	121	14,598	2030/3/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	100	106	12,805	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	115	13,854	2024/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	131	15,793	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	117	14,099	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	114	13,778	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	116	13,993	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	100	108	13,061	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	131	15,769	2028/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/44	4.75	100	149	17,997	2044/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	143	17,208	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	149	17,948	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	149	17,980	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	231	27,849	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	150	18,044	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	149	17,940	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	142	17,085	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	143	17,216	2026/11/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	100	107	12,893	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	200	217	26,207	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	100	115	13,933	2031/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/34	1.25	100	113	13,664	2034/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	113	13,662	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	107	12,979	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	108	13,003	2023/5/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	221	26,667	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	131	15,838	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	100	125	15,121	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	325	39,105	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	249	30,002	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	159	19,238	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	100	107	12,931	2021/10/25
FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	100	106	12,787	2021/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	164	19,790	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	167	20,092	2035/4/25

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…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	119	14,315	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	200	305	36,707	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	171	20,660	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	137	16,586	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	179	21,589	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/22	—	100	101	12,180	2022/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	111	13,432	2024/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	176	21,277	2042/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	147	17,724	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	126	15,155	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0.05 01/31/21	0.05	100	100	12,095	2021/1/31
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	109	13,191	2027/10/31
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	112	13,478	2026/4/30
SPGB 1.95 07/30/30	1.95	100	115	13,911	2030/7/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	114	13,739	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	112	13,481	2025/10/31
SPGB 2.35 07/30/33	2.35	100	122	14,678	2033/7/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	154	18,576	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	118	14,220	2023/10/31
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	171	20,588	2041/7/30
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	173	20,828	2040/7/30
SPGB 5 1/2 04/30/21	5.5	100	108	13,070	2021/4/30
SPGB 5 3/4 07/30/32	5.75	100	164	19,736	2032/7/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	142	17,116	2028/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	113	13,694	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	151	18,238	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0 1/2 10/22/24	0.5	100	104	12,527	2024/10/22
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	101	12,249	2023/10/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	108	12,991	2026/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	120	14,476	2047/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	172	20,771	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	112	13,558	2022/9/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	147	17,692	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	—	100	101	12,210	2022/9/20
RAGB 0 3/4 02/20/28	0.75	100	107	12,887	2028/2/20
RAGB 3.15 06/20/44	3.15	100	162	19,531	2044/6/20
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	100	149	18,002	2027/7/15

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…フィンランド) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	105	12,633	2028/9/15
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	124	15,008	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	111	13,368	2033/5/15
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	129	15,604	2025/3/13
ユ ー ロ 計				1,657,694	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 1 04/22/24	1.0	100	102	14,255	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	104	14,631	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	104	14,643	2027/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	100	103	14,450	2022/9/7
UKT 1 3/4 09/07/37	1.75	100	109	15,234	2037/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	108	15,091	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	108	15,177	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	106	14,885	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	147	20,591	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	184	25,748	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	140	19,626	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	166	23,276	2052/7/22
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	38	5,394	2027/12/7
UKT 4 1/4 12/07/49	4.25	100	173	24,250	2049/12/7
UKT 4.25 06/07/32	4.25	100	139	19,489	2032/6/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,051	2028/12/7
UKT 8 06/07/21	8.0	150	167	23,381	2021/6/7
小 計				282,180	
(スウェーデン) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	100	106	1,200	2028/5/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	200	214	2,412	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	100	107	1,213	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	100	115	1,294	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	157	1,771	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	200	219	2,474	2022/6/1
SGB 5 12/01/20	5.0	200	211	2,377	2020/12/1
小 計				12,743	
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	100	1,194	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	101	1,211	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	101	1,214	2025/3/13
NGB 2 04/26/28	2.0	100	103	1,234	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	200	204	2,441	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	100	106	1,274	2024/3/14

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
(ノルウェー) 国債証券	%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
NGB 3 3/4 05/25/21	3.75	200	207	2,474	2021/5/25
小 計				11,044	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	200	214	3,445	2027/11/15
DGB 0 1/2 11/15/29	0.5	100	107	1,726	2029/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	100	108	1,746	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	227	3,654	2025/11/15
DGB 3 11/15/21	3.0	200	215	3,460	2021/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	300	570	9,171	2039/11/15
小 計				23,204	
(ポーランド) 国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLGB 1 3/4 07/25/21	1.75	200	201	5,671	2021/7/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	100	102	2,891	2023/1/25
POLGB 2 1/2 04/25/24	2.5	100	102	2,892	2024/4/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	102	2,897	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	102	2,895	2027/7/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	106	2,992	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	111	3,144	2022/9/23
小 計				23,385	
(オーストラリア) 国債証券		千豪ドル	千豪ドル		
ACGB 2 1/2 05/21/30	2.5	100	111	8,351	2030/5/21
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	107	8,076	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	100	107	8,070	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	100	111	8,350	2027/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	123	9,214	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	111	8,366	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	117	8,785	2029/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	119	8,936	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	115	8,648	2023/4/21
ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	100	107	8,024	2021/5/15
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	112	8,443	2022/7/15
小 計				93,267	

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
(シンガポール) 国債証券	%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	224	17,995	2027/3/1
小 計				17,995	
(マレーシア) 国債証券		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	100	2,659	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	100	2,645	2027/5/31
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	101	2,666	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	101	2,683	2022/3/10
MGS 4.16 07/15/21	4.16	100	101	2,681	2021/7/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	103	2,737	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	105	2,789	2026/4/15
小 計				18,863	
(南アフリカ) 国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
SAGB 10 1/2 12/21/26	10.5	500	549	4,032	2026/12/21
SAGB 6 1/2 02/28/41	6.5	200	138	1,014	2041/2/28
SAGB 6 1/4 03/31/36	6.25	200	142	1,047	2036/3/31
SAGB 6 3/4 03/31/21	6.75	100	99	733	2021/3/31
SAGB 7 02/28/31	7.0	300	250	1,842	2031/2/28
SAGB 7 3/4 02/28/23	7.75	200	201	1,479	2023/2/28
SAGB 8 01/31/30 #2030	8.0	300	276	2,031	2030/1/31
SAGB 8 1/2 01/31/37 #203	8.5	300	264	1,943	2037/1/31
SAGB 8 1/4 03/31/32 #203	8.25	200	181	1,334	2032/3/31
SAGB 8 3/4 01/31/44	8.75	300	262	1,928	2044/1/31
SAGB 8 3/4 02/28/48	8.75	500	434	3,188	2048/2/28
SAGB 8 7/8 02/28/35 #203	8.875	200	185	1,363	2035/2/28
SAGB 9 01/31/40 #2040	9.0	200	181	1,332	2040/1/31
小 計				23,272	
合 計				4,436,319	

(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

(2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,436,319	97.2
コール・ローン等、その他	126,232	2.8
投資信託財産総額	4,562,551	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産（4,489,686千円）の投資信託財産総額（4,562,551千円）に対する比率は98.4%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＝109.16円、1カナダドル＝82.52円、1メキシコペソ＝5.71円、1ユーロ＝120.25円、1英ポンド＝139.65円、1スウェーデンクローネ＝11.25円、1ノルウェークローネ＝11.93円、1デンマーククローネ＝16.09円、1ポーランドズロチ＝28.19円、1豪ドル＝74.82円、1シンガポールドル＝80.25円、1マレーシアリングgit＝26.37円、1南アフリカランド＝7.34円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年11月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,570,802,213
コール・ローン等	90,878,111
公社債(評価額)	4,436,319,151
未収入金	8,251,000
未収利息	33,310,052
前払費用	2,043,899
(B) 負債	28,716,790
未払金	16,413,364
未払解約金	12,303,281
未払利息	145
(C) 純資産総額(A－B)	4,542,085,423
元本	2,873,096,055
次期繰越損益金	1,668,989,368
(D) 受益権総口数	2,873,096,055口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,809円

(注) 当親ファンドの期首元本額は2,729,690,547円、期中追加設定元本額は1,363,863,513円、期中一部解約元本額は1,220,458,005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	2,154,874,211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>	314,524,576円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	140,799,043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>	92,739,108円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	56,310,621円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	43,820,021円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	21,505,810円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	21,419,807円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	12,828,626円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	8,569,414円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	5,449,045円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	64,038円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	63,990円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	63,896円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	63,849円

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

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

○損益の状況 (2018年11月13日～2019年11月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	101,781,185
受取利息	101,824,251
支払利息	△ 43,066
(B) 有価証券売買損益	43,281,216
売買益	281,163,265
売買損	△ 237,882,049
(C) 保管費用等	△ 1,156,761
(D) 当期損益金(A+B+C)	143,905,640
(E) 前期繰越損益金	1,439,664,751
(F) 追加信託差損益金	755,395,473
(G) 解約差損益金	△ 669,976,496
(H) 計(D+E+F+G)	1,668,989,368
次期繰越損益金(H)	1,668,989,368

(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

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。